中海中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:宁波银行股份有限公司
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。

基金托管人宁波银行股份有限公司(以下简称"宁波银行")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	中海中鑫混合
基金主代码	002110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月23日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,828,047.14份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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潜力的个股。 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。 (2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。 (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。 个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。 个券选择应遵循如下原则: 相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。 流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。 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。 6、股指期货投资策略 本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货投资。本基金将通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,与现货组合进行匹配,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
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。

2.3 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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	王海燕
	联系电话	021-38429808	0574-89103171
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	wanghaiyan@nbcb.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95574
传真		021-68419525	0574-89103213

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	7,925,176.93
本期利润	-9,122,342.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0762
本期基金份额净值增长率	-10.39%
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	0.0003
期末基金资产净值	73,849,930.70
期末基金份额净值	1.000

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

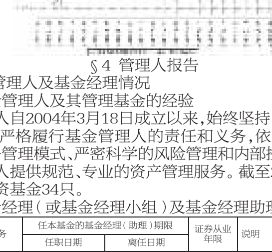
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.48%	1.01%	-3.54%	0.64%	-1.94%	0.37%
过去三个月	-6.10%	0.96%	-3.98%	0.57%	-2.12%	0.39%
过去六个月	-10.39%	0.84%	-4.46%	0.58%	-5.93%	0.26%
过去一年	-6.19%	0.67%	0.18%	0.47%	-6.37%	0.20%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.43%	1.34%	0.57%	-1.34%	-0.14%

注1:"自基金合同生效起至今"指2015年11月23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)。本基金投资股票资产的比例占基金资产的0-95%,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。因此,我们选取市场认同度很高的沪深300指数和中证全债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。在一般均衡配置的状况下,本基金投资于股票资产的比例控制在95%以内,其他资产投资比例不低于5%。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重,选择50%作为基准指数中股票资产所代表的长期平均权重,选择50%作为债券资产所代表的长期平均权重,以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照50%、50%的比例对基础指数进行再平衡,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
许定晴	代理投资总监、投资副总监、本基金基金经理、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金经理	2016年7月29日	2018年4月4日	15年	许定晴女士,苏州大学金融学专业硕士。曾任国联证券股份有限公司研究员。2004年3月进入本公司工作,历任分析师、高级分析师、基金经理助理、研究总监,现任代理投资总监、投资副总监。2010年3月至2012年7月任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2011年12月至2015年4月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理,2015年4月至2016年7月任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年7月至2018年4月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年7月至今任中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年11月至今任中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年11月至今任中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金经理。
王含嫣	本基金基金经理、中海货币市场证券投资基金基金经理、中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理、中海纯债债券型证券投资基金基金经理	2017年7月28日	-	7年	王含嫣女士,澳大利亚新南威尔士大学金融学硕士。历任澳大利亚排富集团信贷分析师、上海大智慧股份有限公司金融工程研究员。2013年11月至2017年3月任中海基金管理有限公司投研中心助理债券研究员、债券分析师、基金经理助理。2016年6月进入本公司工作,曾任投研中心基金经理助理,2017年7月至今任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理,2017年7月至今任中海货币市场证券投资基金基金经理,2017年7月至今任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年9月至今任中海纯债债券型证券投资基金基金经理。
彭海平	本基金基金经理、中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理、中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理、中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海量化策略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	2018年4月4日	-	8年	彭海平先生,中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作,历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理,2015年7月至今任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2016年4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,2016年12月至今任中海量化策略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4月至今任中海中鑫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

2018年上半年,全球经济分化、滞胀压力加大,全球资产波动率显著放大,大宗及原油价格上涨明显,A股市场医药、消费及成长股表现更强。

国内宏观经济疲软包括基建投资大幅下行、房地产投资增速乏力、消费增速连续超预期下滑等。长端利率下行及年内3次定向降准显示较为宽松的货币政策。国内市场在外部不确定性加大及内部防风险的作用下,A股的股债风险溢价抬升。

基本面方面,中报业绩预告披露完毕,创业板中报业绩下滑明显,剔除乐视、温氏,Q1增速24.93%,中报预告业绩中枢的增速为12.37%。Q1、Q2均保持正向增长的有医药、计算机、基础化工、传媒、电力设备和建筑。其中,计算机行业2018H1 盈利累计增速为14.8%,扭转了2017年负增长的局面。半导体的业绩依然保持了非常强劲的增长,15 家披露了中报业绩预告的盈利增速为14.6%,延续了过去几个季度强势增长的势头。

因子方面,低流动性因子独占鳌头,成为上半年表现最好的因子,年化收益率达到15%;其次为动量因子及质量因子,表现最差的是低波动因子。

本基金以配置优质的核心资产为主,并积极参与打新。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日, 本基金净值为1.000元(累计净值1.000元)。报告期内本基金净值增长率为-10.39%,低于业绩比较基准5.93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

2018下半年,我们预计经济整体平稳,但仍存在诸多不确定因素包括国际政治经济博弈、监管政策、金融去杠杆的力度等。随着中美贸易战、央行放水及汇率贬值的预期,我们预计通胀会加速。

2018年初至今,实体经济短周期拐头下行,基本面短期承压,带动利率下行,并且企业盈利开始走弱。18年以来利率收紧的趋势开始松动,流动性边际放宽,下半年市场或仍将持续震荡,风格方面我们更看好小盘成长风格。随着整体估值靠近长期底部及流动性短期改善,关注有业绩支撑的成长股,同时积极布局个股的超跌反弹机会。

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,本托管人在中海中鑫灵活配置混合型券投资基金(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,对本基金管理人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。

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)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:中海中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	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		4,966,763.62	252,500.97
结算备付金		-	114,737.15
存出保证金		100,197.93	51,763.34
交易性金融资产		70,669,755.31	248,751,496.72
其中:股票投资		65,668,255.31	123,835,607.12
基金投资		-	-
债券投资		5,001,500.00	124,915,889.60
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		-	3,003,736.73
应收利息		167,359.64	1,864,716.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		75,904,076.50	254,038,951.79
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		1,077,878.38	3,000,000.00
应付证券清算款		818,220.54	2,493,796.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,500.80	158,390.92
应付托管费		9,500.19	31,678.17
应付销售服务费		9,500.19	31,678.17
应付交易费用		60,475.93	48,686.50
应交税费		509.92	-
应付利息		805.26	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		29,754.59	50,000.00
负债合计		2,054,145.80	5,814,230.10
所有者权益:			
实收基金		73,828,047.14	222,418,688.36
未分配利润		21,883.56	25,806,033.33
所有者权益合计		73,849,930.70	248,224,721.69
负债和所有者权益总计		75,904,076.50	254,038,951.79

注:报告截止日期2018年6月30日,基金份额净值为1.000元,基金份额总额73,828,047.14份。

6.2 利润表

会计主体:中海中鑫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		-7,984,066.61	19,912,902.78
1.利息收入		1,244,495.78	4,192,178.41
其中:存款利息收入		40,042.02	65,375.81
债券利息收入		1,107,081.65	3,917,171.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		97,372.11	209,630.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		7,818,854.53	3,584,925.83
其中:股票投资收益		8,481,780.33	3,302,089.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,547,534.98	-698,167.94
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		884,609.18	981,003.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-17,047,519.54	12,135,794.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		102.62	4.04
减:二、费用		1,138,276.00	2,543,931.47
1. 管理人报酬		503,457.55	1,433,345.08
2. 托管费		100,691.54	286,669.00
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	100,691.54	286,669.00
4. 交易费用		336,134.83	163,965.63
5. 利息支出		47,084.99	176,264.27
其中:卖出回购金融资产支出		47,084.99	176,264.27
6. 其他费用		48,354.59	197,018.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-9,122,342.61	17,368,971.31
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-9,122,342.61	17,368,971.31

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海中鑫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)	222,418,688.36	25,806,033.33	248,224,721.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9,122,342.61	-9,122,342.61
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)	-148,590,641.22	-16,661,807.16	-165,252,448.38
其中:1.基金申购款	38,755.79	3,345.10	42,100.89
2.基金赎回款	-148,629,397.01	-16,665,152.26	-165,294,549.27
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)	73,828,047.14	21,883.56	73,849,930.70

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)	485,911,542.02	6,924,832.14	492,836,374.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	17,368,971.31	17,368,971.31
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)	-263,442,812.65	-9,692,925.62	-273,135,738.27
其中:1.基金申购款	3,617.79	103.80	3,721.59
2.基金赎回款	-263,446,430.44	-9,693,029.42	-273,139,459.86
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)	222,468,729.37	14,600,877.83	237,069,607.20

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

中海中鑫灵活配置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] 2593号《关于准予中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集的实收基金为人民币804,187,583.66元, 有效认购金额产生的利息为人民币22,005.77元。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验字 [2015] 1317号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年11月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为804,209,589.43份基金份额。本基金的基金管理人为中海基金管理有限公司, 基金托管人为宁波银行股份有限公司。

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、股指期货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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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

6.4.7.1 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、基金销售机构、注册登记机构
宁波银行股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
国联证券股份有限公司("国联证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.8.1.2 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

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	503,457.55	1,433,345.08
其中:支付销售机构的客户维护费	764.88	1,015.83

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.75%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.75%/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	100,691.54	286,669.00

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/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。

6.4.8.2.3 销售服务费

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6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
中海基金	100,331.63
宁波银行	0.00
国联证券	0.00
合计	100,331.63
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	286,229.75
宁波银行	0.00
合计	286,229.75

注:本基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/当年天数 (H为基金份额每日应计提的基金销售服务费,E为基金份额前一日的基金份额(参考)净值与基金份额数的乘积)

基金销售服务费每日计算,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

注:本报告期及上年度可比期间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:本报告期末及上年度可比期间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 期末余额	当期利息收入	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
宁波银行	4,966,763.62	37,056.45	4,067,002.73	63,015.74

注:本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管,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	-
603156	养元饮品	2018年2月2日	2019年2月12日	老股配售	78.73	54.86	52,804	2,969,459.41	2,896,827.44	-
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月1日	老股配售	40.29	39.07	12,614	282,352.32	492,828.98	-

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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项停牌	6.44	2018年8月20日	7.25	80,700	601,086.12	519,708.00	-

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

截止本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,077,878.38元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
170410	17农发10	2018年7月5日	100.03	11,000	1,100,330.00
合计				11,000	1,100,330.00

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	65,668,255.31	86.51
	其中:股票	65,668,255.31	86.51
2	固定收益投资	5,001,500.00	6.59
	其中:债券	5,001,500.00	6.59
	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	4,966,763.62	6.54
7	其他各项资产	267,557.57	0.35
8	合计	75,904,076.50	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	2,844,567.00	3.85
C	制造业	21,600,127.72	29.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.10
E	建筑业	3,045,744.60	4.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,184,359.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	839,816.00	1.14
J	金融业	33,964,088.00	45.99
K	房地产业	2,036,767.00	2.76
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	81,226.14	0.11
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	65,668,255.31	88.92

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	601318	中国平安	109,000	6,385,220.00	8.65
2	600519	贵州茅台	7,000	5,120,220.00	6.93
3	600036	招商银行	149,200	3,944,848.00	5.34
4	603156	养元饮品	52,804	2,896,827.44	3.92
5	601166	兴业银行	180,600	2,600,640.00	3.52
6	600887	伊利股份	88,000	2,455,200.00	3.32
7	600276	恒瑞医药	31,800	2,409,168.00	3.26
8	600016	民生银行	342,600	2,398,200.00	3.25
9	601328	交通银行	397,800	2,283,372.00	3.09
10	601288	农业银行	554,200	1,906,448.00	2.58

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	601318	中国平安	7,083,754.00	2.85
2	000069	华侨城A	5,998,032.00	2.42
3	600519	贵州茅台	5,612,072.00	2.26
4	600036	招商银行	4,589,282.59	1.85
5	601166	兴业银行	3,475,748.00	1.40
6	600016	民生银行	3,187,007.00	1.28
7	603156	养元饮品	2,969,459.41	1.20
8	600030	中信证券	2,923,390.00	1.18
9	601288	农业银行	2,859,485.00	1.15
10	601328	交通银行	2,735,479.98	1.10
11	601601	中国太保	2,602,136.00	1.05
12	600276	恒瑞医药	2,569,326.00	1.04
13	600887	伊利股份	2,543,703.66	1.02
14	600000	浦发银行	2,225,746.00	0.90
15	600019	宝钢股份	2,221,424.00	0.89
16	601398	工商银行	2,090,903.00	0.84
17	000513	丽珠集团	1,997,908.32	0.80
18	601668	中国建筑	1,977,694.00	0.80
19	600028	中国石化	1,914,714.00	0.77
20	600104	上汽集团	1,813,612.00	0.73

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	000776	广发证券	13,140,351.28	5.29
2	601318	中国平安	9,030,979.04	3.64
3	000513	丽珠集团	7,089,020.00	2.86
4	000983	西山煤电	6,278,412.00	2.53
5	300316	晶盛机电	5,942,917.00	2.39
6	002020	京新药业	5,609,705.03	2.26
7	000728	国元证券	5,265,965.00	2.12
8	600519	贵州茅台	5,205,831.40	2.10
9	000069	华侨城A	4,960,028.74	2.00
10	002332	仙琚制药	4,582,985.80	1.85
11	000002	万 科A	4,278,469.00	1.72
12	600036	招商银行	3,848,968.00	1.55
13	002555	三七互娱	3,609,582.48	1.45
14	002456	欧菲科技	3,157,717.03	1.27
15	601166	兴业银行	3,006,296.40	1.21
16	600016	民生银行	2,686,408.00	1.08
17	600030	中信证券	2,636,078.00	1.06
18	601288	农业银行	2,479,199.00	1.00
19	601601	中国太保	2,427,197.93	0.98
20	600837	海通证券	2,418,922.00	0.97

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	94,813,441.22
卖出股票收入(成交)总额	142,860,355.87

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	5,001,500.00	6.77
	其中:政策性金融债	5,001,500.00	6.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,001,500.00	6.77

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	170410	17农发10	50,000	5,001,500.00	6.77

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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	100,197.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	167,359.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,557.57

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换债券

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,896,827.44	3.92	老股配售

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
246	300,114.01	73,424,212.60	99.45%	403,834.54	0.55%

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	4,563.99	0.0062%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年11月23日)基金份额总额	804,209,589.43
本报告期期初基金份额总额	222,418,688.36
本报告期基金总申购份额	38,755.79
减:本报告期基金总赎回份额	148,629,397.01
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	73,828,047.14

§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彭海平先生、王含嫣女士。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东方证券	2	233,569,063.17	100.00%	170,809.19	100.00%	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	38,876,037.98	100.00%	50,700,000.00	100.00%	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018-1-1 至 2018-2-28	98,424,212.60	0.00	98,424,212.60	0.00	0.00%
	2	2018-1-1 至 2018-6-30	98,424,212.60	0.00	25,000,000.00	73,424,212.60	99.45%
产品特有风险							

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时,少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有人大 会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后,可能导致基金规模较小,基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时, 基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后, 可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元,进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

中海基金管理有限公司

2018年8月28日