中海策略精选灵活配置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:上海浦东发展银行股份有限公司
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的法律责任。本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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"浦发银行")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	中海策略精选混合
基金主代码	000166
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月16日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,323,078.77份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多种投资策略，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值，回报投资。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金将深入分析宏观经济、政策层面、市场估值及市场情绪四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，优化大类资产配置，即增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对落后的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。 2、行业轮动策略 本基金在股票投资过程中注重行业轮动策略的应用，主要从定性和定量分析，重点选择景气处于上升、利润增长趋势向好、估值水平低的行业。 定性分析：本基金在分析国内宏观经济周期不同阶段（衰退、复苏、过热和滞胀）的行业景气轮动规律的基础上，结合国内当前和未来经济周期的情况，选择符合宏观经济发展趋势和国家产业政策扶持的行业。 定量分析：对照市场的整体情况，分析各行业的利润增长趋势及估值水平。衡量行业利润增长趋势的指标主要包括行业的营业收入增长率、主营业务利润增长率和净资产收益率等指标；衡量行业估值水平的指标主要包括长率和净资产收益率等指标；衡量行业估值水平的指标主要包括PE、PB、PEG等指标。 3、股票投资策略 在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健，具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。 （1）定量分析 本基金通过综合考察上市公司的财务优势、估值优势和成长优势来进行个股的筛选。 本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分，按照总分的高低在各行业内进行排序，选取各行业内排名靠前的股票。 （2）定性分析 本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的经营情况，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势、经营稳健的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。 4、债券投资策略（可转换债券除外） 在宏观分析和久期及期限结构配置的基础上，本基金对不同类型债券的信用风险、市场流动性、市场风险等因素进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾其基本面分析，综合分析各品种的利差和变化趋势。在信用利差水平较高时持有金融债、公司债（企业债）、资产支持证券等信用品种，在信用利差水平较低时持有国债、央行票据等利率品种，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。 本基金将借助公司内部的行业及公司研究员的专业研究能力，并综合参考外部权威机构的研究成果，对发债主体企业进行深入的基本面分析，主要包括经营历史、行业地位、竞争实力、公司治理、股东或地方政府的实力以及支持力度等；并结合债券的发行条款，综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上以确定信用品种的实际信用风险状况及其信用利差水平，投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。 5、可转换债券投资策略 可转换债券兼具债券和股票的相关特性，其投资风险和收益介于股票和债券之间。在进行可转债筛选时，本基金将首先对可转债自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。 6、权证投资策略 本基金将运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，在证券投资基金中属于中等风险收益品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	胡波
	联系电话	021-38429808	021-61618888
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95528
传真		021-68419525	021-63602540

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	-2,266,126.04
本期利润	-2,534,370.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0439
本期基金份额净值增长率	-5.01%
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	0.2636
期末基金资产净值	47,541,491.90
期末基金份额净值	0.9838

注1:以上所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如，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

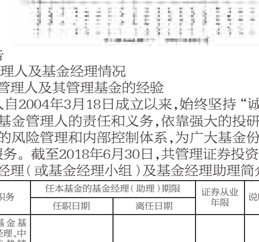
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.27%	0.96%	-1.87%	0.38%	-0.40%	0.58%
过去三个月	-6.62%	0.81%	-1.55%	0.34%	-5.07%	0.47%
过去六个月	-5.01%	0.79%	-0.98%	0.35%	-4.03%	0.44%
自基金合同生效起至今	-3.93%	0.68%	0.21%	0.31%	-4.14%	0.37%

注1:"自基金合同生效起至今"指2017年9月16日(基金转型生效日)至2018年6月30日。

注2:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为0-50%，债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于50%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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		
刘俊	本基金基金经理、中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理、中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013年7月31日	-	15年	刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师，海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007年3月进入本公司工作，曾任产品开发总监。2010年3月至2015年8月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2015年4月至2017年9月任中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金基金经理，2012年6月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013年7月至今任中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年5月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015年12月至今任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年6月至今任中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 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

上半年度经济整体呈现平稳状态。经济分项数据中，由于政府对PPP监管加强以及地方融资政策收紧，基建增速跌落，对投资产生拖累，月度高频经济数据有所回落；价格数据整体保持温和水平；金融数据方面，货币供应增速维持低位；去杠杆背景下，社融数据增速持续下降。

年初时外围市场美元贬值明显，全球大宗商品和原油价格大幅上升，对市场产生较大影响。市场对美国和全球经济复苏预期逐步升高。经过美联储加息、全球贸易争端不断加剧后，市场经济复苏预期转弱。中美贸易争端的升级对部分上市公司和金融市场整体风险偏好产生了直接影响。美联储开启连续加息进程后，央行上调公开市场回购利率和下调部分金融机构存款准备金率释放流动性以做应对。

经济复苏预期转弱和央行降准释放流动性大背景下，市场预期资管新规推进速度放缓，棚改货币化政策将有所调整。债券市场表现良好，长期利率债收益率下行明显。股票市场方面，年初时受益于经济复苏预期，周期股表现较好，但随着经济复苏预期回落，医药、消费等防御类品种及成长股表现更佳。

上半年内本基金整体操作平稳，债券资产以优质短期信用品种和部分可转债为主要配置方向，股票资产年初时以周期性品种为主，二季度后以医药、消费、计算机和半导体等行业为主要配置方向。

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0.9838元(累计净值1.3655元)。报告期内本基金净值增长率为-5.01%，低于业绩比较基准4.03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

政府宏观政策和经济数据的变化方向是证券市场最重要的影响因素。下半年内经济数据能否继续平稳增长、物价数据是否继续维持低位、监管政策的走向等宏观问题将是市场持续关注的焦点。金融市场去杠杆政策力度的变化、财政政策的投向和对投资拉动力度的变化，会直接影响经济数据的变动和金融资产价格的变化。我们预计下半年国际政治经济博弈环境仍将剧烈波动，全球贸易争端的进展对金融市场将产生持续影响。

我们将对上述各方面因素保持实时跟踪。债券市场方面，未来的运作要坚持稳健原则，在规避信用风险的前提下，保持适度的久期，配置优质信用品种。权益市场方面，我们将根据宏观背景变化调整股票资产的仓位占比，同时根据行业和个股的增长前景及估值水平及时调整个股的具体配置。

4.6 管理人对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。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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进行利润分配。

§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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在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。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由中海基金管理有限公司编制本托管人复核的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(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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:中海策略精选灵活配置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		5,903,330.42	2,217,442.21
结算备付金		596,346.20	648,239.77
存出保证金		105,865.86	58,717.84
交易性金融资产		44,254,280.40	53,267,167.10
其中:股票投资		19,850,135.00	14,981,177.00
基金投资		-	-
债券投资		24,404,145.40	38,285,990.10
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		-	15,000,127.50
应收证券清算款		547,068.39	2,395,234.70
应收利息		285,092.40	1,309,871.74
应收股利		-	-
应收申购款		119.18	347.72
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		51,692,102.85	74,897,148.58
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		2,849,295.52	599,763.96
应付赎回款		6,463.94	261,491.32
应付管理人报酬		60,948.58	95,589.63
应付托管费		10,158.08	15,931.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		218,703.21	226,196.97
应交税费		883,548.99	882,648.32
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		121,492.63	45,000.18
负债合计		4,150,610.95	2,126,621.95
所有者权益:			
实收基金		34,804,583.38	50,607,250.99
未分配利润		12,736,908.52	22,163,275.64
所有者权益合计		47,541,491.90	72,770,526.63
负债和所有者权益总计		51,692,102.85	74,897,148.58

注:报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9838元，基金份额总额48,323,078.77份。

6.2 利润表

会计主体:中海策略精选灵活配置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		-1,090,412.41	-
1.利息收入		835,542.16	-
其中:存款利息收入		47,776.57	-
债券利息收入		721,744.56	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		66,021.03	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,660,501.32	-
其中:股票投资收益		-1,741,535.22	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-52,104.16	-
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		133,138.06	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-268,244.25	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,791.00	-
减:二、费用		1,443,957.88	-
1. 管理人报酬		442,475.51	-
2. 托管费		73,745.91	-
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		785,041.83	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		141,462.38	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-2,534,370.29	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-2,534,370.29	-

注:本基金自2017年9月16日起，由"中海安鑫保本混合型证券投资基金"转型为"中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金"，无上年度同期比较数据，下同。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海策略精选灵活配置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)	50,607,250.99	22,163,275.64	72,770,526.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,534,370.29	-2,534,370.29
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)	-15,802,667.61	-6,891,996.83	-22,694,664.44
其中:1.基金申购款	393,563.96	174,387.41	567,951.37
2.基金赎回款	-16,196,231.57	-7,066,384.24	-23,262,615.81
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)	34,804,583.38	12,736,908.52	47,541,491.90
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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

中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金(原名为"中海安鑫保本混合型证券投资基金"，以下简称"本基金")，系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]369号文《关于核准中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中海基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年7月31日正式生效，首次设立募集规模为313,835,907.37份基金份额，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2013]B079号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的保本周期每2年为一个周期。本基金的第一个保本周期为两年，自2013年7月31日开始至2015年7月31日止。第一个保本周期届满时，如符合保本基金存续条件，本基金进入下一保本周期。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期转入第二个保本周期的过渡期折算结果的公告》和《关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期的相关规则公告》，本基金将在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期，过渡期时间自2015年8月8日(含)至2015年9月7日(含)。过渡期最后一个工作日(即下一保本周期起始日前一工作日)为基金份额折算日。折算后基金份额净值调整为1.00元。经本基金管理人计算，并经本基金的基金托管人复核，2015年9月7日本基金折算前的基金份额净值为1.388元，依据前述折算规则确定的折算比例为1.388079651。折算后本基金的总份额由486,047,922.07份调整为674,673,229.98份。折算日的下一个工作日为下一保本周期起始日，保本周期两年，第二个保本周期自2015年9月8日至2017年9月8日，如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《中海基金管理有限公司关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》，本基金在第二个保本周期届满时，由于本基金不再符合保本基金存续条件，因此按照本基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即"中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金"。同时，本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日)，即2017年9月8日至2017年9月15日。在本基金到期操作期间截止日次日，即2017年9月16日起"中海安鑫保本混合型证券投资基金"转型为"中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金"，《中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续期限不定，本基金的基金管理人和注册登记机构为中海基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×30%+中证全债指数收益率×70%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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(以下合称"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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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

本基金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 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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征增值税试点的通知》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
上海浦东发展银行股份有限公司	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

注:本报告期本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

注:本报告期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

注:本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

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	442,475.51	-
其中:支付销售机构的客户维护费	162,182.56	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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	73,745.91	-

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为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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: 本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(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

注:本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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:本基金本报告期末，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
浦发银行	5,903,330.42	42,429.73	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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:本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	19,850,135.00	38.40
	其中:股票	19,850,135.00	38.40
2	固定收益投资	24,404,145.40	47.21
	其中:债券	24,404,145.40	47.21
	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	6,499,676.62	12.57
7	其他各项资产	938,145.83	1.81
8	合计	51,692,102.85	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	9,705,553.00	20.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	984,300.00	2.07
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	9,160,282.00	19.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,850,135.00	41.75

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	002373	千方科技	145,100	1,893,555.00	3.98
2	300373	扬杰科技	63,700	1,821,820.00	3.83
3	300451	创业软件	100,400	1,566,240.00	3.29
4	300059	东方财富	113,300	1,493,294.00	3.14
5	300047	天源迪科	90,600	1,413,360.00	2.97
6	002293	罗莱生活	91,500	1,375,245.00	2.89
7	300003	乐普医疗	35,400	1,298,472.00	2.73
8	600845	宝信软件	48,300	1,272,705.00	2.68
9	002371	北方华创	25,000	1,241,750.00	2.61
10	002456	欧菲科技	65,400	1,054,902.00	2.22

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	601336	新华保险	6,536,927.00	8.98
2	000513	丽珠集团	5,888,807.00	8.09
3	600436	片仔癀	5,097,411.50	7.00
4	002368	太极股份	4,919,558.00	6.76
5	002156	通富微电	4,877,539.00	6.70
6	000963	华东医药	4,500,533.00	6.18
7	002020	京新药业	4,263,130.39	5.86
8	002142	宁波银行	4,191,790.00	5.76
9	601601	中国太保	4,005,442.00	5.50
10	603019	中科曙光	3,788,271.00	5.21
11	002709	天赐材料	3,780,059.44	5.19
12	002146	荣盛发展	3,770,498.24	5.18
13	300595	欧普康视	3,752,734.92	5.16
14	601939	建设银行	3,749,351.00	5.15
15	300078	思创医惠	3,728,136.54	5.12
16	300003	乐普医疗	3,544,386.86	4.87
17	600028	中国石化	3,447,275.00	4.74
18	603986	兆易创新	3,345,244.00	4.60
19	300687	赛意信息	3,315,305.40	4.56
20	300413	快乐购	3,286,995.00	4.52
21	601318	中国平安	3,238,272.00	4.45
22	601398	工商银行	3,171,939.00	4.36
23	000651	格力电器	3,126,918.02	4.30
24	300271	华宇软件	3,110,985.62	4.28
25	300604	长川科技	3,085,006.24	4.24
26	600867	通化东宝	3,018,235.48	4.15
27	300378	鼎捷软件	2,998,551.11	4.12
28	600887	伊利股份	2,993,588.03	4.11
29	600036	招商银行	2,982,305.00	4.10
30	002916	深南电路	2,972,305.00	4.08
31	002373	千方科技	2,966,253.57	4.08
32	002466	天齐锂业	2,944,203.65	4.05
33	002456	欧菲科技	2,901,106.00	3.99
34	600519	贵州茅台	2,890,223.95	3.97
35	600340	华夏幸福	2,872,987.00	3.95
36	601899	紫金矿业	2,848,473.00	3.91
37	600038	中直股份	2,640,269.00	3.63
38	300075	数字政通	2,550,849.00	3.51
39	600048	保利地产	2,540,799.00	3.49
40	002293	罗莱生活	2,527,466.00	3.47
41	000002	万 科A	2,511,897.00	3.45
42	000333	美的集团	2,470,524.62	3.39
43	601933	永辉超市	2,419,373.00	3.32
44	300170	汉得信息	2,368,504.00	3.25
45	300338	开元股份	2,368,362.00	3.25
46	000661	长春高新	2,313,555.00	3.18
47	300047	天源迪科	2,264,164.00	3.11
48	300199	翰宇药业	2,241,214.00	3.08
49	300373	扬杰科技	2,231,272.00	3.07
50	300558	贝达药业	2,224,304.00	3.06
51	300627	华测导航	2,201,288.00	3.02
52	002439	启明星辰	2,185,317.26	3.00
53	002727	一心堂	2,107,512.00	2.90
54	600171	上海贝岭	2,082,340.00	2.86
55	002371	北方华创	2,074,210.00	2.85
56	002508	老板电器	2,014,727.00	2.77
57	000977	浪潮信息	2,000,738.70	2.75
58	600690	青岛海尔	1,946,734.00	2.68
59	300498	温氏股份	1,946,157.00	2.67
60	600050	中国联通	1,898,851.00	2.61
61	000858	五 粮 液	1,892,263.20	2.60
62	000681	视觉中国	1,858,087.00	2.55
63	603799	华友钴业	1,807,822.00	2.48
64	603839	安正时尚	1,788,356.00	2.46
65	300050	世纪鼎利	1,754,814.00	2.41
66	002340	格林美	1,749,161.00	2.40
67	002460	赣锋锂业	1,742,619.00	2.39
68	001979	招商蛇口	1,736,683.00	2.39
69	603103	横店影视	1,719,749.00	2.36
70	002474	榕基软件	1,708,400.72	2.35
71	000063	中兴通讯	1,703,767.00	2.34
72	002120	韵达股份	1,695,554.00	2.33
73	300339	润和软件	1,589,050.00	2.18
74	300409	道氏技术	1,486,003.00	2.04
75	601111	中国国航	1,461,437.00	2.01
76	300422	博世科	1,456,788.00	2.00

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	601336	新华保险	7,845,739.38	10.78
2	000513	丽珠集团	5,955,363.00	8.18
3	600436	片仔癀	5,292,132.50	7.27
4	002156	通富微电	4,630,289.00	6.36
5	002368	太极股份	4,552,130.00	6.26
6	000963	华东医药	4,359,181.00	5.99
7	600036	招商银行	4,313,738.23	5.93
8	002709	天赐材料	4,302,772.00	5.91
9	002142	宁波银行	4,296,038.02	5.90
10	002020	京新药业	4,179,805.00	5.74
11	002146	荣盛发展	3,999,729.74	5.50
12	300595	欧普康视	3,997,172.00	5.49
13	603019	中科曙光	3,965,467.00	5.45
14	601601	中国太保	3,882,721.00	5.34
15	300078	思创医惠	3,789,976.00	5.21
16	601939	建设银行	3,593,642.00	4.94
17	300687	赛意信息	3,427,345.23	4.71
18	002466	天齐锂业	3,372,224.35	4.63
19	300271	华宇软件	3,308,984.40	4.55
20	601318	中国平安	3,290,682.00	4.52
21	600028	中国石化	3,271,409.85	4.50
22	300413	快乐购	3,227,963.00	4.44
23	000661	长春高新	3,142,975.00	4.32
24	601398	工商银行	3,108,135.00	4.27
25	300378	鼎捷软件	3,103,234.15	4.26
26	600887	伊利股份	3,049,805.90	4.19
27	300604	长川科技	2,965,325.96	4.07
28	000651	格力电器	2,938,516.00	4.04
29	600519	贵州茅台	2,900,914.00	3.99
30	600340	华夏幸福	2,853,309.00	3.92
31	000002	万 科A	2,746,910.65	3.77
32	300498	温氏股份	2,737,103.20	3.76
33	600867	通化东宝	2,645,453.09	3.64
34	600038	中直股份	2,623,732.00	3.61
35	601899	紫金矿业	2,623,011.00	3.60
36	300170	汉得信息	2,516,598.00	3.46
37	600048	保利地产	2,506,098.00	3.44
38	300003	乐普医疗	2,424,233.00	3.33
39	601933	永辉超市	2,398,752.00	3.30
40	000333	美的集团	2,397,881.70	3.30
41	300075	数字政通	2,337,369.00	3.21
42	603986	兆易创新	2,285,086.00	3.14
43	300338	开元股份	2,216,220.00	3.05
44	002727	一心堂	2,176,274.00	2.99
45	002439	启明星辰	2,170,779.02	2.98
46	300558	贝达药业	2,164,918.30	2.97
47	000681	视觉中国	2,101,760.00	2.89
48	300627	华测导航	2,079,668.03	2.86
49	600171	上海贝岭	2,069,375.00	2.84
50	300199	翰宇药业	2,059,827.86	2.83
51	000977	浪潮信息	2,035,218.00	2.80
52	000063	中兴通讯	2,022,539.00	2.78
53	603799	华友钴业	1,962,344.00	2.70
54	600050	中国联通	1,887,100.00	2.59
55	600690	青岛海尔	1,884,616.00	2.59
56	002916	深南电路	1,873,005.00	2.57
57	002508	老板电器	1,833,179.00	2.52
58	603839	安正时尚	1,828,894.60	2.51
59	002474	榕基软件	1,818,512.44	2.50
60	000858	五 粮 液	1,814,528.00	2.49
61	300050	世纪鼎利	1,713,394.00	2.35
62	002460	赣锋锂业	1,694,205.00	2.33
63	002120	韵达股份	1,691,305.56	2.32
64	002340	格林美	1,684,453.10	2.31
65	603103	横店影视	1,661,344.99	2.28
66	002456	欧菲科技	1,658,427.00	2.28
67	001979	招商蛇口	1,610,400.00	2.21
68	600383	金地集团	1,555,093.00	2.14
69	600606	绿地控股	1,552,176.00	2.13
70	600584	长电科技	1,549,800.00	2.13
71	300409	道氏技术	1,549,303.00	2.13
72	601111	中国国航	1,508,528.00	2.07
73	002353	杰瑞股份	1,491,369.00	2.05
74	300422	博世科	1,476,652.00	2.03
75	600136	当代明诚	1,468,103.84	2.02
76	600115	东方航空	1,459,902.08	2.01

注:本报告期内，累计卖出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。7.4.3 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	301,289,881.39
卖出股票收入(成交)总额	295,020,644.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,137,980.00	8.70
	其中:政策性金融债	4,137,980.00	8.70
4	企业债券	8,244,633.50	17.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	12,021,531.90	25.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,404,145.40	51.33

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122394	15中银债	40,000	3,999,600.00	8.41
2	124688	PR潜城投	64,230	3,946,933.50	8.30
3	128015	久其转债	24,030	2,249,208.00	4.73
4	018005	国开1701	21,000	2,107,980.00	4.43
5	018002	国开1302	20,000	2,030,000.00	4.27

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。

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	105,865.86
2	应收证券清算款	547,068.39
3	应收股利	-
4	应收利息	285,092.40
5	应收申购款	119.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	938,145.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128015	久其转债	2,249,208.00	4.73
2	128022	众信转债	910,530.00	1.92
3	123006	东财转债	841,890.00	1.77
4	110034	九州转债	812,350.00	1.71
5	128027	崇达转债	585,939.00	1.23
6	113503	泰晶转债	418,488.00	0.88
7	123002	国祯转债	355,985.00	0.75

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

本基金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
1,558	31,016.10	0.00	0.00%	48,323,078.77	100.00%

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	29.31	0.0001%

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(2017年9月16日)基金份额总额	145,210,920.50
本报告期期初基金份额总额	70,263,920.25
本报告期基金总申购份额	546,427.26
减:本报告期基金总赎回份额	22,487,268.74
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	48,323,078.77

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，上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"公司")根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

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

为本基金进行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	
广发证券	2	331,152,450.68	55.53%	242,171.61	55.53%	-
银河证券	1	100,545,003.88	16.86%	73,527.85	16.86%	-
方正证券	2	83,316,456.21	13.97%	60,929.28	13.97%	-
海通证券	1	81,296,615.01	13.63%	59,452.46	13.63%	-

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，联合调研和各类投资研讨会。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:本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

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:以上数据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

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	36,796,041.82	48.56%	8,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	18,400,449.69	24.28%	-	-	-	-
方正证券	14,367,860.68	18.96%	-	-	-	-
海通证券	6,215,100.33	8.20%	-	-	-	-

中海基金管理有限公司

2018年8月28日