中海顺鑫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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安银行股份有限公司(以下简称"平安银行")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(转型后)

基金名称	中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中海顺鑫混合
基金主代码	002213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月12日
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
报告期末基金份额总额	54,837,458.20份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	中海顺鑫保本混合型证券投资基金
基金简称	中海顺鑫保本混合
基金主代码	002213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月30日
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
报告期末基金份额总额	117,415,786.99份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和策略精选个股,在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造稳健收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征,动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。 2、股票投资策略 本基金股票投资主要采用定量分析与定性分析相结合的方法,选择其中具有优势的上市公司进行投资。 1)定量方式 本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、估值指标和分红潜力等进行定量分析,以挑选具有成长优势、估值优势和具有分红优势的个股。 本基金考察的成长性指标主要包括:主营收入增长率、净利润增长率。 本基金考察的估值指标主要包括:市盈率、市盈率/净利增长率。 本基金考察的分红指标主要包括现金股息率、3年平均分红额。 2)定性方式 本基金主要通过实地调研等方法,综合考察评估公司的核心竞争优势,重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司,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。 3、债券投资策略 (1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。 利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。 (2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。 在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分 析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。 (3)债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。 本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量 分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。 4、资产支持证券投资策略 本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。 5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。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×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

2.2 基金产品说明(转型前)

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	方琦
	联系电话	021-38429808	0755-22160168
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95511-3
传真		021-68419525	0755-82080387
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
邮政编码		200120	518001
法定代表人		杨皓鹏	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	-5,188,845.01
本期利润	-4,751,204.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0672
本期加权平均净值利润率	-6.87%
本期基金份额净值增长率	-7.57%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配利润	-2,478,175.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0452
期末基金资产净值	50,686,174.21
期末基金份额净值	0.9243
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日
基金份额累计净值增长率	-7.57%

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年1月11日
本期已实现收益	128,815.50
本期利润	448,984.07
加权平均基金份额本期利润	0.0013
本期加权平均净值利润率	0.12%
本期基金份额净值增长率	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2018年1月11日
期末可供分配利润	3,652,139.46
期末可供分配基金份额利润	0.0311
期末基金资产净值	117,415,786.99
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	2018年1月11日
基金份额累计净值增长率	3.30%

3.2 基金净值表现(转型后)

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	-2.74%	1.03%	-3.54%	0.64%	0.80%	0.39%
过去三个月	-7.89%	0.86%	-3.98%	0.57%	-3.91%	0.29%
自基金合同生效起至今	-7.57%	0.79%	-6.50%	0.59%	-1.07%	0.20%

注1:"自基金合同生效起至今"指2018年1月12日(基金合同转型日)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×50%+中证全债指数收益率×50%。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)、权证、债券[illegible]

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

注:本基金基金合同于2018年1月12日起转型。

3.2 基金净值表现(转型前)

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	0.19%	0.05%	0.32%	0.01%	-0.13%	0.04%
过去三个月	0.29%	0.05%	0.96%	0.01%	-0.67%	0.05%
过去六个月	1.77%	0.07%	1.94%	0.01%	-0.17%	0.06%
过去一年	3.09%	0.06%	3.93%	0.01%	-0.84%	0.05%
自基金合同生效起至2018.1.11	3.30%	0.06%	8.36%	0.01%	-5.06%	0.05%

注:"自基金合同生效起至今"指2015年12月30日(基金合同生效日)至2018年1月11日。

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

注:本基金基金合同于2018年1月12日起转型。

§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(转型后)

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、中海策略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	2015年12月30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6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(原中海顺鑫保本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。
蒋佳良	本基金基金经理	2017年1月10日	2018年6月2日	11年	蒋佳良先生,德国法兰克福大学金融学硕士。历任中国工商银行法兰克福分行资金部交易员、华宝证券有限责任公司证券投资部投资经理、平安资产管理有限责任公司固定收益投资部投资经理。2015年10月进入本公司工作,历任投研中心研究总监、研究部总监。2017年1月至2018年6月任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年3月至2018年6月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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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、中海策略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	2015年12月30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6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(原中海顺鑫保本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。
蒋佳良	本基金基金经理	2017年1月10日	2018年6月2日	11年	蒋佳良先生,德国法兰克福大学金融学硕士。历任中国工商银行法兰克福分行资金部交易员、华宝证券有限责任公司证券投资部投资经理、平安资产管理有限责任公司固定收益投资部投资经理。2015年10月进入本公司工作,历任投研中心研究总监、研究部总监。2017年1月至2018年6月任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年3月至2018年6月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。[illegible]

本报告期,公司对不同组合不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易价差进行了溢价率分析,[illegible]

本报告期,公司根据制度要求,对不同组合同日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,均要求相关当事人对此进行解释并予以留痕。

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,[illegible]

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

[illegible]

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0.9243元(累计净值0.9573元)。报告期内本基金净值增长率为-7.57%,低于业绩比较基准1.07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

[illegible]

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

根据法律法规及本基金合同的相关规定,本基金本报告期内未发生利润分配。

§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,平安银行股份有限公司(以下称"本托管人")在中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,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地复核,未发现本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、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)(转型后)

6.1 资产负债表(转型后)

会计主体:中海顺鑫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
资产:		
银行存款	6.4.7.1	16,059,675.29
结算备付金		652,694.95
存出保证金		97,494.96
交易性金融资产	6.4.7.2	38,268,655.18
其中:股票投资		22,119,194.00
基金投资		-
债券投资		16,149,461.18
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	40,929.39
应收股利		-
应收申购款		19.98
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		55,119,469.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,875,784.88
应付赎回款		-
应付管理人报酬		63,543.35
应付托管费		10,590.54
应付销售服务费		4,236.22
应付交易费用	6.4.7.7	293,461.49
应交税费		2,201.17
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	183,477.89
负债合计		4,433,295.54
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	53,060,908.01
未分配利润	6.4.7.10	-2,374,733.80
所有者权益合计		50,686,174.21
负债和所有者权益总计		55,119,469.75

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9243元,基金份额总额54,837,458.20份。

6.2 利润表

会计主体:中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		-3,171,828.88
1.利息收入		611,113.13
其中:存款利息收入	6.4.7.11	87,471.81
债券利息收入		485,680.23
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		37,961.09
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-4,220,994.51
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-3,606,623.50
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-761,662.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	147,291.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	437,640.92
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	411.58
减:二、费用		1,579,375.21
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	480,348.37
2.托管费	6.4.10.2.2	80,058.03
3.销售服务费	6.4.10.2.3	32,023.20
4.交易费用	6.4.7.19	803,464.32
5.利息支出		980.06
其中:卖出回购金融资产支出		980.06
6.其他费用	6.4.7.20	181,327.30
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-4,751,204.09
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-4,751,204.09

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月12日(基金合同生效日)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)	113,611,964.97	3,803,822.02	117,415,786.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,751,204.09	-4,751,204.09
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)	-60,551,056.96	-1,427,351.73	-61,978,408.69
其中:1.基金申购款	125,194.91	2,240.16	127,435.07
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-60,676,251.87	-1,429,591.89	-62,105,843.76
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)	53,060,908.01	-2,374,733.80	50,686,174.21

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

中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金(原名为"中海顺鑫保本混合型证券投资基金"),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[2015]2756 号《关于准予中海顺鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》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2015年12月30日正式生效,首次设立募集规模为1,261,537,096.13份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的保本周期为两年,自2015年12月30日开始至2018年1月2日止。

根据《中海顺鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《中海顺鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海顺鑫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》,本基金在保本周期届满时,按照本基金合同的约定转型为"中海顺鑫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2018年1月2日至2018年1月9日。同时本基金管理人安排2018年1月10日(含该日)至2018年1月11日(含该日)为过渡期,过渡期最后一个工作日即2018年1月11日为份额折算日。折算后基金份额净值为1.00元,基金总份额为117,415,786.99份。本基金过渡期截止日次日,即2018年1月12日起"中海顺鑫保本混合型证券投资基金"转型为"中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金",《中海顺鑫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均为中海基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券等)、资产支持证券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指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
平安银行股份有限公司	基金管理人、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

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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。

6.4.7.1.2 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。

6.4.7.1.3 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。

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金在本报告期没有应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	480,348.37
其中:支付销售机构的客户维护费	200,736.04

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,058.03

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,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.7.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2018年1月12日(基金合同生效日)至2018年6月30日
	当期应支付的销售服务费
中海基金	789.16
平安银行	17,432.38
国联证券	0.00
合计	18,221.54

注:支付基金销售机构的基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中海基金公司,再由中海基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金份额基金资产净值X 0.1% / 当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金在本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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:本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.7.5 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12日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	16,059,675.29	63,158.45

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体:中海顺鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年1月11日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年1月11日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	54,192,104.94	203,847,802.85
结算备付金		18,657,142.86	5,389,302.30
存出保证金		398,531.54	454,717.99
交易性金融资产	6.4.7.2	43,170,115.50	88,648,304.40
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		43,170,115.50	88,648,304.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	668,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,177,908.90	2,478,348.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		117,595,803.74	968,818,476.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年1月11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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	180,000,000.00
应付赎回款		-	3,363,031.38
应付管理人报酬		77,168.21	835,943.96
应付托管费		12,861.36	139,324.03
应付销售服务费		6,430.69	69,661.99
应付交易费用	6.4.7.7	250.00	460,654.42
应交税费		2,155.90	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,150.59	70,000.00
负债合计		180,016.75	184,938,615.78
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	113,611,964.97	759,187,668.15
未分配利润	6.4.7.10	3,803,822.02	24,692,192.42
所有者权益合计		117,415,786.99	783,879,860.57
负债和所有者权益总计		117,595,803.74	968,818,476.35

注:报告截止日2018年1月11日,基金份额净值1.000元,基金份额总额117,415,786.99份。

6.2 利润表

会计主体:中海顺鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年1月11日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年1月11日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		566,076.26	24,513,285.91
1.利息收入		463,244.50	19,360,188.07
其中:存款利息收入	6.4.7.11	57,182.85	601,095.54
债券利息收入		92,033.67	16,232,019.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		314,027.98	2,527,073.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-217,345.59	250,430.55
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	950,812.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-217,345.59	-701,021.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	640.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	320,168.57	4,064,696.55
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	8.78	837,970.74
减:二、费用		117,092.19	9,379,499.59
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	77,168.21	6,239,295.24
2.托管费	6.4.10.2.2	12,861.36	1,039,882.52
3.销售服务费	6.4.10.2.3	6,430.69	519,941.29
4.交易费用	6.4.7.19	250.35	1,093,061.26
5.利息支出		-	275,922.59
其中:卖出回购金融资产支出		-	275,922.59
6.其他费用	6.4.7.20	20,150.59	211,396.69
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		448,984.07	15,133,786.32
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		448,984.07	15,133,786.32

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海顺鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年1月11日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月11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)	759,187,668.15	24,692,192.42	783,879,860.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	448,984.07	448,984.07
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)	-645,575,703.18	-21,337,354.47	-666,913,057.65
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-645,575,703.18	-21,337,354.47	-666,913,057.65
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)	113,611,964.97	3,803,822.02	117,415,786.99

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)	1,261,537,096.13	-394,100.66	1,261,142,995.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,133,786.32	15,133,786.32
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)	-333,514,803.08	-1,485,198.32	-335,000,001.40
其中:1.基金申购款	39,803.59	257.38	40,060.97
2.基金赎回款	-333,554,606.67	-1,485,455.70	-335,040,062.37
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)	928,022,293.05	13,254,487.34	941,276,780.39

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

中海顺鑫保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2015]2756 号《关于准予中海顺鑫保本混合型证券投资基金注册的批复》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2015年12月30日正式生效,首次设立募集规模为1,261,537,096.13份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中海基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司,基金担保人为中国投融资担保股份有限公司。

根据《中海顺鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的保本周期自《基金合同》生效之日起至 2 个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日或不存在对应日期的,则保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金第一年采用封闭式运作,在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。封闭期结束后转为开放式运作,即第二年采用开放式运作。保本周期届满后,本基金变更为"中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金",为开放式运作。在保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其认购保本金额,则基金管理人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券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:2年期银行定期存款利率(税后)+2%。

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,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金在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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
平安银行股份有限公司	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

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.7.1.2 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。

6.4.7.1.3 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。

6.4.7.1.4 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。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金在本报告期及上年度可比期间没有应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月11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	77,168.21	6,239,295.24
其中:支付销售机构的客户维护费	26,034.62	2,127,412.46

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.2%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.2%/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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月11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	12,861.36	1,039,882.52

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%/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,逐日累计至每月月底,按月支付。

6.4.7.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月11日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中海基金	176.64
平安银行	4,197.94
国联证券	254.63
合计	4,629.21
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中海基金	11,438.32
平安银行	348,828.86
国联证券	14,978.58
合计	375,245.76

注:支付基金销售机构的基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中海基金公司,再由中海基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金份额基金资产净值X 0.1% / 当年天数

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金在本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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1月11日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日持有的基金份额	30,010,550.00	30,101,550.00
期初持有的基金份额	30,010,550.00	30,010,550.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	30,010,550.00	0.00
期末持有的基金份额	0.00	30,010,550.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	3.23%

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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1月11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
平安银行股份有限公司	54,192,104.94	49,533.80	11,085,651.69	109,869.94

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.9 期末(2018年1月11日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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(转型后)

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	22,119,194.00	40.13
	其中:股票	22,119,194.00	40.13
2	固定收益投资	16,149,461.18	29.30
	其中:债券	16,149,461.18	29.30
	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	16,712,370.24	30.32
7	其他各项资产	138,444.33	0.25
8	合计	55,119,469.75	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	11,200,370.00	22.10
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	1,022,900.00	2.02
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	9,895,924.00	19.52
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	22,119,194.00	43.64

7.2.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300373	扬杰科技	73,800	2,110,680.00	4.16
2	002373	千方科技	154,600	2,017,530.00	3.98
3	300059	东方财富	141,400	1,863,652.00	3.68
4	300451	创业软件	106,500	1,661,400.00	3.28
5	600845	宝信软件	61,800	1,628,430.00	3.21
6	300047	天源迪科	103,300	1,611,480.00	3.18
7	603986	兆易创新	14,600	1,584,392.00	3.13
8	002371	北方华创	29,100	1,445,397.00	2.85
9	002456	欧菲科技	86,100	1,388,793.00	2.74
10	300003	乐普医疗	37,500	1,375,500.00	2.71

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	6,833,327.95	13.48
2	601939	建设银行	5,799,894.02	11.44
3	002156	通富微电	5,790,550.00	11.42
4	600436	片仔癀	5,719,763.55	11.28
5	002368	太极股份	5,510,967.75	10.87
6	000513	丽珠集团	5,339,124.41	10.53
7	601601	中国太保	4,747,563.00	9.37
8	002020	京新药业	4,675,673.00	9.22
9	002709	天赐材料	4,579,723.20	9.04
10	300595	欧普康视	4,540,445.40	8.96
11	603019	中科曙光	4,540,234.00	8.96
12	600036	招商银行	4,408,236.00	8.70
13	603986	兆易创新	4,406,908.00	8.69
14	300078	思创医惠	4,299,103.00	8.48
15	000651	格力电器	3,967,980.00	7.83
16	000963	华东医药	3,945,242.00	7.78
17	002142	宁波银行	3,822,457.97	7.54
18	300687	赛意信息	3,821,750.00	7.54
19	300413	快乐购	3,784,282.00	7.47
20	601857	中国石油	3,673,566.00	7.25
21	600028	中国石化	3,626,020.12	7.15
22	300378	鼎捷软件	3,537,028.49	6.98
23	600519	贵州茅台	3,333,932.00	6.58
24	002916	深南电路	3,268,169.00	6.45
25	002456	欧菲科技	3,213,058.00	6.34
26	002466	天齐锂业	3,153,643.10	6.22
27	000333	美的集团	3,106,544.00	6.13
28	002373	千方科技	3,105,683.00	6.13
29	300604	长川科技	3,103,980.40	6.12
30	000661	长春高新	2,988,563.00	5.90
31	600171	上海贝岭	2,897,212.36	5.72
32	300271	华宇软件	2,872,192.00	5.67
33	600867	通化东宝	2,821,091.00	5.57
34	000858	五 粮 液	2,774,789.00	5.47
35	601899	紫金矿业	2,747,796.00	5.42
36	300075	数字政通	2,721,878.00	5.37
37	002439	启明星辰	2,702,470.78	5.33
38	002146	荣盛发展	2,664,903.00	5.26
39	300047	天源迪科	2,600,477.94	5.13
40	300003	乐普医疗	2,573,980.00	5.08
41	300373	扬杰科技	2,559,625.00	5.05
42	000002	万 科A	2,549,295.70	5.03
43	300627	华测导航	2,540,572.00	5.01
44	600050	中国联通	2,540,317.00	5.01
45	300338	开元股份	2,498,305.00	4.93
46	300199	翰宇药业	2,473,381.00	4.88
47	300558	贝达药业	2,455,092.00	4.84
48	002371	北方华创	2,380,117.00	4.70
49	000977	浪潮信息	2,336,353.70	4.61
50	002293	罗莱生活	2,325,527.00	4.59
51	002727	一心堂	2,291,461.00	4.52
52	603799	华友钴业	2,276,170.00	4.49
53	601398	工商银行	2,220,060.00	4.38
54	600340	华夏幸福	2,217,545.00	4.38
55	600690	青岛海尔	2,199,138.00	4.34
56	603839	安正时尚	2,179,529.60	4.30
57	600048	保利地产	1,984,490.00	3.92
58	300050	世纪鼎利	1,925,792.00	3.80
59	002120	韵达股份	1,916,502.00	3.78
60	002340	格林美	1,881,344.00	3.71
61	002460	赣锋锂业	1,858,286.00	3.67
62	601933	永辉超市	1,848,796.00	3.65
63	002474	榕基软件	1,834,222.26	3.62
64	300339	润和软件	1,771,273.00	3.49
65	002465	海格通信	1,768,226.00	3.49
66	300422	博世科	1,754,729.00	3.46
67	300203	聚光科技	1,740,099.00	3.43
68	300059	东方财富	1,730,349.00	3.41
69	600038	中直股份	1,616,000.00	3.19
70	000681	视觉中国	1,534,225.00	3.03
71	300409	道氏技术	1,533,891.00	3.03
72	300170	汉得信息	1,523,469.00	3.01
73	603078	江化微	1,521,699.20	3.00
74	600584	长电科技	1,521,308.00	3.00
75	002353	杰瑞股份	1,512,199.00	2.98
76	002563	森马服饰	1,507,546.00	2.97
77	002304	洋河股份	1,493,904.00	2.95
78	300451	创业软件	1,482,434.00	2.92
79	600845	宝信软件	1,469,399.08	2.90
80	600136	当代明诚	1,466,127.00	2.89
81	002624	完美世界	1,459,152.00	2.88
82	300418	昆仑万维	1,453,323.00	2.87
83	300383	光环新网	1,446,530.00	2.85
84	001979	招商蛇口	1,427,790.00	2.82
85	600760	中航沈飞	1,409,557.00	2.78
86	300070	碧水源	1,404,121.00	2.77
87	603619	中曼石油	1,399,951.00	2.76
88	603808	歌力思	1,369,284.80	2.70
89	300236	上海新阳	1,351,111.00	2.67
90	300346	南大光电	1,335,672.00	2.64
91	000538	云南白药	1,314,343.00	2.59
92	002384	东山精密	1,307,125.00	2.58
93	002236	大华股份	1,299,000.00	2.56
94	300324	旋极信息	1,295,650.00	2.56
95	000725	京东方A	1,293,824.00	2.55
96	000768	中航飞机	1,293,704.00	2.55
97	300661	圣邦股份	1,244,887.00	2.46
98	601006	大秦铁路	1,243,294.00	2.45
99	300045	华力创通	1,242,108.00	2.45
100	601088	中国神华	1,227,236.00	2.42
101	002380	科远股份	1,201,729.00	2.37
102	002659	凯文教育	1,183,989.00	2.34
103	002920	德赛西威	1,177,538.00	2.32
104	600392	盛和资源	1,170,549.00	2.31
105	300188	美亚柏科	1,167,720.00	2.30
106	002557	洽洽食品	1,152,008.00	2.27
107	300502	新易盛	1,142,234.00	2.25
108	000426	兴业矿业	1,129,515.00	2.23
109	300164	通源石油	1,112,317.00	2.19
110	002007	华兰生物	1,094,913.00	2.16
111	600887	伊利股份	1,092,504.00	2.16
112	603365	水星家纺	1,091,792.00	2.15
113	600185	格力地产	1,090,363.00	2.15
114	600419	天润乳业	1,084,431.00	2.14
115	002508	老板电器	1,078,644.00	2.13
116	600398	海澜之家	1,065,430.00	2.10
117	002554	惠博普	1,051,867.65	2.08

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。

7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	6,723,808.24	13.27
2	600436	片仔癀	5,945,706.00	11.73
3	601939	建设银行	5,585,143.00	11.02
4	002156	通富微电	5,501,892.29	10.85
5	000513	丽珠集团	5,357,969.04	10.57
6	002368	太极股份	5,106,866.00	10.07
7	300595	欧普康视	4,833,570.31	9.54
8	603019	中科曙光	4,754,912.00	9.38
9	002020	京新药业	4,587,610.00	9.06
10	601601	中国太保	4,583,150.00	9.04
11	300078	思创医惠	4,373,645.00	8.63
12	002709	天赐材料	4,292,374.72	8.47
13	600036	招商银行	4,242,080.91	8.37
14	300687	赛意信息	3,931,367.20	7.76
15	002142	宁波银行	3,839,011.73	7.57
16	000651	格力电器	3,724,889.00	7.35
17	300413	快乐购	3,717,206.00	7.33
18	300378	鼎捷软件	3,671,151.00	7.24
19	600519	贵州茅台	3,343,262.45	6.60
20	600028	中国石化	3,339,020.00	6.59
21	601857	中国石油	3,306,881.00	6.52
22	000661	长春高新	3,221,447.00	6.36
23	300271	华宇软件	3,071,161.00	6.06
24	002466	天齐锂业	3,060,077.70	6.04
25	000963	华东医药	3,016,413.00	5.95
26	000333	美的集团	3,014,935.26	5.95
27	300604	长川科技	3,006,025.64	5.93
28	600171	上海贝岭	2,878,867.00	5.68
29	603986	兆易创新	2,772,768.00	5.47
30	002439	启明星辰	2,686,770.40	5.30
31	000858	五 粮 液	2,622,961.00	5.17
32	002146	荣盛发展	2,615,867.73	5.16
33	600050	中国联通	2,523,526.00	4.98
34	000002	万 科A	2,505,309.00	4.94
35	300075	数字政通	2,503,870.00	4.94
36	601899	紫金矿业	2,484,750.00	4.90
37	603799	华友钴业	2,472,755.00	4.88
38	300627	华测导航	2,396,866.76	4.73
39	300558	贝达药业	2,392,892.76	4.72
40	000977	浪潮信息	2,370,578.00	4.68
41	002727	一心堂	2,366,932.00	4.67
42	300338	开元股份	2,341,194.00	4.62
43	300199	翰宇药业	2,276,891.00	4.49
44	601398	工商银行	2,273,290.00	4.49
45	603839	安正时尚	2,218,149.00	4.38
46	600340	华夏幸福	2,195,133.00	4.33
47	600690	青岛海尔	2,123,858.00	4.19
48	002916	深南电路	2,087,898.00	4.12
49	002474	榕基软件	1,955,621.60	3.86
50	002120	韵达股份	1,914,045.21	3.78
51	300050	世纪鼎利	1,880,758.00	3.71
52	000681	视觉中国	1,837,764.00	3.63
53	600867	通化东宝	1,811,085.39	3.57
54	002340	格林美	1,807,617.00	3.57
55	002460	赣锋锂业	1,805,461.00	3.56
56	300422	博世科	1,776,459.84	3.50
57	300203	聚光科技	1,757,715.00	3.47
58	600048	保利地产	1,729,463.00	3.41
59	002465	海格通信	1,726,400.06	3.41
60	600136	当代明诚	1,706,429.00	3.37
61	601933	永辉超市	1,672,845.00	3.30
62	002456	欧菲科技	1,661,812.00	3.28
63	300170	汉得信息	1,655,018.00	3.27
64	002353	杰瑞股份	1,632,907.00	3.22
65	300409	道氏技术	1,623,930.00	3.20
66	600038	中直股份	1,590,637.76	3.14
67	002563	森马服饰	1,569,500.00	3.10
68	603808	歌力思	1,564,133.22	3.09
69	600584	长电科技	1,537,894.00	3.03
70	603078	江化微	1,496,285.00	2.95
71	002624	完美世界	1,438,207.03	2.84
72	300383	光环新网	1,419,297.60	2.80
73	300070	碧水源	1,407,081.00	2.78
74	300418	昆仑万维	1,375,513.00	2.71
75	002304	洋河股份	1,364,530.00	2.69
76	002659	凯文教育	1,349,580.20	2.66
77	603619	中曼石油	1,334,803.00	2.63
78	600760	中航沈飞	1,329,356.00	2.62
79	603365	水星家纺	1,316,088.00	2.60
80	300188	美亚柏科	1,297,191.00	2.56
81	300003	乐普医疗	1,290,909.00	2.55
82	300346	南大光电	1,277,342.20	2.52
83	300236	上海新阳	1,275,567.00	2.52
84	601006	大秦铁路	1,268,193.00	2.50
85	001979	招商蛇口	1,264,615.00	2.49
86	002236	大华股份	1,261,198.59	2.49
87	000538	云南白药	1,257,061.00	2.48
88	000725	京东方A	1,247,686.00	2.46
89	002380	科远股份	1,217,745.00	2.40
90	601088	中国神华	1,208,953.00	2.39
91	300045	华力创通	1,200,171.00	2.37
92	300661	圣邦股份	1,198,606.00	2.36
93	600887	伊利股份	1,191,484.00	2.35
94	300164	通源石油	1,182,614.00	2.33
95	000768	中航飞机	1,180,193.00	2.33
96	002557	洽洽食品	1,177,279.00	2.32
97	002384	东山精密	1,174,509.00	2.32
98	300502	新易盛	1,142,185.00	2.25
99	002920	德赛西威	1,140,567.00	2.25
100	600392	盛和资源	1,133,512.00	2.24
101	300324	旋极信息	1,126,865.45	2.22
102	300339	润和软件	1,114,875.00	2.20
103	002293	罗莱生活	1,109,460.00	2.19
104	002373	千方科技	1,104,215.00	2.18
105	600419	天润乳业	1,101,247.60	2.17
106	000063	中兴通讯	1,045,494.00	2.06
107	600185	格力地产	1,044,093.00	2.06
108	002554	惠博普	1,033,713.58	2.04
109	002007	华兰生物	1,027,923.00	2.03

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。

7.3.3 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	293,521,310.98
卖出股票收入(成交)总额	268,455,060.67

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。

7.4 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	2,810,640.00	5.55
	其中:政策性金融债	2,810,640.00	5.55
4	企业债券	4,500,336.40	8.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,838,484.78	17.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,149,461.18	31.86

7.5 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	122145	11桂东02	45,080	4,500,336.40	8.88
2	018005	国开1701	28,000	2,810,640.00	5.55
3	128015	久其转债	23,394	2,189,678.40	4.32
4	113508	新凤转债	20,500	1,999,570.00	3.95
5	123007	道氏转债	9,150	931,470.00	1.84

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	97,494.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,929.39
5	应收申购款	19.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,444.33

7.11.4 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	2,189,678.40	4.32
2	123006	东财转债	908,038.50	1.79
3	128022	众信转债	809,360.00	1.60
4	128027	崇达转债	631,895.00	1.25
5	113503	泰晶转债	378,632.00	0.75
6	123002	国祯转债	338,490.88	0.67

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§7 投资组合报告(转型前)

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	43,170,115.50	36.71
	其中:债券	43,170,115.50	36.71
	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	72,849,247.80	61.95
7	其他资产	1,576,440.44	1.34
8	合计	117,595,803.74	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	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期未进行股票交易。

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

注:本基金本报告期未进行股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期未进行股票交易。

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	14,945,515.00	12.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	27,983,574.50	23.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	241,026.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,170,115.50	36.77

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	019557	17国债03	149,500	14,945,515.00	12.73
2	136256	16南航01	104,290	10,166,189.20	8.66
3	136198	16上药01	81,000	7,926,660.00	6.75
4	122145	11桂东02	55,080	5,527,828.80	4.71
5	122287	13国投01	43,150	4,362,896.50	3.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

报告期内本基金未进行股票投资。

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	398,531.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,177,908.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,576,440.44

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	127004	模塑转债	241,026.00	0.21

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.12.5 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(转型后)

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
1,038	52,829.92	-	-	54,837,458.20	100.00%

8.2 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	32.05	0.0001%

8.3 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

§8 基金份额持有人信息(转型前)

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
1,591	73,799.99	0.00	0.00%	117,415,786.99	100.00%

8.2 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	31.00	0.0000%

8.3 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(转型后)

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	117,415,786.99
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	129,384.57
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	62,707,713.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	54,837,458.20

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。

§9 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	1,261,537,096.13
本报告期期初基金份额总额	759,187,668.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	645,575,703.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	3,803,822.02
本报告期期末基金份额总额	117,415,786.99

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,本基金基金经理变更为刘俊先生。

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,本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

本基金自2018年1月12日转型以来,投资策略变更为:通过灵活的资产配置和策略精选个股,在充分重视本金长期安全的前提下,力争为基金份额持有人创造稳健收益。

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,并将整改报告报送监管部门报告。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(转型后)

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	
招商证券	1	366,665,578.90	65.25%	341,476.53	70.51%	-
华创证券	1	195,310,792.75	34.75%	142,830.21	29.49%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	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
招商证券	19,879,311.56	26.58%	-	-	-	-
华创证券	54,904,955.88	73.42%	58,000,000.00	100.00%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	343,211.88	100.00%	-	-	-	-

中海基金管理有限公司

2018年8月28日