

信息披露 Disclosure

中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.1 重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.2 基金产品概况
基金名称:中海积极增利混合
基金代码:001279
基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.3 主要财务数据和基金净值表现
截至2018年9月30日,本基金资产净值为122,217,668.18元,基金份额净值为1.076,988.00元。

1.4 基金经理简介
基金经理:王宇,毕业于清华大学,曾任中海基金管理有限公司基金经理。

1.5 投资策略
本基金主要投资于具有良好流动性的资产,包括股票、债券、货币市场工具等。

1.6 风险收益特征
本基金属于混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金。

1.7 基金管理人承诺
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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.8 基金托管人承诺
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

1.9 其他应披露事项
本基金在报告期内无重大关联交易,也无重大诉讼、仲裁事项。

1.10 备查文件目录
基金合同、托管协议、招募说明书、基金管理人年度报告、基金托管人年度报告、基金销售服务协议等。

中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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

1.1 重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.2 基金产品概况
基金名称:中海进取收益混合
基金代码:001252
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

1.3 主要财务数据和基金净值表现
截至2018年9月30日,本基金资产净值为122,217,668.18元,基金份额净值为1.076,988.00元。

1.4 基金经理简介
基金经理:王宇,毕业于清华大学,曾任中海基金管理有限公司基金经理。

1.5 投资策略
本基金主要投资于具有良好流动性的资产,包括股票、债券、货币市场工具等。

1.6 风险收益特征
本基金属于混合型证券投资基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金。

1.7 基金管理人承诺
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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.8 基金托管人承诺
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

1.9 其他应披露事项
本基金在报告期内无重大关联交易,也无重大诉讼、仲裁事项。

1.10 备查文件目录
基金合同、托管协议、招募说明书、基金管理人年度报告、基金托管人年度报告、基金销售服务协议等。

中海可转换债券债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.1 重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.2 基金产品概况
基金名称:中海可转换债券基金
基金代码:001003
基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.3 主要财务数据和基金净值表现
截至2018年9月30日,本基金资产净值为122,217,668.18元,基金份额净值为1.076,988.00元。

1.4 基金经理简介
基金经理:王宇,毕业于清华大学,曾任中海基金管理有限公司基金经理。

1.5 投资策略
本基金主要投资于具有良好流动性的资产,包括股票、债券、货币市场工具等。

1.6 风险收益特征
本基金属于债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币市场基金。

1.7 基金管理人承诺
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,也不保证基金份额持有人不受本金损失。

1.8 基金托管人承诺
基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,并按照规定监督基金管理人的投资运作。

1.9 其他应披露事项
本基金在报告期内无重大关联交易,也无重大诉讼、仲裁事项。

1.10 备查文件目录
基金合同、托管协议、招募说明书、基金管理人年度报告、基金托管人年度报告、基金销售服务协议等。

5.3 报告期末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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002456	华信国际	1,107,500	14,945,571.00	8.72
2	002236	大华股份	960,200	13,886,754.00	8.10
3	600588	用友网络	486,500	13,535,811.00	7.90
4	002265	宏华股份	1,473,400	13,260,000.00	7.74
5	002398	天富集团	377,298	11,549,030.56	6.74
6	600048	中润资源	628,400	11,469,720.00	6.71
7	000983	华录集团	303,599	9,959,344.16	5.29
8	600536	中国软件	306,200	8,825,730.00	5.21
9	300523	汇川技术	422,800	6,096,776.00	3.56
10	300451	德业股份	296,100	5,196,555.00	3.03

5.4 报告期末债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	可转债	-	-
6	中期票据	-	-
7	短期融资券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,976,988.00	1.55

5.5 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120007	国开转债	21,489	1,976,988.00	1.55

5.6 报告期末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

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名贵金属投资明细

5.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 报告期末本基金投资的权证交易情况

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120007	国开转债	1,976,988.00	1.55

5.12 报告期末持有的处于转股期且约定在未来一定期间内转股的股票明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002456	华信国际	14,945,571.00	8.72
2	002236	大华股份	13,886,754.00	8.10
3	600588	用友网络	13,535,811.00	7.90
4	002265	宏华股份	13,260,000.00	7.74
5	002398	天富集团	11,549,030.56	6.74
6	600048	中润资源	11,469,720.00	6.71
7	000983	华录集团	9,959,344.16	5.29
8	600536	中国软件	8,825,730.00	5.21
9	300523	汇川技术	6,096,776.00	3.56
10	300451	德业股份	5,196,555.00	3.03

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,813.82
2	应收股利	2,684,168.27
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,008.41
5	其他应收款	14,270.68
6	其他流动资产	4,574.16
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,211,615.35

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120007	国开转债	1,976,988.00	1.55

5.12 报告期末持有的处于转股期且约定在未来一定期间内转股的股票明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002456	华信国际	14,945,571.00	8.72
2	002236	大华股份	13,886,754.00	8.10
3	600588	用友网络	13,535,811.00	7.90
4	002265	宏华股份	13,260,000.00	7.74
5	002398	天富集团	11,549,030.56	6.74
6	600048	中润资源	11,469,720.00	6.71
7	000983	华录集团	9,959,344.16	5.29
8	600536	中国软件	8,825,730.00	5.21
9	300523	汇川技术	6,096,776.00	3.56
10	300451	德业股份	5,196,555.00	3.03

5.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	79,945.22
2	应收股利	2,684,168.27
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,008.41
5	其他应收款	1,712.12
6	其他流动资产	1,008.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,497,277.43