

中海合嘉增强收益债券型证券投资基金

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:平安银行股份有限公司
送出日期:2018年8月28日

1.1 重要提示
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。

2.1 基金基本情况
基金名称:中海合嘉增强收益债券型证券投资基金
基金代码:000969
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2016年06月30日

2.2 基金产品说明
基金投资目标:本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
基金投资策略:本基金采取自上而下的投资策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金年度报告全文刊登在中国证监会指定网站
基金年度报告全文刊登在中国证监会指定网站

3.1 主要会计数据和财务指标
基金净值:1,000,000.00
基金净值增长率:1.23%

3.2 基金净值表现
基金净值增长率:1.23%
基金净值增长率:1.23%

3.3 基金投资组合报告
基金投资组合报告:截至2018年6月30日,本基金总资产为1,000,000.00元,其中债券投资占95.23%。

3.4 基金管理人报告
基金管理人报告:报告期内,本基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金管理工作。

3.5 基金托管人报告
基金托管人报告:报告期内,基金托管人按照国家法律法规和基金合同的约定,履行了基金托管职责。

3.6 会计师事务所审计意见
会计师事务所审计意见:标准无保留意见
会计师事务所审计意见:标准无保留意见

3.7 备查文件目录
基金合同、托管协议、招募说明书
基金合同、托管协议、招募说明书

3.8 其他应披露事项
其他应披露事项:无
其他应披露事项:无

3.9 基金合同变更事项
基金合同变更事项:无
基金合同变更事项:无

3.10 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.11 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.12 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.13 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.14 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.15 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.16 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.17 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.18 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.19 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.20 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.21 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.22 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.23 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.24 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.25 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.26 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.27 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.28 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.29 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.30 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.31 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.32 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.33 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.34 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.35 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.36 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.37 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.38 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.39 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.40 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.41 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.42 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.43 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.44 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.45 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.46 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.47 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.48 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

3.49 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

3.50 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

3.51 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

3.52 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.53 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

3.54 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

3.55 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

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,公司对研究、投资、交易、风险管理等环节,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处,由交易室通过自营交易系统模块并具体执行相关交易,使公平交易制度要求的时间优先、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事项,由交易室事前审核,风控稽核部对相关交易价格进行事前审核,风控稽核部事前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要素的采集,进行了相关的假设检验;对于相关溢价因素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标准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收盘价的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情况,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
2018年上半年,全球经济保持平稳态势,而中国经济增长放缓,国内股市政策由稳健中性转向稳健灵活适度,流动性出现边际宽松,但在信用风险冲击下,前期经济通胀稳定等因素干扰下,债市收益率整体震荡下行。

基本面上,国内经济增速趋缓,2018年2季度GDP增速从1季度的6.8%下降1个百分点至6.7%。内外压力下,基建投资走弱,净出口拖累扩大,消费小幅反弹但可持续性存疑,经济增长持续面临下行压力。

货币政策方面,2018年以来央行将货币政策从稳健中性转向稳健灵活适度,政策出现边际放松。央行分别在4月中旬和6月下旬开展了定向降准,带来了流动性的边际宽松。同时,金融监管方面,《资管新规》、《大额风险暴露管理办法》等落地正合规均较征求意见稿有所放松,加上监管新规暂缓实施,意味着金融监管短期内不再大幅收紧。

在经历了两年多的深度调整后,2018年上半年债市市场开启了慢牛行情。年初,因受到金融监管文件密集发布等因素影响,债市仍在下跌,市场情绪持续转暖后,自4月份开始,央行降准开启,中美贸易局势升级,债市利率率先下行,5月份,受信用风险事件冲击,债市陷入震荡。直至6月下旬,央行执行开降降准,债市重新迎来上涨。截至6月底,10年期国债和国开债收益率分别较年初下行40.51BP和56.72BP。

本基金在2018年上半年各类资产持仓比例变化不大,结构相对均衡。在操作上,各资产比例严格按照法规要求,没有出现流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2018年6月30日,本基金基金份额净值0.940元,累计净值0.940元。本报告期内本基金净值增长率为-1.68%,低于业绩比较基准4.77个百分点。本基金C类基金份额净值0.9804元(累计净值0.9804元)。报告期内本基金C类净值增长率为-1.76%,低于业绩比较基准4.85个百分点。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场和行业走势的简要展望
2018年上半年,国内经济增速放缓,内外外部压力下,基建投资放缓,净出口拖累扩大,消费小幅反弹但可持续性存疑,下半年经济成长或将继续面临下行压力。货币政策方面,在内部经济增速放缓、外贸贸易承压升级背景下,央行货币政策宽松,未来或有进一步降准的空间。资金面上,18年至今,RO01和DR007均维持在2.7%、3.25%左右的较低区间内,资金面基本保持宽松格局。债市估值方面,18年以来多次债市出现出现,在“打补丁”的大趋势下,下半年信用风险冲击压力依然较大。以上多重因素影响着下,无风险及高等级信用利率仍有回落空间,但高风险信用债收益率继续承压。

4.6 管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.7 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.8 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.9 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.10 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.11 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.12 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.13 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.14 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.15 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.16 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.17 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.18 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.19 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.20 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.21 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.22 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.23 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.24 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.25 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.26 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.27 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.28 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.29 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.30 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.31 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.32 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.33 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.34 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.35 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.36 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.37 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.38 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.39 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.40 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.41 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.42 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.43 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.44 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.45 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.46 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.47 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.48 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.49 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.50 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.51 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.52 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.53 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.54 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.55 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

4.56 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的原则,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。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
基金净值:1,000,000.00
基金净值增长率:1.23%

6.4 关联方关系
基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司

6.5 基金投资组合报告
基金投资组合报告:截至2018年6月30日,本基金总资产为1,000,000.00元,其中债券投资占95.23%。

6.6 基金管理人报告
基金管理人报告:报告期内,本基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金管理工作。

6.7 基金托管人报告
基金托管人报告:报告期内,基金托管人按照国家法律法规和基金合同的约定,履行了基金托管职责。

6.8 会计师事务所审计意见
会计师事务所审计意见:标准无保留意见
会计师事务所审计意见:标准无保留意见

6.9 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.10 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.11 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

6.12 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

6.13 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

6.14 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

6.15 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

6.16 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.17 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.18 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

6.19 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

6.20 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服

6.21 基金管理人联系方式
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站
基金管理人联系方式:电话、邮箱、网站

6.22 基金管理人网址
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn
基金管理人网址:www.zhohai.com.cn

6.23 基金管理人承诺
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.24 基金托管人承诺
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。
基金托管人承诺:遵守法律法规,恪守职业道德,诚实信用,勤勉尽责。

6.25 基金销售机构
基金销售机构:平安银行股份有限公司
基金销售机构:平安银行股份有限公司

6.26 基金销售费用
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费
基金销售费用:申购费、赎回费、销售服务费

6.27 基金份额持有人服务
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服
基金份额持有人服务:客户服务热线、在线客服