
中海能源策略混合型证券投资基金

2007 年半年度报告

报 告 期：2007.01.01-2007.06.30

基金管理人名称：中海基金管理有限公司

基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司

送 出 日 期：2007 年 8 月 29 日

重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。全体董事出席本次董事会，没有董事对半年度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于二〇〇七年八月十日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务数据未经审计。

目 录

一、基金简介.....	4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	7
三、基金管理人报告.....	8
五、基金财务会计报告（未经审计）.....	12
六、基金投资组合（2007年6月30日）.....	23
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	28
八、开放式基金份额变动.....	29
九、重大事件揭示.....	29
十、备查文件目录.....	32

一、基金简介

(一) **基金名称：**中海能源策略混合型证券投资基金

基金简称：中海能源

交易代码： 398021

基金运作方式： 契约型开放式

基金合同生效日： 2007年3月13日

报告期末基金份额总额： 17,216,915,044.87份

基金合同存续期： 不定期

(二) **基金投资目标：** 在世界能源短缺和中国经济增长模式向节约型转变的背景下，以能源为投资主题，重点关注具备能源竞争优势的行业和企业，精选个股，并结合积极的权重配置，谋求基金资产的长期稳定增值。

基金投资策略：

1、一级资产配置：本基金根据股票和债券估值的相对吸引力模型(ASSVM， A Share Stocks Valuation Model)，依据宏观经济分析和股票债券估值比较进行一级资产配置。ASSVM模型通过对股票市场和债券市场相对估值判断，决定股票和债券仓位配置。投资决策委员会作为本基金管理人投资的最高决策机构和监督执行机构，决定本基金的一级资产配置。

2、股票投资：本基金围绕能源主题。首先，根据摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业四级分类标准(GICS)，对A股所有行业进行了重新划分。将A股所有行业划分为能源供给型行业和能源消耗型行业；然后，将能源供给型行业细分为能源生产行业和能源设备与服务行业，将能源消耗型行业细分为低耗能行业和高耗能行业（能源下游需求各行业能耗相对高低的界定，主要来源于国家统计局和国家发改委的相关文件）。

本基金股票资产的行业配置主要依据中海能源竞争优势评估体系。本基金依托中海油在能源研究方面的独特优势，收集整理外部能源专家和其他研究机构的研究成果，综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素，结合本公司内部能源研究小组的研究，对未来能源价格的趋势进行预测。在此基础上，行业研究小组根据经济增长和能源约束的动态发展关系，结合未来能源价格趋势的预测，从能源策略的角度，确定能源主题类行业（包括能源供给型行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业和低耗能行业）在组合中的权重。在能源价格趋势向上时，提高能源生产

行业、能源设备与服务行业的权重配置。当能源价格趋势向下时，加大高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的权重配置。

同时本基金还将动态调整行业的配置权重，规避能源价格波动引起的风险。

(1) 一级股票库构建

本基金主要由金融工程小组采用中海能源竞争优势多因子模型从能源供给型上市公司（包括能源生产行业和能源设备与服务行业）、低耗能行业上市公司以及在高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的上市公司中选取综合得分最高的 300 只左右的股票作为一级股票库。

(2) 二级股票库构建

在一级股票库的基础上，由行业研究小组通过分析目标公司的资产分布、盈利结构以及财务状况等指标，综合考察公司的估值、成长性以及在竞争环境中的优势地位等因素精选个股，形成公司的二级股票库。

(3) 三级股票库构建

在二级股票库的基础上，由基金经理选择估值合理、公司管理卓越、业务构架清晰、资产分布合理、财务安全、成长性突出且持续的个股，并由投资决策委员会开会审核通过而形成三级股票库。基金经理根据市场变化，自主选择三级股票库中的股票进行投资。

3、债券投资：债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略。

(1) 久期配置：债券组合的久期配置采用自上而下的方法。

1) 通过数量分析，预测宏观经济周期趋势性变化，结合货币政策和财政政策，判断市场利率的变化趋势；

2) 根据利率变化趋势，确定债券投资组合的久期配置和风险管理方案；

3) 根据市场状况，采用有效的投资策略和交易策略构建组合，并通过数量模型优化。

(2) 个券选择方法：个券的选择采用自下而上的方法，遵循如下原则。

1) 相对价值原则：属性相近的债券，选择收益率较高的券种；在收益率相同的情况下，选择风险（久期）较低的券种。对二者都相近的券种，根据凸性，选择凸性较大的券种。

2) 流动性原则：收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种，市场表现有时差别明显。在一般情况下，避免波动性过大的券种，选择流动性较好的券种。

对于信用品种，本基金建立内部信用评估体系，对信用类债券进行二次评级。只有通过评级，基金经理才能进行投资。

4、权证投资

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以达到控制正股下跌风险、实现保值和锁定收益的目的。同时，发掘潜在的套利机会，以达到增值目的。

本基金持有的权证，可以是因上市公司派送而被动持有的权证，也可以是根据权证投资策略在二级市场上主动购入的权证。

业绩比较基准：沪深 300 指数涨跌幅×65%+上证国债指数涨跌幅×35%

风险收益特征：本基金属混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

(三) **基金管理人：**中海基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

邮政编码： 200120

法定代表人：储晓明

信息披露负责人：夏立峰

电话： 021-68419966

传真： 021-68419525

电子邮箱： xialf@zhfund.com

(四) **基金托管人：**中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码： 100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：蒋松云

联系电话： 010-66106720

传真： 010-66106904

电子邮箱： songyun.jiang@icbc.com.cn

(五) **信息披露报纸名称：**中国证券报、上海证券报、证券时报

登载半年度报告正文的管理人互联网网址： www.zhfund.com

基金半年度报告置备地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼

(六) **注册登记机构：**中海基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

基金本期净收益	1,630,374,466.87
基金份额本期净收益	0.1288
期末可供分配基金收益	827,805,232.87
期末可供分配基金份额收益	0.0481
期末基金资产净值	20,136,821,239.05
期末基金份额净值	1.1696
基金加权平均净值收益率	11.15%
本期基金份额净值增长率	24.75%
基金份额累计净值增长率	24.75%

注：以上财务指标中“本期”指2007年3月13日始至2007年6月30日止。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

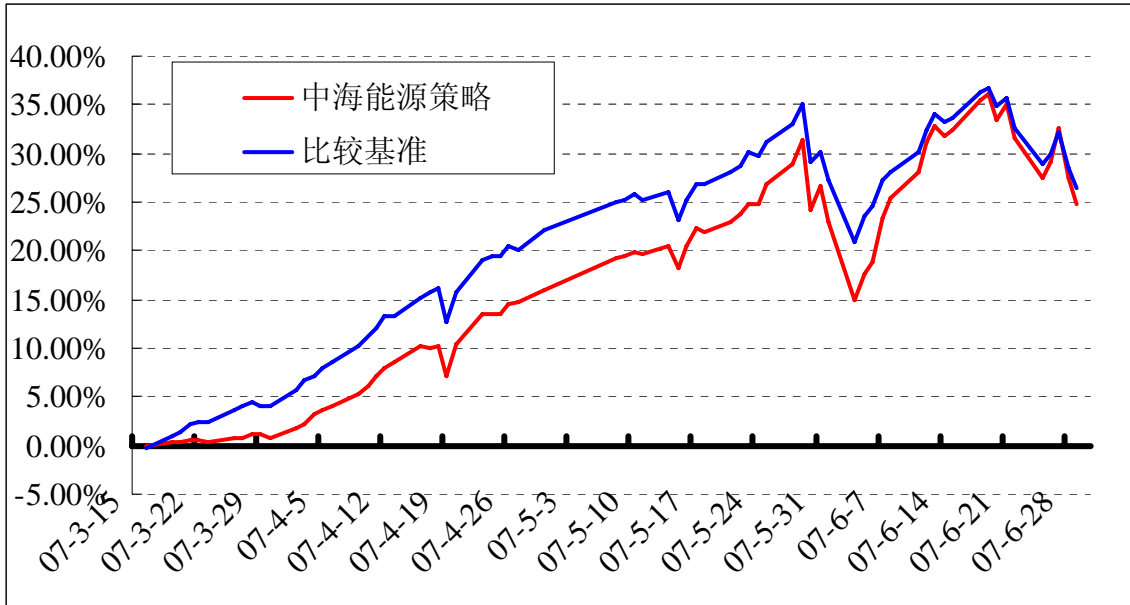
(二) 基金净值表现

1、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标 准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去1个月	-1.48%	2.60%	-3.08%	1.95%	1.60%	0.65%
过去3个月	23.72%	1.97%	21.15%	1.62%	2.57%	0.35%
基金合同 生效起至今	24.75%	1.79%	26.00%	1.50%	-1.25%	0.29%

注1：基金合同生效起至今指2007年3月13日（基金合同生效日）至2007年6月30日。

注2：基金合同生效以来本基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注1: 本基金合同于2007年3月13日生效, 截至报告期末本基金合同生效未满一年。

注2: 按相关法规规定, 本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期, 报告期内本基金仍处于建仓期。截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分(二、投资范围和六、(二)投资组合限制)的有关约定。

(三) 基金合同生效以来每年基金收益分配情况

单位: 人民币

年度	每 10 份基金份额分红数 (至少保留三位小数)	备注
自 2007 年 3 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2007 年 6 月 30 日止	0.800	
合计	0.800	

三、基金管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

基金管理人: 自 2004 年 3 月 18 日成立以来, 始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则, 严格履行基金管理人的责任和义务, 依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系, 为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务, 取得了优异业绩。截至 2007 年 6 月 30 日, 共管理证券投资基金 3 只。

基金经理: 朱晓明先生, 上海交通大学管理学硕士, 8 年证券投资管理经验。历任上海上实资产管理有限公司资产管理部投资经理、高级投资经理, 上实集团下属盛通投资管理顾问有

限公司副总经理、董事副总经理，于 2006 年 7 月进入本公司工作，现任投资管理部副总经理。

（二）管理人合规情况说明

基金管理人在报告期内严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

（三）基金经理工作报告

07 年上半年在居民金融意识觉醒，增加股票资产配置的情况下，A 股市场出现了和 06 年类似的大幅上涨，虽然经历了 5 月份的调整，但从长期配置的角度，结合日本和台湾地区在升值阶段的表现，股票资产的上升空间依然较大。由于个人投资者在 A 股市场的高比例，导致了市场热点的多元化，在坚持价值投资的基础上，也应顺应市场趋势进行灵活的趋势投资。

通货膨胀是 2007 年的投资主题，要素价格和资产价格的上涨推动了股市的上涨，1—5 月份规模以上工业实现增长 42% 反应了实体经济超出预期的增长，与一季度上市公司利润同比增长达到 98% 相呼应，目前正是中国经济与中国股市最佳的阶段。

能源价格继续维持稳中有升的格局，在经济的良好推动下，能源的需求不断上升，由于气候环境的恶化，地缘政治的不稳定，推动石油价格继续创出了新高，而从目前的趋势分析，石油价格继续上涨的概率较大，我们将继续维持低能耗行业，能源供给行业，能源设备与服务行业的超配状态，充分分享能源价格上涨提供的投资机会。

对于高耗能行业，我们认为将分化明显，少部分具有能源竞争优势的行业集中度正在不断提升，比如钢铁行业，而不具有竞争优势的小公司正在不断淘汰出局，这些行业中的龙头公司未来胜出的概率较大。

中海能源策略基金依然坚持立足于能源视角，以长期的思路和阳光选择有核心竞争力的公司，能源是不可再生和稀缺的，在全球经济一体化的背景下，能源的配置价值将在相当长的一个阶段始终存在，具有能源竞争优势的公司必然是最具有核心竞争力，能充分分享经济增长的公司。

截至 2007 年 6 月 3 0 日，本基金份额净值 1.1696 元（累计净值 1.2496 元）。报告期内
本基金取得了 24.75%的净值增长。

四、基金托管人报告

2007年上半年，本基金托管人在对中海能源策略混和型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2007年上半年，中海能源策略混和型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海能源策略混和型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对中海基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的中海能源策略混和型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年 8 月 10 日

五、基金财务会计报告（未经审计）

（一）会计报表内容

1、资产负债表

资产负债表

单位：人民币元

资产	2007年6月30日	附注	负债与持有人权益	2007年6月30日	附注
资产：			负债：		
银行存款	1,591,358,806.60		应付证券清算款	277,903,674.42	
清算备付金	113,254,106.48		应付赎回款	117,374,580.74	
交易保证金	4,025,330.87		应付赎回费	442,362.50	
应收证券清算款	108,442,053.21		应付管理人报酬	22,205,835.54	
应收股利	4,101,325.80		应付托管费	3,700,972.61	
应收利息	17,882,408.72	1	应付佣金	43,766,396.88	3
应收申购款	191,448,012.31		应付利息	0.00	
其他应收款			应付收益	0.00	
股票投资市值	17,619,940,153.32	2	未交税金	0.00	
其中：股票 投资成本	16,506,830,637.66		其他应付款	1,004,789.60	4
债券投资市值	934,079,289.03		卖出回购证券款	0.00	
其中：债券 投资成本	934,079,289.03		短期借款	0.00	
权证投资市值	0.00		预提费用	138,435.00	5
其中：权证 投资成本	0.00		其他费用	0.00	
配股权证	0.00		负债合计：	466,537,047.29	
买入返售证券	0.00		持有人权益：		
待摊费用	0.00		实收基金	17,216,915,044.87	6
			未实现利得	2,092,100,961.31	7
			未分配收益	827,805,232.87	
			持有人权益合计	20,136,821,239.05	
资产合计	20,603,358,286.34		负债及持有人权益 总计	20,603,358,286.34	

注1：本基金合同生效日为2007年3月13日，无去年同期比较数据。下同。

注2：所附附注为本会计报表的组成部分。

2、经营业绩表

经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	本报告期
一、收入		1,707,242,390.08
1、股票差价收入	8	1,615,248,315.38
2、债券差价收入	9	3,464,440.34

3、权证差价收入	10	15,218,672.02
4、债券利息收入		2,569,596.98
5、存款利息收入		10,863,098.73
6、股利收入		55,540,334.95
7、买入返售证券收入		2,913,581.44
8、其他收入	11	1,424,350.24
二、费用		76,867,923.21
1、基金管理人报酬		65,038,891.15
2、基金托管费		10,839,815.22
3、卖出回购证券支出		801,950.68
4、利息支出		0.00
5、其他费用	12	187,266.16
其中：上市年费		.00
信息披露费		101,019.60
审计费用		37,415.40
三、基金净收益		1,630,374,466.87
加：未实现利得		1,131,936,315.66
四、基金经营业绩		2,762,310,782.53

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

3、基金净值变动表

基金净值变动表

单位：人民币元

项目	本报告期
一、期初基金净值	9,745,102,563.26
二、本期经营活动：	
基金净收益	1,630,374,466.87
未实现利得	1,131,936,315.66
经营活动产生的基金净值变动数	2,762,310,782.53
三、本期基金单位交易：	
基金申购款	9,896,594,529.29
基金赎回款	1,139,453,337.76
基金单位交易产生的基金净值变动数	8,757,141,191.53
四、本期向持有人分配收益：	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	1,127,733,298.27
五、期末基金净值	20,136,821,239.05

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

4、基金收益分配表

基金收益分配表

单位：人民币元

项目	附注	本报告期
本期基金净收益		1,630,374,466.87
加：期初基金净收益		0.00
加：本期损益平准金		325,164,064.27
可供分配基金净收益		1,955,538,531.14
减：本期已分配基金净收益	13	1,127,733,298.27
期末基金净收益		827,805,232.87

注：所附附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报表附注

1、基金基本情况

中海能源策略混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监基金字【2007】51号《关于同意中海能源策略混合型证券投资基金设立的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于2007年3月13日生效,该日的基金份额总额为9,745,102,563.26份。

2、会计政策:

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制,会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号

《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金本报告期按2‰的税率缴纳股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局税字[2005]11号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)印花税税率的通知》,自2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,按0.1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。自2005年6月13日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。经国务院批准,财政部决定从2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由现行1‰调整为3‰。即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按3‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(b) 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不缴纳营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入暂免缴营业税。

(c) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,本基金自证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的价差收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(d) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局财税字[2005]102号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,对本基金自2005年6月13日起从上市公司取得的股息红利所得,暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税。

4、本报告期重大会计差错：

无

5、关联方关系及其交易

(1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司	基金管理人、直销机构
中国工商银行	基金托管人、代销机构
中海信托投资有限责任公司	基金管理人股东
国联证券有限责任公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
云南烟草兴云投资股份有限公司（“兴云投资”）	基金管理人的股东

(2) 关联交易

- a. 截至2007年6月30日本基金管理人固有资金未持有本基金份额。
截至2007年6月30日本基金管理人主要股东及其控制机构均未持有本基金份额。
- b. 通过关联方席位进行的交易：国联证券

2007年3月13日—2007年6月30日

单位：人民币元

股票成交金额	占股票总成交金额	债券成交金额	占债券总成交金额	权证成交金额	占权证总成交金额	佣金	占佣金总额
10,167,269,239.49	18.78%	1,768,375.00	4.90%	181,024,883.49	90.80%	8,337,117.96	19.05%

注：

上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1%—股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.11%）—股票买（卖）证管费（买卖成交金额*0.04%）—证券结算风险金（股票成交金额*0.03%+国债现货成交全价金额*0.01%+国债回购成交金额*0.01%）

深市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1%—股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.1875%）—证券结算风险金（股票成交金额*0.03%+国债现货成交全价金额*0.01%+国债回购成交金额*0.01%）

(3) 基金管理人及托管人报酬

a 基金管理人报酬——基金管理费

- 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

- 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共65,038,891.15元，其中已支付基金管理人42,833,055.61元，尚余22,205,835.54元未支付。

b 基金托管人报酬——基金托管费

- 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

- 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币10,839,815.22元，其中已支付人民币7,138,842.61元，尚余人民币3,700,972.61元未支付。

(4) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金自2007年3月13日起至2007年6月30日止，未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为1,591,358,806.60元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为10,065,367.31元。

根据中国证券登记结算有限责任公司要求的证券投资基金结算模式，本基金需通过以基金托管人名义开立的“中国工商银行托管专户”进行证券交易结算。于2007年6月30日，本基金用于证券交易结算的资金通过“中国工商银行托管专户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额113,254,106.48元计入结算备付金科目。

6、会计报表主要项目注释

(1) 应收利息

单位：人民币元

应收银行存款利息	393,314.44
----------	------------

应收清算备付金利息	45,867.96
应收权证交收价差保证金利息	0.00
应收债券利息	17,429,414.43
应收TA认申购款利息	13,811.89
合计	17,882,408.72

(2) 投资估值增值

单位：人民币元

股票估值增值	1,113,109,515.66
债券估值增值	0.00
权证估值增值	18,826,800.00
合计	1,131,936,315.66

(3) 应付佣金

单位：人民币元

申银万国	11,208,889.39
中信证券	4,641,049.06
中银国际	2,765,828.34
西部证券	5,067,103.90
长江证券	4,724,341.61
国联证券	8,337,117.96
齐鲁证券	1,567,310.88
银河证券	777,775.11
招商证券	2,308,985.73
高华证券	2,367,994.90
合计	43,766,396.88

(4) 其他应付款

单位：人民币元

应付结算保证金	1,000,000.00
应付银行间债券交易费	2,700.00
应付回购交易手续费	2,089.60
合计	1,004,789.60

(5) 预提费用

单位：人民币元

审计费	37,415.40
信息披露费	101,019.60
合计	138,435.00

(6) 实收基金

单位：人民币元

期初数	9,745,102,563.26
本期申购	8,387,551,579.00
本期赎回	915,739,097.39
期末数	17,216,915,044.87

(7) 未实现利得

单位：人民币元

期初未实现利得	0.00
其中：	
投资估值增值数	0.00
未实现利得平准金	0.00
期间变动数	2,092,100,961.31
其中：	
估值增值本期净变动数	1,131,936,315.66
未实现利得平准金本期申购变动数	1,135,877,309.40
未实现利得平准金本期赎回变动数	-175,712,663.75
期末未实现利得	2,092,100,961.31

其中：	
投资估值增值数	1,131,936,315.66
未实现利得平准金	960,164,645.65

(8) 股票差价收入

单位：人民币元

卖出股票成交总额	卖出股票成本总额	卖出股票应付佣金	股票差价收入
19,899,980,577.30	18,268,016,353.77	16,715,908.15	1,615,248,315.38

(9) 债券差价收入

单位：人民币元

卖出债券成交总额	卖出债券成本总额	应收利息总额	债券差价收入
215,024,080.66	208,542,085.11	3,017,555.21	3,464,440.34

(10) 权证差价收入

单位：人民币元

卖出权证成交总额	卖出权证成本总额	权证差价收入
111,587,229.33	96,368,557.31	15,218,672.02

(11) 其他收入

单位：人民币元

赎回及转出基金补偿收入 (a)	1,424,350.24
-----------------	--------------

(a) 根据《中海能源策略混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的25%归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

(12) 其他费用

单位：人民币元

银行费用	8,580.64
银行间帐户服务费	3,450.00

开户费	900.00
回购交易费用	35,900.52
审计费	37,415.40
信息披露费用	101,019.60
合计	187,266.16

(13) 收益分配

除息日	红利发放日	分红率	发放红利合计
2007-6-12	2007-6-14	每10份基金份额0.80元	1,127,733,298.27

7、报告期末流通转让受限制的基金资产

(1) 截至 2007 年 6 月 30 日基金持有的流通转让受限制的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	上市日期	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	流通受限原因
601008	连云港	2007-7-26	138,007	687,274.86	2,014,902.20	新股未上市
601328	交通银行	2007-8-16	5,902,000	46,625,800.00	64,862,980.00	新股未上市
601919	中国远洋	2007-9-26	2,247,222	19,056,442.56	41,034,273.72	新股未上市
601998	中信银行	2007-7-30	8,249,200	47,845,360.00	75,892,640.00	新股未上市
002126	银轮股份	2007-7-18	35,867	300,565.46	647,758.02	新股未上市
002127	新民科技	2007-7-18	44,106	414,596.40	800,082.84	新股未上市
002128	露天煤业	2007-7-18	87,837	860,802.60	3,170,915.70	新股未上市
002129	中环股份	2007-7-19	98,899	574,603.19	1,534,912.48	新股未上市
002130	沃尔核材	2007-7-19	15,964	250,954.08	779,841.40	新股未上市
002131	利欧股份	2007-7-27	19,284	263,997.96	584,498.04	新股未上市
002132	恒星科技	2007-7-27	44,423	355,384.00	835,152.40	新股未上市
002134	天津普林	2007-8-16	95,400	789,912.00	1,670,454.00	新股未上市
600963	岳阳纸业	2008-3-24	15,000,000	166,500,000.00	223,950,000.00	增发未上市
600978	宜华木业	2008-4-01	14,000,000	169,400,000.00	234,920,000.00	增发未上市
	合计		45,978,209	453,925,693.00	652,698,411.00	

(2) 估值方法

本基金所持有的流通转让受限制股票，按当日交易所上市的同一股票的市价估值。

本基金所持有的网下申购新股锁定期间按当日交易所上市的同一股票的市价估值；

本基金持有的非公开发行股票估值时分两种情况进行估值：

1、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

2、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得

成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times ((Dt-Dr)/Dt)$$

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；Dt为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

8、承诺事项

无需要说明的承诺事项。

9、期后事项

无需要说明的期后事项。

10、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

六、基金投资组合（2007年6月30日）

本基金托管人——中国工商银行已于2007年8月10日复核了本报告。截至2007年6月30日，中海能源策略混合型证券投资基金资产净值为20,136,821,239.05元，基金份额净值为1.1696元，累计基金份额净值为1.2496元，基金份额为17,216,915,044.87份。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	资产项目	市值（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	股票	17,619,940,153.32	85.53
2	债券	0	0
3	权证	18,826,800.00	0.09
4	货币市场工具	934,079,289.03	4.53
5	银行存款及清算备付金	1,704,612,913.08	8.27
6	其他资产	325,899,130.91	1.58
	合计	20,603,358,286.34	100

2、报告期末按行业分类的股票投资组合：

序号	证券板块名称	市值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	B 采掘业	1,526,844,483.82	7.58
3	C 制造业	6,412,199,496.31	31.84
	C0 食品、饮料	843,667,552.02	4.19
	C1 纺织、服装、皮毛	240,288,246.75	1.19
	C2 木材、家具	515,270,000.00	2.56
	C3 造纸、印刷	443,038,058.24	2.20
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,057,161,511.79	5.25
	C5 电子	3,721,035.98	0.02
	C6 金属、非金属	986,612,079.79	4.90
	C7 机械、设备、仪表	1,129,761,095.52	5.61
	C8 医药、生物制品	505,225,925.82	2.51
	C9 其他制造业	687,453,990.40	3.41
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	575,192,889.45	2.86
5	E 建筑业	417,684,671.25	2.07
6	F 交通运输、仓储业	1,734,009,908.72	8.61
7	G 信息技术业	633,162,048.06	3.14
8	H 批发和零售贸易	1,200,820,986.36	5.96
9	I 金融、保险业	3,532,065,836.96	17.54
10	J 房地产业	1,039,735,559.22	5.16
11	K 社会服务业	176,107,794.40	0.87

12	L 传播与文化产业	212,058,000.00	1.05
13	M 综合类	160,058,478.77	0.79
	合计	17,619,940,153.32	87.50

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细：

序号	股票代码	股票名称	库存数量 (股)	期末市值 (人民币元)	市值占基金资产 净值比例 (%)
1	600036	招商银行	26,089,913	641,290,061.54	3.18
2	600030	中信证券	9,999,999	529,699,947.03	2.63
3	601318	中国平安	7,345,000	525,240,950.00	2.61
4	600978	宜华木业	23,000,000	515,270,000.00	2.56
5	600000	浦发银行	13,750,474	503,129,843.66	2.50
6	601919	中国远洋	26,807,961	489,513,367.86	2.43
7	000983	西山煤电	16,916,337	477,548,193.51	2.37
8	600309	烟台万华	7,497,620	401,572,527.20	1.99
9	600028	中国石化	28,990,000	383,247,800.00	1.90
10	000898	鞍钢股份	21,000,000	371,490,000.00	1.84
11	600963	岳阳纸业	20,064,318	352,735,606.74	1.75
12	600616	第一食品	13,900,000	349,168,000.00	1.73
13	000895	双汇发展	5,500,000	318,450,000.00	1.58
14	601628	中国人寿	7,546,691	310,244,467.01	1.54
15	600011	华能国际	28,683,827	307,777,463.71	1.53
16	600210	紫江企业	47,189,751	291,632,661.18	1.45
17	601166	兴业银行	8,163,964	286,473,496.76	1.42
18	000002	万科A	14,854,000	284,008,480.00	1.41
19	000828	东莞控股	38,430,000	283,997,700.00	1.41
20	000831	关铝股份	17,422,471	282,069,805.49	1.40
21	600026	中海发展	12,019,417	276,206,202.66	1.37
22	600426	华鲁恒升	12,070,222	273,149,123.86	1.36
23	600050	中国联通	45,491,498	267,035,093.26	1.33
24	600206	有研硅股	7,077,818	248,502,189.98	1.23
25	600104	上海汽车	14,339,995	247,651,713.65	1.23
26	600177	雅戈尔	8,999,931	239,488,163.91	1.19
27	600823	世茂股份	9,000,000	235,800,000.00	1.17
28	600547	山东黄金	3,125,459	229,064,890.11	1.14
29	000858	五粮液	7,114,340	223,817,136.40	1.11
30	000001	深发展A	8,000,000	220,160,000.00	1.09
31	000061	农产品	9,689,564	212,201,451.60	1.05
32	600037	歌华有线	8,100,000	212,058,000.00	1.05
33	000792	盐湖钾肥	4,747,006	210,672,126.28	1.05
34	600016	民生银行	18,000,000	205,740,000.00	1.02
35	000027	深能源A	9,040,000	205,388,800.00	1.02
36	601699	潞安环能	4,918,588	201,022,691.56	1.00
37	600600	青岛啤酒	6,999,786	181,224,459.54	0.90
38	601111	中国国航	18,000,000	176,220,000.00	0.88
39	600015	华夏银行	14,064,074	169,331,450.96	0.84
40	000423	东阿阿胶	6,437,826	168,156,015.12	0.84
41	600266	北京城建	5,650,000	160,121,000.00	0.80
42	600528	中铁二局	9,427,673	159,421,950.43	0.79

43	601006	大秦铁路	10,360,000	156,850,400.00	0.78
44	600031	三一重工	3,480,000	153,920,400.00	0.76
45	000006	深振业A	6,000,000	149,400,000.00	0.74
46	000987	广州友谊	4,000,000	142,600,000.00	0.71
47	600123	兰花科创	4,664,236	139,553,941.12	0.69
48	000952	广济药业	4,647,500	126,319,050.00	0.63
49	000623	吉林敖东	2,500,000	124,375,000.00	0.62
50	600887	伊利股份	3,856,738	120,175,956.08	0.60
51	000088	盐田港	7,000,000	117,530,000.00	0.58
52	002024	苏宁电器	2,500,000	117,400,000.00	0.58
53	600100	同方股份	3,349,963	114,903,730.90	0.57
54	000836	鑫茂科技	5,708,965	112,238,251.90	0.56
55	002116	中国海诚	5,005,906	110,129,932.00	0.55
56	000159	国际实业	8,232,501	106,610,887.95	0.53
57	000528	柳工	4,340,000	106,330,000.00	0.53
58	600280	南京中商	5,821,614	103,391,864.64	0.51
59	600675	中华企业	4,500,000	102,195,000.00	0.51
60	000839	中信国安	3,628,749	101,604,972.00	0.50
61	600263	路桥建设	6,465,199	98,141,720.82	0.49
62	000157	中联重科	2,490,000	95,865,000.00	0.48
63	000969	安泰科技	5,522,088	88,519,070.64	0.44
64	000039	中集集团	3,016,183	88,434,485.56	0.44
65	000999	S三九	4,772,147	86,375,860.70	0.43
66	600858	银座股份	2,778,431	85,214,478.77	0.42
67	000625	长安汽车	4,870,000	80,257,600.00	0.40
68	600361	华联综超	2,884,816	79,880,555.04	0.40
69	000680	山推股份	5,000,000	78,900,000.00	0.39
70	601998	中信银行	8,249,200	75,892,640.00	0.38
71	600004	白云机场	3,999,940	74,398,884.00	0.37
72	600631	百联股份	4,249,961	71,356,845.19	0.35
73	600143	金发科技	1,815,050	69,952,027.00	0.35
74	600639	浦东金桥	3,500,000	67,935,000.00	0.34
75	600269	赣粤高速	4,890,000	67,824,300.00	0.34
76	000401	冀东水泥	4,813,996	66,240,584.96	0.33
77	601328	交通银行	5,902,000	64,862,980.00	0.32
78	000024	招商地产	1,300,000	63,830,000.00	0.32
79	600416	湘电股份	2,100,000	63,042,000.00	0.31
80	600786	东方锅炉	1,000,000	62,980,000.00	0.31
81	600183	生益科技	4,999,940	61,349,263.80	0.30
82	000825	太钢不锈	3,000,000	60,180,000.00	0.30
83	000652	泰达股份	2,103,400	59,484,152.00	0.30
84	002120	新海股份	2,784,080	58,020,227.20	0.29
85	600635	大众公用	5,400,000	57,564,000.00	0.29
86	600066	宇通客车	2,050,000	55,842,000.00	0.28
87	600331	宏达股份	1,100,221	53,305,707.45	0.26
88	600308	华泰股份	2,090,000	51,393,100.00	0.26
89	600320	振华港机	2,470,000	49,078,900.00	0.24
90	600240	华业地产	3,446,076	49,072,122.24	0.24
91	000422	湖北宜化	3,500,000	48,510,000.00	0.24
92	600761	安徽合力	1,687,861	48,104,038.50	0.24
93	601600	中国铝业	2,037,842	47,033,393.36	0.23

94	600660	福耀玻璃	1,499,511	45,765,075.72	0.23
95	000031	中粮地产	2,000,000	45,240,000.00	0.22
96	600048	保利地产	919,986	42,254,956.98	0.21
97	600508	上海能源	3,059,800	41,949,858.00	0.21
98	600258	首旅股份	1,060,000	41,403,600.00	0.21
99	000910	大亚科技	2,999,950	38,909,351.50	0.19
100	600122	宏图高科	3,000,000	37,380,000.00	0.19
101	600497	驰宏锌锗	510,000	33,675,300.00	0.17
102	000089	深圳机场	3,000,000	29,970,000.00	0.15
103	600396	金山股份	1,263,842	25,946,676.26	0.13
104	002009	天奇股份	1,335,873	25,207,923.51	0.13
105	600138	中青旅	999,360	24,574,262.40	0.12
106	600801	华新水泥	1,054,231	24,563,582.30	0.12
107	000600	建投能源	2,219,098	21,525,250.60	0.11
108	000417	合肥百货	1,999,054	18,211,381.94	0.09
109	601001	大同煤业	696,358	17,610,893.82	0.09
110	600895	张江高科	1,000,000	17,280,000.00	0.09
111	600121	郑州煤电	1,716,356	14,554,698.88	0.07
112	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.02
113	002134	天津普林	124,850	2,186,123.50	0.01
114	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.01
115	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.01
116	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.00
117	002127	新民科技	44,106	800,082.84	0.00
118	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.00
119	002126	银轮股份	35,867	647,758.02	0.00
120	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.00

4、报告期内股票投资组合的重大变动

(1) 报告期内累计买入、卖出股票金额占期末基金资产净值比例超出2%的股票明细

累计买入金额占期末基金资产净值比例超过2%的股票明细				
序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	1,046,286,890.99	5.20
2	600000	浦发银行	1,014,808,563.89	5.04
3	600030	中信证券	915,618,558.94	4.55
4	600028	中国石化	841,726,018.25	4.18
5	000898	鞍钢股份	807,753,098.63	4.01
6	601318	中国平安	772,118,011.35	3.83
7	000623	吉林敖东	734,780,766.76	3.65
8	000002	万科A	661,759,994.44	3.29
9	600688	S上石化	624,733,340.79	3.1
10	601006	大秦铁路	600,925,126.10	2.98
11	600019	宝钢股份	513,936,036.73	2.55
12	600011	华能国际	506,287,013.70	2.51
13	000983	西山煤电	494,744,914.70	2.46
14	000828	东莞控股	494,111,347.19	2.45
15	600739	辽宁成大	453,251,215.36	2.25
16	600015	华夏银行	444,117,348.89	2.21
17	000858	五粮液	443,461,782.82	2.2

18	601919	中国远洋	439,236,415.22	2.18
19	600887	伊利股份	437,750,759.05	2.17
20	601628	中国人寿	434,090,832.62	2.16
21	600104	上海汽车	424,869,331.00	2.11
22	600616	第一食品	420,165,578.84	2.09
23	600210	紫江企业	411,364,356.73	2.04
24	600005	武钢股份	405,753,124.54	2.01
25	601166	兴业银行	405,188,055.16	2.01

累计卖出金额超期末基金资产净值2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值比例(%)
1	000623	吉林敖东	904,449,897.41	4.49
2	600688	S 上石化	712,203,750.72	3.54
3	600000	浦发银行	638,072,643.21	3.17
4	600036	招商银行	536,537,821.29	2.66
5	600739	辽宁成大	529,853,272.66	2.63
6	600028	中国石化	523,147,597.62	2.6
7	600019	宝钢股份	516,528,806.31	2.57
8	000898	鞍钢股份	503,131,516.49	2.5
9	601006	大秦铁路	465,466,748.25	2.31
10	000002	万 科A	456,134,664.24	2.27
11	600005	武钢股份	421,609,322.39	2.09
12	000800	一汽轿车	394,523,329.12	1.96
13	601318	中国平安	388,136,428.97	1.93
14	600030	中信证券	379,887,483.36	1.89
15	600887	伊利股份	368,691,293.76	1.83
16	000069	华侨城A	361,469,598.55	1.8
17	000858	五 粮 液	336,588,884.77	1.67
18	600320	振华港机	332,904,516.10	1.65
19	600900	长江电力	295,818,903.31	1.47
20	600015	华夏银行	291,271,904.19	1.45

(2) 报告期内买入股票成本总额及卖出股票收入总额

买入股票成本总额(人民币元)	卖出股票收入总额(人民币元)
34,774,846,991.43	19,899,980,577.30

5、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	央行票据	934,079,289.03	4.64
	合计	934,079,289.03	4.64

6、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例(%)
1	06 央行票据 60	194,571,463.01	0.97
2	06 央行票据 74	194,492,517.81	0.97
3	07 央行票据 55	148,976,294.51	0.74

4	05 央行票据 03	100,747,000.00	0.50
5	05 央行票据 15	100,610,300.00	0.50

7、投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

其他资产项目	金额（元）
交易保证金	4,025,330.87
权证价差交收保证金	0.00
应收证券清算款	108,442,053.21
应收股利	4,101,325.80
应收利息	17,882,408.72
应收申购款	191,448,012.31
合计	325,899,130.91

4、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转债。

5、报告期内，本基金持有权证数量和成本列示如下：

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
580009	伊利 CWB1	3,611,890	87,774,931.24	主动持有
580013	武钢 CWB1	3,708,504	8,593,626.07	被动持有
031003	深发 SFC1	800,000	0	被动持有
030004	深发 SFC2	400,000	0	被动持有

6、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金被动持有权证数量和成本列示如下：

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额
031003	深发 SFC1	800,000	0
030004	深发 SFC2	400,000	0

七、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	户均持有份额（万份）	基金持有人份额结构			
		机构		个人	
		持有份额（亿份）	持有比例（%）	持有份额（亿份）	持有比例（%）
583,934	2.9484	0.6542	0.38	171.5150	99.62

经本基金管理人统计，截止2007年6月30日，本公司员工持有本基金情况如下：

基金名称	本公司员工持有该只基金总份额	占该只基金份额比例
中海能源策略混合型证券投资	8501.09	0.000049%

基金		
----	--	--

八、开放式基金份额变动

项目	份额（份）
基金合同生效日基金份额总额	9,745,102,563.26
本报告期内基金份额变动情况：	
期初基金份额总额	9,745,102,563.26
加：本期总申购份额	8,387,551,579.00
减：本期总赎回份额	915,739,097.39
期末基金份额总额	17,216,915,044.87

九、重大事件揭示

- 1、本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼、仲裁等；
- 2、本报告期内本基金管理人、托管机构及高级管理人员未受监管部门稽查或处罚；
- 3、本报告期内基金管理人董事长发生变动，聘任储晓明先生为公司董事长；
- 4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动；
- 5、本报告期内本基金的投资策略未有重大变化；
- 6、本报告期内本基金进行了一次收益分配，每10份基金份额派发红利0.80元（暂免征收所得税），派发红利金额共计1,127,733,298.27元；
- 7、本基金租用席位由公司投资研究部门定期对券商的研究报告和相关服务质量进行综合评价，然后确定席位的租用。本基金租用证券公司专用交易席位情况如下：

券商名称	席位数量	股票成交金额 （元）	比例 （%）	债券成交金额 （元）	比例 （%）	回购成交金额 （元）	比例 （%）
申银万国	1	13,695,831,790.48	25.29	—	—	9,767,000,000.00	86.48
国联证券	1	10,167,269,239.49	18.78	1,768,375.00	4.90	—	—
西部证券	1	6,180,463,398.21	11.41	31,258,960.80	86.58	1,526,800,000.00	13.52
中信证券	1	5,931,007,149.90	10.95	—	—	—	—
长江证券	1	5,761,424,337.72	10.64	—	—	—	—
中银国际	1	3,534,580,502.49	6.53	—	—	—	—
高华证券	1	3,026,167,671.26	5.59	3,075,300.00	8.52	—	—
招商证券	1	2,950,764,158.23	5.45	—	—	—	—

齐鲁证券	1	1,911,369,050.36	3.53	—	—	—	—
银河证券	1	993,955,713.80	1.84	—	—	—	—
合计	10	54,152,833,011.94	100.00	36,102,635.80	100.00	11,293,800,000.00	100.00

券商名称	席位数量	权证成交金额（元）	比例（%）	佣金（元）	比例（%）
申银万国	1	—	—	11,208,889.39	25.61
国联证券	1	181,024,883.49	90.80	8,337,117.96	19.05
西部证券	1	18,339,123.67	9.20	5,067,103.90	11.58
中信证券	1	—	—	4,641,049.06	10.60
长江证券	1	—	—	4,724,341.61	10.79
中银国际	1	—	—	2,765,828.34	6.32
高华证券	1	—	—	2,367,994.90	5.41
招商证券	1	—	—	2,308,985.73	5.28
齐鲁证券	1	—	—	1,567,310.88	3.58
银河证券	1	—	—	777,775.11	1.78
合计	10	199,364,007.16	100.00	43,766,396.88	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

8、报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	信息披露报纸	披露日期
中海能源策略混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-5
中海能源策略混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-5
中海能源策略混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-5
关于中海能源策略混合型证券投资基金限额发售的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-7
中海能源策略混合型证券投资基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-7
中海能源策略混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-9
中海能源策略混合型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-14
中海基金管理有限公司关于中海能源策略混合型证券投资基金开放日常申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-16
关于中海能源策略混合型证券投资基金基金资产净值及基金份额净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-17
中海基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-20
关于中海能源策略混合型证券投资基金参与交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-21
中海基金管理有限公司关于中海能源策略混合型证券投资基金暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-23
中海基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-24
关于中海能源策略混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-5
关于中海能源策略混合型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-9
中海基金管理有限公司关于中海能源策略混合型证券投资基金权证投资方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-11
关于中海基金管理有限公司旗下基金参与广发证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-23
中海能源策略混合型证券投资基金持有宜华木业股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-5-17
中海基金管理有限公司关于修改旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-5-18
中海基金管理有限公司关于中海能源策略混合型证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-6-5
中海能源策略混合型证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-6-5
中海基金管理有限公司关于参与中国工商银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-6-20

十、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中海能源策略混合型证券投资基金的文件
- 2、中海能源策略混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海能源策略混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海能源策略混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
二〇〇七年八月二十九日