中海添顺定期开放混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

2018年12月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2019年3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。

基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)根据本基金合同规定,于2019年3月20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。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中海添顺定期开放混合
基金主代码	004219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月27日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,151,011.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人取得超越基金业绩比较基准的收益,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金在资产配置方面借鉴投资组合保险技术中的CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)固定比例投资组合保险策略,通过定量与定性相结合的分析方法,在基金资产配置比例限制范围内,根据市场的波动来动态调整固收类资产与权益类资产在投资组合中的比重,以确保投资组合在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现增强组合收益的效果。 2.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。 3.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债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时,本基金将首先对可转换债券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;最后将可转换债券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。 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.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,精选其中具有核心竞争优势的上市公司,结合投研团队的综合判断,构造股票投资组合。其间,本基金也将积极关注当前已经完成定向增发,且还处于锁定期的上市公司,当二级市场股价换破定向增发价时,通过深入研究增发新股的上市公司的基本面,并结合当前股价在技术面的情况,在其二级市场股价达到一定的破发幅度后择机买入,在定向增发股票解禁日逐渐临近或定向增发股票解禁后择机卖出,以实现破发回补的收益。 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。 7.权证投资策略 本基金在中国证监会允许的范围内适度投资权证,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,将权证作为套利和锁定风险的工具,采用包括套利投资策略、风险锁定策略和股票替代策略进行权证投资。 8.中小企业私募债投资策略 本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资略,在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先,确定经济周期所处阶段,研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响,以确定行业总体信用风险的变动情况,并投资具有积极因素的行业,规避具有潜在风险的行业;其次,对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析;最后,结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素,综合评价私募债的信用风险和流动性风险,选择风险与收益相匹配的品种进行配置。 9.开放期投资策略 本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化,因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	王永民
	联系电话	021-38429808	010-66594896
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95566
传真		021-68419525	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金年度报告备置地点	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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年4月27日(基金合同生效日)-2017年12月31日	2016年
本期已实现收益	2,802,548.53	9,941,887.45	-
本期利润	4,360,778.09	8,430,807.05	-
加权平均基金份额本期利润	0.0537	0.0388	-
本期基金份额净值增长率	3.27%	3.88%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0171	0.0388	-
期末基金资产净值	16,542,029.81	225,940,201.65	-
期末基金份额净值	1.0242	1.0388	-

3.2 基金净值表现

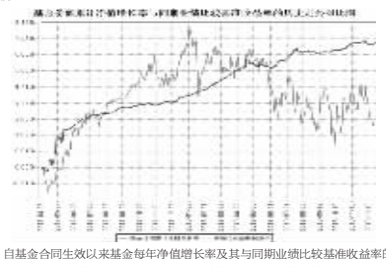
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.50%	0.03%	-1.79%	0.49%	2.29%	-0.46%
过去六个月	1.28%	0.03%	-1.35%	0.44%	2.63%	-0.41%
过去一年	3.27%	0.04%	-2.31%	0.40%	5.58%	-0.36%
自基金合同生效起至今	7.28%	0.07%	2.78%	0.33%	4.50%	-0.26%

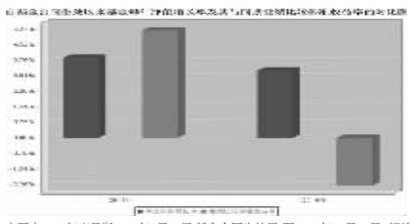
注1:“自基金合同生效起至今”指2017年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

注2:本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%,本基金的投资范围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)、股指期货、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具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的相关规定)。本基金投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的30%,投资于债券等固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的70%。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30%以内,其他资产投资比例控制在70%以内。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30%作为基准指数中股票资产所代表的长期平均权重,选择70%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30%、70%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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:上图中2017年度是指2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日,相关数据未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.4800	767,422.03	7,471.74	774,893.77	注:-
2017	-	-	-	-	注:-
合计	0.4800	767,422.03	7,471.74	774,893.77	注:-

§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12月31日,共管理证券投资基金33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、中海策略精选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	2017年4月27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基金经理,2017年4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。
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、中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理、中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理	2017年4月27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,2018年9月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理。

注1:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注2:证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《中海基金管理有限公司公平交易管理制度》,从投研决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、监察稽核和信息披露等方面对股票、债券、可转债的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动进行全程公平交易管理。

投研决策内部控制方面:(1)公司研究平台共享,基金经理和专户投资经理通过研究平台平等获取研究信息。(2)公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,除投资分管领导及投资总监因业务管理的需要外,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

交易执行内部控制方面:(1)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理根据研究报告独立确定申购价格和数量,在获配额度确定后,根据公司制度规定应遵循公平原则对获配额度进行分配,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配,如有特殊情况,制度规定需书面留痕。(2)投资交易指令统一通过交易室下达,通过启用公平交易模块,力求保证时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡交易原则得以落实。(3)根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数被动投资组合外)的同日反向交易。(4)债券场外交易,交易部在银行间市场上公平公正地进行询价,并由公司对询价收益率偏离、交易对手及交易方式进行事前审核。(5)在特殊情况下,投资组合因合规性或应对大额赎回等原因需要进行特定交易时,由投资组合经理发起暂停投资风控阀值的流程,在获得相关审批后,由公司暂时关闭投资风控系统的特定阀值。完成该交易后,公司立即启动暂停的投资风控阀值。

行为监控和分析评估方面:(1)公司每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。(2)公司对所有组合本报告期内日内、3日、5日同向交易数据进行了采集,并进行两两比对,对于相关采集样本进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验。(3)对于不同时间期间的同组合反向交易及公司制度规定的异常交易,公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时机等进行综合分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司遵循《中海基金管理有限公司公平交易管理制度》相关要求,整体上贯彻执行制度约定,加强了对投资组合公平交易的事后分析,

(1)对于两两组合的同向交易,我们从日内、3日、5日三个时间区间进行假设价差为零,T分布的检验,对于未通过假设检验的情况,公司结合比较两两组合间的交易占优比、采集的样本数量是否达到一定水平从而具有统计学意义、模拟利益输送金额的绝对值、模拟利益输送金额占组合资产平均净值的比例、模拟利益的贡献率占组合收益率的比例、两两组合的持仓相似度及两两组合收益率差的比较等多方面进行综合比较。

(2)对于两两组合的反向交易,公司采集同一组合对同一投资品种3日内反向交易;两两组合对同一投资品种3日内反向交易;并结合市场该投资品种的总成交量进行综合分析。

(3)对于公司制度规定的异常交易,相关组合经理均根据制度要求提交审批单并书面留痕。

综合而言,本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未发现组合存在有可能导致重大不公平交易和利益输送的情况。

4.3.3 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,公司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

年初时市场对全球经济复苏预期较强。经过美联储加息,全球贸易净端不断加剧后,市场经济复苏预期转弱。下半年后,经济走弱迹象逐步明显。高频数据中消费下滑对经济的拖累效应非常明显。物价数据温和,金融数据表现低于预期,金融市场流动性宽裕未能传导到实体经济。

政策层面,全年监管层政策导向逐步变化,更多关注稳增长而不是去杠杆。美联储连续加息后,央行释放流动性以做应对,资产管理新规暂缓实施。政府决策层推出系列政策,对民营经济支持发展。习近平同志在北京人民大会堂主持召开民营企业座谈会并发表重要讲话,提出正确认识当前民营经济发展遇到的困难和问题,要大力支持民营企业发展壮大。习近平同志在首届中国国际进口博览会开幕式的主旨演讲中提出,将在上海证券交易所设立科创板并试点注册制。

中美贸易争端持续升级,国际政治经济博弈环境剧烈波动,全年对金融市场产生影响。股票市场年初时受益于复苏预期,周期股表现较好。但随后经济增长复苏预期回落,医药、消费防御类品种及成长股表现更强。中美贸易冲突随后不断加剧,市场对经济下滑预期不断增强,股票市场整体出现连续调整。债券市场方面,随着货币政策宽松和高频经济数据下滑,基准收益率全年下行趋势明显。

本基金全年操作平稳,债券资产以优质短期信用品种为主要配置方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金份额净值1.0242元(累计净值1.0722元)。报告期内本基金净值增长率为3.27%,高于业绩比较基准5.58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

展望2019年,经济预计短期内难以出现强复苏增长,物价水平将保持温和。中美贸易争端对证券市场的影响预计将长期化。政策方面,将继续关注稳增长的总体政策。宽货币的政策效果能否转化为实体经济中的宽信用,将直接影响大类资产的配置价值。

对于上述因素的变化我们要保持实时跟踪。我们在未来的运作仍将坚持稳健谨慎原则,以固定收益资产为主要配置方向,择机配置部分估值较低的优质上市公司可转债。

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,本基金于2018年05月30日实施了利润分配,实际分配金额分别为774,893.77。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自2018年5月3日至12月31日,本基金曾出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,公司已向中国证券监督管理委员会上报相关后续运作方案。

§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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在中海添顺定期开放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 报告期内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、基金净值收益率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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2019)审字第61372718_B29号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中海添顺定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	我们审计了后附的中海添顺定期开放混合型证券投资基金的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表,所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的中海添顺定期开放混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中海添顺定期开放混合型证券投资基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中海添顺定期开放混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
其他信息	中海添顺定期开放混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,管理层负责评估中海添顺定期开放混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督中海添顺定期开放混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中海添顺定期开放混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中海添顺定期开放混合型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括内通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	徐艳 | 阎育化
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2019年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中海添顺定期开放混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	114,039.10	40,212,991.89
结算备付金		28,248.10	2,501,329.92
存出保证金		1,411.77	82,198.86
交易性金融资产	7.4.7.2	17,315,187.00	242,660,619.40
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		17,315,187.00	242,660,619.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	396,654.56
应收利息	7.4.7.5	414,733.13	4,303,078.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		17,873,619.10	290,156,873.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,200,000.00	64,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,239.86	153,427.88
应付托管费		2,809.96	38,356.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	723.23
应交税费		1,454.52	-
应付利息		1,084.95	-25,836.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	115,000.00	50,000.00
负债合计		1,331,589.29	64,216,671.73
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	16,151,011.22	217,509,394.60
未分配利润	7.4.7.10	391,018.59	8,430,807.05
所有者权益合计		16,542,029.81	225,940,201.65
负债和所有者权益总计		17,873,619.10	290,156,873.38

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0242元,基金份额总额16,151,011.22份。

7.2 利润表

会计主体:中海添顺定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入		6,354,541.84	13,100,173.35
1.利息收入		4,921,454.77	9,073,119.89
其中:存款利息收入	7.4.7.11	681,947.12	3,577,543.93
债券利息收入		4,117,393.44	5,495,575.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		122,114.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-125,149.98	5,538,133.86
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-4,448.00	5,257,302.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-120,701.98	81,752.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	199,079.10
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	1,558,229.56	-1,511,080.40
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	7.49	-
减:二、费用		1,993,763.75	4,669,366.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	702,208.22	1,215,847.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	175,552.08	303,961.70
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	658.68	183,152.92
5. 利息支出		811,485.51	2,635,783.30
其中:卖出回购金融资产支出		811,485.51	2,635,783.30
6. 税金及附加		6,505.45	-
7. 其他费用	7.4.7.20	297,353.81	330,621.38
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		4,360,778.09	8,430,807.05
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		4,360,778.09	8,430,807.05

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中海添顺定期开放混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	217,509,394.60	8,430,807.05	225,940,201.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,360,778.09	4,360,778.09
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)	-201,358,383.38	-11,625,672.78	-212,984,056.16
其中:1.基金申购款	129,918.18	7,158.35	137,076.53
2.基金赎回款	-201,488,301.56	-11,632,831.13	-213,121,132.69
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)	-	-774,893.77	-774,893.77
五、期末所有者权益(基金净值)	16,151,011.22	391,018.59	16,542,029.81
项目	上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年12月31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)	217,509,394.60	-	217,509,394.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,430,807.05	8,430,807.05
五、期末所有者权益(基金净值)	217,509,394.60	8,430,807.05	225,940,201.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海添顺定期开放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[2016]3172号文《关于准予中海添顺定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由中海基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集,募集期结束经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字[2017]第428号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年4月27日正式生效,设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币217,478,567.29元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币30,827.31元,以上实收基金(本息)合计为人民币217,509,394.60元,折合217,509,394.60份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币217,478,567.29元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币30,827.31元,以上实收基金(本息)合计为人民币217,509,394.60元,折合217,509,394.60份基金份额。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围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)、股指期货、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具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的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按