中海分红增利混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人：中海基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2018年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称"农业银行"）根据本基金合同规定，于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中海分红增利混合
场内简称	–
基金主代码	398011
前端交易代码	398011
后端交易代码	398012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年6月16日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	600,770,100.89份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，主要通过投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行上市的各类债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取高比例分红收益和资本相对增值的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金采用现金股利精选的投资策略，即：通过公司开发的DM 模型和POD 模型筛选出现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司。 1、股票选择策略 股票投资组合构建通过以下三个阶段进行： 第一阶段：历史上分红能力强股票筛选 本基金运用本公司开发的DM 模型对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）进行过去分红能力筛选。主要通过现金股息率、3 年平均分红额等6 项指标进行综合评价以反应上市公司过去分红强度、持续性、稳定性及分红投资回报。初步筛选出除上证红利指数50 家成份股外的150家左右的上市公司，连同上证红利指数成份股50 家，共200 家左右股票作为中海分红增利基金股票备选库（I）。 第二阶段：分红潜力股票精选 针对第一阶段筛选的股票备选库（I），本基金运用POD 模型对其分红潜力进行精选。 中海POD 模型由3 个大的指标分析单元和5 个量化的核心指标构成。 模型所用数据全部为上市公司公布的历史数据，以保证客观性。中海POD 模型3 个大的分析单元分别是：企业盈利能力，财务健康状况及资产管理能力。通过企业盈利能力的分析，判断企业分红能力的基础是否坚实，未来分红潜力是否大；通过企业短期、长期负债等财务健康指标的分析，判断企业分红意愿；资产管理能力高的企业表明公司的经营效率高，管理层能力很强，有较好的核心竞争力。 中海POD 模型对备选库（I）中的股票进行进一步精选，形成100 家左右上市公司的股票作为本基金股票备选库（II）。 第三阶段：股票投资组合构造。 基金经理小组依据市场、行业景气度及内、外部研究报告，特别是研究员的实地调研报告，确定50 只左右分红类股票。依据投资决策委员会确定的资产配置，完成股票资产投资组合的构造。 2、债券投资策略 本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。根据基金资产总体配置计划，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。 3、权证投资策略 运用B-S模型、二叉树模型、隐含波动率等方法对权证估值进行测算，通过权证交易来锁定风险。通过承担适量风险，进行主动投资以获取超额收益。
业绩比较基准	上证红利指数×70% + 上证国债指数×25% + 银行一年期定期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，低于单纯的股票型基金，高于单纯的债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	贺倩
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95599
传真		021-68419525	010-68121816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-31,534,938.25
本期利润	-66,287,849.65
加权平均基金份额本期利润	-0.1067
本期基金份额净值增长率	-13.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3172
期末基金资产净值	410,229,811.76
期末基金份额净值	0.6828

注1：以上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。

注2：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

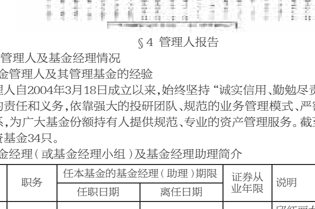
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.42%	2.48%	-5.31%	0.66%	2.89%	1.82%
过去三个月	-11.09%	1.97%	-6.20%	0.65%	-4.89%	1.32%
过去六个月	-13.71%	1.80%	-7.47%	0.70%	-6.24%	1.10%
过去一年	2.68%	1.55%	-4.10%	0.56%	6.78%	0.99%
过去三年	-38.05%	2.12%	-14.13%	1.04%	-23.92%	1.08%
自基金合同生效起至今	144.74%	1.66%	181.74%	1.27%	-37.00%	0.39%

注1："自基金合同生效起至今"指2005年6月16日(基金合同生效日)至2018年6月30日。

注2：本基金的业绩比较基准为上证红利指数*70%+上证国债指数*25%+银行一年期定期存款利率*5%，本基金主要投资于中国证券市场中现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行上市的各类债券。因此，我们选取市场认同度很高的上证红利指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数，同时考虑分红基金的特点，加入了一年期定期存款利率作为业绩比较基准的一部分。在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在70%左右，债券及现金的投资比例控制在30%左右，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例和最新的一年期定期存款利率，来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照70%、25%、5%的比例对基础指数和一年期定期存款利率进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至2018年6月30日，共管理证券投资基金34只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱红丽	研究部副总经理、本基金基金经理、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年11月18日	–	8年	邱红丽女士，英国纽卡斯尔大学跨文化交流与国际管理专业硕士。历任大连龙日木制品有限公司会计，交通银行大连开发区分行会计主管，上海康时信息系统有限公司财务总监，尊龙实业（香港）有限公司财务总监。2009年4月进入我公司工作，历任定量财务分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理、研究副总监，现任研究部副总经理。2014年3月至今任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年11月至今任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2015年11月至今任中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风控稽核部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为，风控稽核部均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年证券市场出现了较大幅度的波动，1月份房地产和银行板块表现较好，2、3月份科技成长股表现较好，到2季度以后医药、白酒、家电和其他消费板块表现较好，而整个上半年医药板块基本是市场上唯一持续表现较好的板块。上半年市场大部分时间投资情绪比较稳定，只是在6月中旬以后由于中美贸易前景的不确定性加大，投资情绪开始出现恐慌，市场出现急跌，期间前期调整比较充分的科技股相对抗跌，而前期表现强势的消费类各股开始下跌，市场整体表现结构性分化非常明显，预计在这样的市场环境下这样的表现还会持续。但是在我国经济结构转型的大环境下，我们看到很多的科技成长股在过往三年的下跌中估值已经趋于合理甚至被低估，高成长性的优势逐渐开始显现。

本基金在2018年上半年一直坚持蓝筹+成长的配置策略，在配置了能够保持持续增长的蓝筹股的前提下，增加配置了一些科技成长股，板块配置方面比较均衡。相对重点的配置了计算机、医药和机械板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值0.6828元(累计净值2.0828元)。报告期内本基金净值增长率为-13.71%，低于业绩比较基准6.24个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年，宏观经济方面仍然存在一定的不确定性，国内方面我们预计下半年经济情况相对会比较稳定。国际方面也存在一定的不确定性，海外经济体特别是美联储的加息预期可能对货币市场走向产生一定的影响。而下半年最大的不确定性还是中美贸易前景存在的不确定性，这直接影响着的市场的风险偏好。但是国内政策方面，我们预计货币政策将在继续坚持稳增长的基调下，保持一定的宽松。在货币政策持续宽松和政策对市场呵护的双重背景下，我们对市场后期走势不悲观。

2018年下半年预计市场投资机会较大的行业会是在国家经济结构转型一直倡导和扶持的科技产业中（如云计算、半导体、芯片等科技板块），和国家战略发展的规划布局中（如医疗养老、消费、新能源等）。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金在本报告期内未发生利润分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

–

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中海基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中海基金管理有限公司在中海分红增利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中海分红增利混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产：			
银行存款		31,662,859.34	72,165,101.67
结算备付金		1,341,369.84	3,536,008.47
存出保证金		415,082.49	472,344.48
交易性金融资产		379,199,576.96	435,693,643.49
其中：股票投资		379,199,576.96	435,693,643.49
基金投资		–	–
债券投资		–	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	–
应收证券清算款		–	6,371,286.70
应收利息		7,639.66	17,492.28
应收股利		–	–
应收申购款		13,726.87	92,771.89
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		412,640,255.16	518,348,648.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		1,902.00	8,887,432.18
应付赎回款		85,819.60	78,806.86
应付管理人报酬		502,339.04	641,641.82
应付托管费		83,723.18	106,940.28
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		389,098.49	1,383,970.51
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		1,347,561.09	1,234,028.40
负债合计		2,410,443.40	12,332,820.05
所有者权益：			
实收基金		600,770,100.89	639,475,125.34
未分配利润		-190,540,289.13	-133,459,296.41
所有者权益合计		410,229,811.76	506,015,828.93
负债和所有者权益总计		412,640,255.16	518,348,648.98

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.6828元，基金份额总额600770100.89份。

6.2 利润表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-58,552,943.48	51,370,675.91
1.利息收入		195,200.06	256,769.41
其中：存款利息收入		195,200.06	256,769.41
债券利息收入		–	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		–	–
其他利息收入		–	–
2. 投资收益（损失以"-"填列）		-24,022,586.35	-7,196,119.50
其中：股票投资收益		-25,318,023.23	-9,277,801.52
基金投资收益		–	–
债券投资收益		–	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		1,295,436.88	2,081,682.02
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-34,752,911.40	58,270,065.23
4. 汇兑收益（损失以"-"号填列）		–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）		27,354.21	39,960.77
减：二、费用		7,734,906.17	6,539,144.90
1. 管理人报酬		3,485,757.51	3,307,133.41
2. 托管费		580,959.52	551,188.93
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		3,468,452.68	2,490,409.97
5. 利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6. 其他费用		199,736.46	190,412.59
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-66,287,849.65	44,831,531.01
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-66,287,849.65	44,831,531.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	639,475,125.34	-133,459,296.41	506,015,828.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	-66,287,849.65	-66,287,849.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-38,705,024.45	9,206,856.93	-29,498,167.52
其中：1.基金申购款	20,665,895.76	-5,038,828.40	15,627,067.36
2.基金赎回款	-59,370,920.21	14,245,685.33	-45,125,234.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	600,770,100.89	-190,540,289.13	410,229,811.76

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	710,009,277.88	-283,360,059.55	426,649,218.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	44,831,531.01	44,831,531.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-18,047,959.58	6,713,844.07	-11,334,115.51
其中：1.基金申购款	50,988,763.89	-17,902,036.66	33,086,727.23
2.基金赎回款	-69,036,723.47	24,615,880.73	-44,420,842.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以"-"号填列）	–	–	–
五、期末所有者权益（基金净值）	691,961,318.30	-231,814,684.47	460,146,633.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨皓鹏 宋宇 周琳

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中海分红增利混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）原名国联分红增利混合型证券投资基金，由国联基金管理有限公司（现已更名为"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【2005】67号《关于同意国联分红增利混合型证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会2006年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定，并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号"关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复"批准，名称变更为中海基金管理有限公司；另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过，并经各基金托管人同意及中国证券监督管理委员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原"国联分红增利混合型证券投资基金"更名为"中海分红增利混合型证券投资基金"。

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，基金托管人为中国农业银行；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2005年6月16日生效，该日的基金份额总额为603,405,465.83份。

本基金主要投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司所发行的股票。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的 80%。本基金投资组合的资产配置比例为：股票的投资比例为35%-95%；债券及现金的投资比例为5%-65%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金业绩比较基准为：上证红利指数*70%+上证国债指数*25%+银行一年期定期存款利率*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2号《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XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称"资管产品运营业务"），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（"中海基金"）	基金管理人、直销机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（"国联证券"）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国联证券	166,533,093.59	6.87%	54,571,626.21	3.03%

6.4.8.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	155,090.91	7.60%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	50,821.96	3.51%	50,821.96	6.51%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,485,757.51	3,307,133.41
其中：支付销售机构的客户维护费	755,080.84	727,646.10

注：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×1.5%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	580,959.52	551,188.93

注：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×0.25%/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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2005年6月16日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	15,332,480.00	15,332,480.00
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	15,332,480.00	15,332,480.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.5500%	2.2200%

注：本基金已按照招募说明书上列示的费率对基金管理人收取了基金投资的相关费用。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	31,662,859.34	173,482.66	51,964,079.15	239,373.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	–
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	–
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	–

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大事项停牌	53.06	2018年7月16日	65.69	253,333	13,126,567.44	13,441,848.98	–
600515	海航基础	2018年1月23日	重大事项停牌	7.85	2018年8月13日	10.04	1,251,000	15,657,059.48	9,820,350.00	–

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	379,199,576.96	91.90
	其中：股票	379,199,576.96	91.90
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	33,004,229.18	8.00
7	其他各项资产	436,449.02	0.11
8	合计	412,640,255.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	129,010,526.82	31.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	13,441,848.98	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,000,899.13	36.08
J	金融业	–	–
K	房地产业	9,820,350.00	2.39
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	36,033,623.35	8.78
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	30,346,853.99	7.40
R	文化、体育和娱乐业	12,392,688.70	3.02
S	综合	–	–
	合计	379,199,576.96	92.44

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	6,199,210	35,583,465.40	8.67
2	300059	东方财富	1,316,840	17,355,951.20	4.23
3	002371	北方华创	342,000	16,987,140.00	4.14
4	000977	浪潮信息	677,900	16,167,915.00	3.94
5	300253	卫宁健康	1,293,900	16,031,421.00	3.91
6	600763	通策医疗	314,800	15,321,316.00	3.73
7	002368	太极股份	517,700	15,049,539.00	3.67
8	300015	爱尔眼科	465,331	15,025,537.99	3.66
9	603019	中科曙光	317,700	14,572,899.00	3.55
10	600845	宝信软件	550,212	14,498,086.20	3.53

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601155	新城控股	35,869,188.50	7.09
2	300012	华测检测	31,877,976.98	6.30
3	002304	洋河股份	21,550,873.70	4.26
4	600136	当代明诚	19,993,691.19	3.95
5	300059	东方财富	18,653,495.82	3.69
6	300212	易华录	18,457,247.00	3.65
7	002696	百洋股份	18,352,131.02	3.63
8	603986	兆易创新	18,162,871.00	3.59
9	601877	正泰电器	17,845,694.10	3.53
10	601939	建设银行	17,818,120.46	3.52
11	600030	中信证券	17,466,955.00	3.45
12	002371	北方华创	17,442,183.96	3.45
13	300339	润和软件	17,191,502.00	3.40
14	600048	保利地产	16,409,917.16	3.24
15	000002	万 科Ａ	16,407,196.34	3.24
16	600340	华夏幸福	16,190,183.00	3.20
17	002146	荣盛发展	16,170,956.00	3.20
18	300409	道氏技术	16,041,337.74	3.17
19	603019	中科曙光	15,734,511.00	3.11
20	000977	浪潮信息	15,633,093.80	3.09
21	600740	山西焦化	15,592,529.82	3.08
22	002368	太极股份	15,432,192.00	3.05
23	600845	宝信软件	15,381,220.91	3.04
24	300253	卫宁健康	14,962,280.22	2.96
25	603160	汇顶科技	14,715,216.00	2.91
26	000681	视觉中国	14,588,508.08	2.88
27	300081	恒信东方	14,477,892.68	2.86
28	300010	立思辰	14,219,313.80	2.81
29	002410	广联达	14,075,778.56	2.78
30	002439	启明星辰	14,070,178.33	2.78
31	002380	科远股份	14,011,526.00	2.77
32	300687	赛意信息	14,007,454.00	2.77
33	300364	中文在线	13,871,348.48	2.74
34	002841	视源股份	13,799,578.25	2.73
35	002180	纳思达	13,432,250.00	2.65
36	300036	超图软件	13,410,941.69	2.65
37	603939	益丰药房	13,126,567.44	2.59
38	600029	南方航空	12,933,225.97	2.56
39	601111	中国国航	12,913,391.00	2.55
40	600115	东方航空	12,877,913.00	2.54
41	600856	中天能源	12,864,417.00	2.54
42	300015	爱尔眼科	12,724,112.32	2.51
43	600515	海航基础	12,652,567.00	2.50
44	300418	昆仑万维	12,613,195.00	2.49
45	601233	桐昆股份	12,456,007.60	2.46
46	300346	南大光电	12,410,713.28	2.45
47	300559	佳发教育	12,389,524.31	2.45
48	002320	海峡股份	12,227,318.00	2.42
49	300170	汉得信息	12,208,715.00	2.41
50	300550	和仁科技	11,920,717.00	2.36
51	002023	海特高新	11,851,869.43	2.34
52	000066	中国长城	11,713,841.41	2.31
53	002152	广电运通	11,676,206.92	2.31
54	002376	新北洋	11,611,513.00	2.29
55	300045	华力创通	11,435,703.00	2.26
56	002027	分众传媒	11,346,784.00	2.24
57	300316	晶盛机电	11,187,446.00	2.21
58	603039	泛微网络	10,886,250.83	2.15
59	603799	华友钴业	10,357,412.00	2.05
60	601009	南京银行	10,325,336.60	2.04
61	600486	扬农化工	10,288,531.00	2.03
62	000063	中兴通讯	10,266,180.35	2.03

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	32,567,811.00	6.44
2	601155	新城控股	31,897,295.54	6.30
3	601318	中国平安	26,708,651.00	5.28
4	000063	中兴通讯	24,546,960.89	4.85
5	000537	广宇发展	24,355,925.78	4.81
6	002320	海峡股份	22,835,023.81	4.51
7	600887	伊利股份	21,611,803.67	4.27
8	601233	桐昆股份	21,364,260.58	4.22
9	002456	欧菲科技	21,233,726.50	4.20
10	600136	当代明诚	20,748,501.00	4.10
11	601888	中国国旅	20,745,092.04	4.10
12	002027	分众传媒	20,232,915.86	4.00
13	002304	洋河股份	20,096,179.69	3.97
14	601100	恒立液压	19,933,019.34	3.94
15	000735	罗 牛 山	19,916,002.83	3.94
16	002714	牧原股份	19,483,958.00	3.85
17	000001	平安银行	18,952,362.40	3.75
18	000333	美的集团	18,759,029.84	3.71
19	600740	山西焦化	17,461,612.00	3.45
20	002696	百洋股份	17,075,420.12	3.37
21	300212	易华录	17,049,949.15	3.37
22	002596	海南瑞泽	17,006,734.00	3.36
23	000886	海南高速	16,645,328.88	3.29
24	601336	新华保险	15,683,108.00	3.10
25	300409	道氏技术	15,570,651.43	3.08
26	002146	荣盛发展	15,261,979.00	3.02
27	300081	恒信东方	14,795,692.91	2.92
28	601877	正泰电器	14,722,517.38	2.91
29	600048	保利地产	14,571,238.00	2.88
30	600340	华夏幸福	14,412,505.76	2.85
31	000002	万 科Ａ	14,410,790.84	2.85
32	000661	长春高新	14,333,670.24	2.83
33	600030	中信证券	14,086,889.00	2.78
34	002157	正邦科技	13,850,923.37	2.74
35	600346	恒力股份	13,623,941.06	2.69
36	002380	科远股份	13,552,369.72	2.68
37	600036	招商银行	13,392,401.99	2.65
38	002142	宁波银行	13,133,681.26	2.60
39	002493	荣盛石化	13,116,136.00	2.59
40	600856	中天能源	13,110,533.00	2.59
41	601398	工商银行	12,556,511.90	2.48
42	300364	中文在线	12,460,161.30	2.46
43	601111	中国国航	12,316,336.00	2.43
44	300418	昆仑万维	12,106,580.00	2.39
45	600029	南方航空	12,039,187.00	2.38
46	002439	启明星辰	11,708,275.64	2.31
47	300168	万达信息	11,674,592.80	2.31
48	000066	中国长城	11,527,876.76	2.28
49	300170	汉得信息	11,452,100.95	2.26
50	600115	东方航空	11,393,642.00	2.25
51	002152	广电运通	11,173,846.00	2.21
52	002376	新北洋	11,081,986.00	2.19
53	600521	华海药业	10,810,550.96	2.14
54	300045	华力创通	10,747,612.73	2.12
55	603160	汇顶科技	10,565,690.70	2.09
56	603799	华友钴业	10,394,223.00	2.05

注：本报告期内，累计卖出股票金额以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,215,739,298.95
卖出股票收入（成交）总额	1,212,162,430.85

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	415,082.49
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	7,639.66
5	应收申购款	13,726.87
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	436,449.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
34,919	17,204.68	17,128,171.41	2.85%	583,641,929.48	97.15%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,910.99	0.0007%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年6月16日）基金份额总额	603,405,465.83
本报告期期初基金份额总额	639,475,125.34
本报告期基金总申购份额	20,665,895.76
减：本报告期基金总赎回份额	59,370,920.21
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	–
本报告期期末基金份额总额	600,770,100.89

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，免去杨皓鹏先生代理督察长职务，聘任黄乐军先生担任督察长职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对中海基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令公司进行为期6个月的整改，整改期间暂停受理公司公募基金产品募集申请。公司高度重视，制定相关整改措施，并持续进行全面整改，行政监管措施决定书指出的问题公司已整改完毕，并将整改报告向监管部门报告。公司前任总经理黄鹏及前任督察长王莉，分别收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对黄鹏采取出具警示函措施的决定》、《关于对王莉采取监管谈话措施的决定》，目前公司已完成高级管理人员的调整。本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	447,688,541.86	18.46%	327,394.35	16.04%	–
华创证券	2	414,785,405.98	17.10%	386,289.05	18.93%	–
银河证券	2	323,444,540.00	13.34%	301,224.91	14.76%	–
中金公司	2	304,862,237.72	12.57%	222,946.00	10.92%	–
长江证券	1	235,127,935.64	9.69%	218,974.08	10.73%	–
西南证券	1	213,947,263.80	8.82%	156,460.26	7.67%	–
国联证券	1	166,533,093.59	6.87%	155,090.91	7.60%	–
兴业证券	2	158,426,984.85	6.53%	130,659.37	6.40%	–
国信证券	1	74,088,674.25	3.05%	68,998.87	3.38%	–
中泰证券	1	38,616,245.80	1.59%	35,962.35	1.76%	–
东北证券	1	37,939,392.80	1.56%	27,745.08	1.36%	–
安信证券	1	10,063,737.59	0.41%	9,372.32	0.46%	–
华西证券	1	–	–	–	–	–
长城证券	1	–	–	–	–	–
宏源证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	2	–	–	–	–	–
新时代证券	2	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
第一创业证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
川财证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–

注1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注2：本报告期内新增了中金公司的上海和深圳交易单元。

注3：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。

注4：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

中海基金管理有限公司

2018年8月28日