

# 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

## 【2015】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  
报告送出日期：2015年10月24日

**§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法律责任。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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、勤勉尽责的原则履行基金管理人义务，但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

| §2 基金产品概况  |  |
|------------|--|
| 基金名称       | 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金   |
| 基金代码       | 390061   |
| 交易代码       | 390061   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日期   | 2015年12月21日  |
| 报告期末基金份额总额 | 73,238,103,946.01  |
| 投资目标       | 本基金投资于具有良好成长性、业绩优良、估值合理的上市公司股票，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。  |
| 投资策略       | 1、资产配置策略<br>本基金采取自上而下的资产配置方式，在资产配置中，主要考虑宏观经济周期、政策、市场估值、市场情绪、市场流动性等因素，动态调整股票、固定收益类资产、现金类资产在基金资产中的配置比例，以期在控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。<br>2、个股投资策略<br>本基金采取自下而上的个股投资策略，在个股选择上，主要考虑个股的成长性、估值、市场地位、行业地位、财务状况、公司治理、管理层背景等因素，动态调整个股在基金资产中的配置比例，以期在控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。<br>3、固定收益投资策略<br>本基金采取自上而下的固定收益投资策略，在固定收益配置中，主要考虑宏观经济周期、政策、市场估值、市场情绪、市场流动性等因素，动态调整固定收益类资产在基金资产中的配置比例，以期在控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。 |

|                  |  |  |  |  |  |
|------------------|--|--|--|--|--|
| 前10名权益基金         | 沪深300指数涨跌幅+0.0%，中国债券总指数涨幅+0.40%  |  |  |  |  |
| 风险收益特征           | 本基金为混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。<br>本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。 |  |  |  |  |
| 基金管理人            | 中融基金管理有限公司   |  |  |  |  |
| 基金托管人            | 中国工商银行股份有限公司   |  |  |  |  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 |  |  |  |  |  |

| 3.1 主要财务指标      |  | 单位:人民币元                   |    |             |        |               |     |
|-----------------|--|---------------------------|----|-------------|--------|---------------|-----|
| 主要财务指标          |  | 报告期(2015年7月1日至2015年8月30日) |    |             |        |               |     |
| 1.本期已实现收益       |  | -25,009,246.07            | 6  | 000268 太极股份 | 47,850 | 1,584,313,350 | 216 |
| 2.本期利润          |  | -30,063,412.22            | 6  | 000276 恒顺医药 | 33,989 | 1,569,951,951 | 214 |
| 3.加权平均的基金份额本期利润 |  | -0.7986                   | 7  | 000772 东江环保 | 85,294 | 1,521,643,496 | 216 |
| 4.期末基金资产净值      |  | 73,246,889.72             | 8  | 300557 我武生物 | 41,300 | 1,478,953,300 | 202 |
|                 |  |                           | 9  | 600893 中南动力 | 35,500 | 1,450,530,000 | 189 |
|                 |  |                           | 10 | 002714 亿联网络 | 31,100 | 1,383,560,000 | 189 |

| 注 1：上述基金业绩指标不包括持有人认购及交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购费、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。            | 5.4 报告期内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 2：本期 2 项权益类非货币基金本期利息收入、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，本期公允价值变动收益加上本期公允价值变动收益。 | <table> <tr> <th>序号</th> <th>权证名称</th> <th>公允价值（元）</th> <th>占基金资产净值比例（%）</th> </tr> <tr> <td>1</td> <td>中证 1000ETF</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>中证 1000ETF</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>中证 1000ETF</td> <td>16,640,000.00</td> <td>22.72</td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>中证 1000ETF</td> <td>16,640,000.00</td> <td>22.72</td> </tr> <tr> <td>5</td> <td>中证 1000ETF</td> <td>16,640,000.00</td> <td>22.72</td> </tr> </table> | 序号            | 权证名称         | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 1 | 中证 1000ETF | - | - | 2 | 中证 1000ETF | - | - | 3 | 中证 1000ETF | 16,640,000.00 | 22.72 | 4 | 中证 1000ETF | 16,640,000.00 | 22.72 | 5 | 中证 1000ETF | 16,640,000.00 | 22.72 |
| 序号   | 权证名称   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 1  | 中证 1000ETF   | -             | -            |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 2  | 中证 1000ETF   | -             | -            |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 3  | 中证 1000ETF   | 16,640,000.00 | 22.72        |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 4  | 中证 1000ETF   | 16,640,000.00 | 22.72        |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 5  | 中证 1000ETF   | 16,640,000.00 | 22.72        |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 注 3：本基金净值表现  |  |               |              |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |
| 3.2.1 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较   |  |               |              |         |              |   |            |   |   |   |            |   |   |   |            |               |       |   |            |               |       |   |            |               |       |

| 阶段  | 净值增长率①  | 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   | -24.70% | 1.90%     | 16.73%     | 2.01%         | -7.97% | -0.02% |
| 2.2.2 自基金合同生效以来基金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 | 6       | 金业和圆融资管   | -          | -             | -      | -      |
|   | 7       | 中债国债      | -          | -             | -      | -      |
|   | 8       | 可转债       | -          | -             | -      | -      |
|   | 9       | 沪深存单      | -          | -             | -      | -      |
|   | 9       | 其他        | -          | -             | -      | -      |
| 10  | 合计      | -         | -          | 16,640,090.00 | -      | 22.72  |

|  |        |        |         |               |              |
|--|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 4.5 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  | 018001 | 国开1301 | 164,000 | 16,640,050.00 | 22.72        |
| 4.6 报告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                      |        |        |         |               |              |
| 4.7 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                         |        |        |         |               |              |

|                                     |         |
|-------------------------------------|---------|
| §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权证投资明细 |         |
| 序号                                  | 权证代码    |
| 1                                   | 0150001 |
| 2                                   | 0150002 |
| 3                                   | 0150003 |
| 4                                   | 0150004 |
| 5                                   | 0150005 |

| 序号 | 权证代码    | 权证名称      | 数量(元)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 0150001 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 2  | 0150002 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 3  | 0150003 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 4  | 0150004 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 5  | 0150005 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |

|                        |   |
|------------------------|---|
| 本基金基金<br>管理人、中国<br>证监会 | 报告期末，复旦大学世界<br>级顶尖大学，历史通商<br>国际股份有限公司软件、工<br>程、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件、<br>软件、软件、软件、软件 |
|------------------------|---|

| 开文明<br>基金投资部<br>基金投资<br>基金经理   | 2014年7月7日 | 7年          | 理。2012年12月进入本公司，历任投资部副经理、策略研究员、策略研究员兼策略分析师、基金经理助理。2016年7月兼任中债转债策略基金经理。2016年8月兼任中债转债策略基金经理助理。2016年12月兼任中债转债策略基金经理助理。2016年12月兼任中债转债策略基金经理助理。 |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
|--|-----------|-------------|--|----|----|-------|---|-------|-------------|---|---------|--|---|------|--|---|------|-------------|
| 报告期内本基金投资前十名股票中有与基金合同规定投资范围之外的股票。  |           |             |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
| <table><tr><th>序号</th><th>名称</th><th>金额(元)</th></tr><tr><td>1</td><td>存保保证金</td><td>115,762,004</td></tr><tr><td>2</td><td>应收证券清算款</td><td></td></tr><tr><td>3</td><td>应收股利</td><td></td></tr><tr><td>4</td><td>应收利息</td><td>716,637,111</td></tr></table> |           |             |  | 序号 | 名称 | 金额(元) | 1 | 存保保证金 | 115,762,004 | 2 | 应收证券清算款 |  | 3 | 应收股利 |  | 4 | 应收利息 | 716,637,111 |
| 序号   | 名称        | 金额(元)       |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
| 1  | 存保保证金     | 115,762,004 |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
| 2  | 应收证券清算款   |             |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
| 3  | 应收股利      |             |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |
| 4  | 应收利息      | 716,637,111 |  |    |    |       |   |       |             |   |         |  |   |      |  |   |      |             |

|   |        |   |            |
|---|--------|---|------------|
| 注1:上述任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。   | 6      | 应收申购款   | 62,209.01  |
| 注2:本基金业务的投资符合《证券投资基金业人力资源管理办法》的相关规定。  | 6      | 其他应收款   |            |
| 4.2 管理人及受托人等基金运作管理应遵守的法律法规  | 7      | 待摊费用  |            |
| 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,勤勉尽责履行受托人职责,追求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。 | 8      | 其他  |            |
|   | 合计     |   | 883,589.96 |
| 4.3 公平交易说明  | 5.11.4 | 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细:<br>注:本基金本报告期末未有处于转股期的可转债。 |            |
| 4.3.1 公平交易制度的执行情况   |        |   |            |

|   |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|
| <p>根据《证券投资基金法》和公司制度规定并经投资决策委员会和公司相关投资、交易、风险管理等部门分析认为, 投资、持有的一级市场发行的可转债符合公司的整体资产配置策略, 公司认为, 公司通过制定投资策略, 控制仓位, 分散投资, 分散行业, 分散品种, 分散期限, 分散发行主体, 分散到期期限, 分散转股价格, 分散转股期限, 分散转股条件, 分散转股时间, 分散转股</p> |  |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|--|

|  |  |   |   |
|--|--|---|---|
| <p>本基金管理人按照公允价值对基金资产进行了重要分析,并针对公允价值进行了实时跟踪分析。多数情况下公允价值跟踪误差较小,公允价值与基金资产净值较为接近。</p> <p>根据合同,公司根据基金份额持有人对合同不同时间点的反向交易进行了统计分析,对于出价的合同制定规定的异常交易,要求相关当事人和私人顾问公司制度予以干预。</p> <p>4.32 异常交易行为的专项说明</p> <p>本基金报告期内,所有基金投资组合的交易所公开竞价当日反向交易成为较少的单位,交易量不存在超过该基金当日成交量5%的情况,对于一般市场波动,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干预。</p> |  | <p>基金管理人每日公允价值跟踪误差</p> <p>§ 6 开放式基金净值变动</p> | <p>单位:</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动</p> <p>基金份额净值变动&lt;/</p> |
|--|--|---|---|

|  |  |
|--|--|
| 2015年3季度，陆港公布的经济数据表明，宏观经济进一步恶化，财政赤字政策将进一步加码，相对宽松的货币政策短期内难以结束。期间受人民币贬值预期影响，全球市场都出现了一定程度的贬值，部分资金流出中国，中国的外汇占款也出现较大幅度的下降。3季度，基金管理人认为，虽然人民币贬值预期短期内难以结束，人民币贬值预期进一步加剧，人民币 |  |
|--|--|

|  |            |
|--|------------|
| 和公允价值变动损益。   |            |
| 在 2015 年 12 月 31 日，本基金的股票资产持仓比例维持在较低的水平，在行业方面配置主要以环保、交通、医药行业为主。                              |            |
| 4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现情况   |            |
| 截至 2015 年 12 月 30 日，本基金的份额净值 1.000 元(净值单位 1.000 元)，报告期内本基金净值增长率为 -24.70%，低于业绩比较基准 7.99 个百分点。 |            |
| 6.1 报告期内基金投资组合情况   | § 5 投资组合报告 |

| §16 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权证投资明细 |         |           |         |               |              |
|--------------------------------------|---------|-----------|---------|---------------|--------------|
| 序号                                   | 权证代码    | 权证名称      | 数量(元)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
| 1                                    | 0150001 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 2                                    | 0150002 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 3                                    | 0150003 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 4                                    | 0150004 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |
| 5                                    | 0150005 | 中证1000ETF | 164,000 | 16,400,000.00 | 22.72        |

|  |  |                   |
|--|--|-------------------|
| 基金管理人:中海基金管理有限公司<br>基金托管人:招商银行股份有限公司<br>报告送出日期:2015年10月24日   |  | <h1>中海惠利纯债分级</h1> |
| §1 重要提示<br>基金管理人的董事会及经理层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责任。<br>基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。 |  |                   |

|   |          |   |                            |
|---|----------|---|----------------------------|
| 基金管理人将以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金投资者谋求利益，基金管理人承诺以谨慎从业态度履行义务，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资有风险，投资者在作出投资决策前应进行详细阅读本基金的招募说明书。 |          |  |                            |
| 本报告中期财务资料未经审计。  |          |   |                            |
| 本报告自2015年7月1日起至9月30日止。  |          |   |                            |
| <b>§2 基金产品概况</b>  |          |   |                            |
| 基金简称  | 中海康利分级债券 | 主要财务指标  | 报告期末(2015年7月1日~2015年9月30日) |
| 基金代码  | 000016   | 1.本期已实现收益   | 12,779,790.50              |
|   |          | 2.本期净收益   | 16,014,932.00              |

|            |  |   |                |        |
|------------|--|---|----------------|--------|
| 交易代码       | 000016   | 3) 加权平均基金份额本期利润   |                | 0.0003 |
| 基金运作方式     | 契约型、基金合同生效后,第2年为一分派运作周期,按运作周期派发的方式分派,在每个分派运作周期内,基金份额持有人有权选择将应分派现金红利自动归入下一分派运作周期或赎回/申购。 | 4) 期末基金资产净值   | 646,289,280.00 | 0.0034 |
| 基金合同生效日    | 2013年11月21日  | 5) 期末基金份额净值   |                | 1.222  |
| 报告期末基金份额总额 | 5,277,988,356.78份  | 注: 3) 截至2015年6月31日至2015年9月30日,上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及赎回的各项费用(例如,申购、赎回费),计入费用后实际收益水平要低于所列示的收益水平; 4) 本期买入返售金融资产收益占基金总资产比例较小,因此未列示; 5) 本基金公允价值变动收益扣除相关税费后的金额,本期列示为公允价值变动收益,上期计入公允价值变动收益。 |                |        |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。   |   |                |        |

|  |  |                                       |  |
|--|--|---------------------------------------|--|
| 1. 国证食品饮料行业成份股的资产配置  |  | 3.2 基金净值表现                            |  |
| 1.1 投资策略   |  | 3.2.1 本报告期内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 |  |
| 本基金针对宏观经济指标和微观经济数据的分析,判断宏观经济走势和经济运行周期波动趋势,结合证券市场整体走势,积极把握市场机会,谨慎选择个股,确定资产配置的基本方向和投资,同时结合市场供求关系分析,最终确定投资组合资产配置。 |  |                                       |  |
| 1.2 业绩比较基准   |  |                                       |  |
| 本基金投资于国内A股市场主要指数成份股,采用统计数据分析技术,对宏观经济和证券市场走势进行判断,寻找具有长期增值潜力的股票,在子母组合内,将符合上述条件的基金组合中选择收益表现最佳的股票资产。               |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |
|  |  |                                       |  |

|  |  |
|--|--|
| <p>主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。在宏观分析和久期策略期限结构配置的基础上,本基金对不同类型的固定收益品种和信用风险、市场流动性、市场交易活跃度进行分析,同时根据基金基本定位,进行公允价值与市值的交叉验证。</p> <p>2、个券的投资策略(可转换债券除外)</p> <p>个券的选择遵循如下原则:</p> <p>绝对收益原则:选择违约风险低、信用等级高、期限收益利率风险匹配的品种。</p> <p>流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。</p> <p>(3)利率品种的投资策略</p> <p>本基金对国债、央行票据、政策性金融债等利率品种的投资,是在久期配置范围</p> | <p>26</p> <p>13.65%</p> <p>14.41%</p> <p>13.8%</p> |
|--|--|

|      |  |
|------|--|
| 投资策略 | <p>融与流动性风险和信用风险基础上,综合考虑组合的流动性、流动性风险和信用风险,进行合理的资产配置。</p> <p>(2) 应用量化投资策略:中小企业私募债资产组合,通过采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在久期配置策略和期限结构配置策略基础上,对信用品种基本面和估值因素进行风险评估。自下而上投资策略指本基金运用行业和公司基本面对研究价值进行估值,对信用品种进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> <p>(3) 中小企业私募债的投资策略</p> <p>本基金投资于中小企业私募债的投资策略主要基于信用风险和流动性,在此基础上,本基金将中小企业私募债的投资</p> |
|------|--|

| § 4 管理人报告           |      |      |
|---------------------|------|------|
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 |      |      |
| 姓名                  | 职务   | 说明   |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     | 投资范围 | 投资范围 |
|                     |      |      |

|                      |  |     |         |   |     |   |
|----------------------|--|-----|---------|---|-----|---|
| 报告期内本基金投资于权证的投资明细如下： |  | 冯永发 | 2015年6月 | - | 13% | 中国中投证券中证1000ETF基金组合，2014年12月24日中国中投证券中证1000ETF基金组合，2015年12月24日中国中投证券中证 |
|----------------------|--|-----|---------|---|-----|---|

|                  |               |
|------------------|---------------|
| 基金托管人            | 招商银行股份有限公司    |
| 基金管理人            | 中国投融资担保股份有限公司 |
| 基金管理人基金托管人基金服务机构 | 中海基金分服务券A     |
| 中海基金分服务券A        | 0000318       |
| 中海基金分服务券A        | 0000317       |
| 中海基金分服务券A        | 0000316       |
| 中海基金分服务券A        | 0000315       |
| 中海基金分服务券A        | 0000314       |
| 中海基金分服务券A        | 0000313       |
| 中海基金分服务券A        | 0000312       |
| 中海基金分服务券A        | 0000311       |
| 中海基金分服务券A        | 0000310       |
| 中海基金分服务券A        | 0000309       |
| 中海基金分服务券A        | 0000308       |
| 中海基金分服务券A        | 0000307       |
| 中海基金分服务券A        | 0000306       |
| 中海基金分服务券A        | 0000305       |
| 中海基金分服务券A        | 0000304       |
| 中海基金分服务券A        | 0000303       |
| 中海基金分服务券A        | 0000302       |
| 中海基金分服务券A        | 0000301       |
| 中海基金分服务券A        | 0000300       |
| 中海基金分服务券A        | 0000299       |
| 中海基金分服务券A        | 0000298       |
| 中海基金分服务券A        | 0000297       |
| 中海基金分服务券A        | 0000296       |
| 中海基金分服务券A        | 0000295       |
| 中海基金分服务券A        | 0000294       |
| 中海基金分服务券A        | 0000293       |
| 中海基金分服务券A        | 0000292       |
| 中海基金分服务券A        | 0000291       |
| 中海基金分服务券A        | 0000290       |
| 中海基金分服务券A        | 0000289       |
| 中海基金分服务券A        | 0000288       |
| 中海基金分服务券A        | 0000287       |
| 中海基金分服务券A        | 0000286       |
| 中海基金分服务券A        | 0000285       |
| 中海基金分服务券A        | 0000284       |
| 中海基金分服务券A        | 0000283       |
| 中海基金分服务券A        | 0000282       |
| 中海基金分服务券A        | 0000281       |
| 中海基金分服务券A        | 0000280       |
| 中海基金分服务券A        | 0000279       |
| 中海基金分服务券A        | 0000278       |
| 中海基金分服务券A        | 0000277       |
| 中海基金分服务券A        | 0000276       |
| 中海基金分服务券A        | 0000275       |
| 中海基金分服务券A        | 0000274       |
| 中海基金分服务券A        | 0000273       |
| 中海基金分服务券A        | 0000272       |
| 中海基金分服务券A        | 0000271       |
| 中海基金分服务券A        | 0000270       |
| 中海基金分服务券A        | 0000269       |
| 中海基金分服务券A        | 0000268       |
| 中海基金分服务券A        | 0000267       |
| 中海基金分服务券A        | 0000266       |
| 中海基金分服务券A        | 0000265       |
| 中海基金分服务券A        | 0000264       |
| 中海基金分服务券A        | 0000263       |
| 中海基金分服务券A        | 0000262       |
| 中海基金分服务券A        | 0000261       |
| 中海基金分服务券A        | 0000260       |
| 中海基金分服务券A        | 0000259       |
| 中海基金分服务券A        | 0000258       |
| 中海基金分服务券A        | 0000257       |
| 中海基金分服务券A        | 0000256       |
| 中海基金分服务券A        | 0000255       |
| 中海基金分服务券A        | 0000254       |
| 中海基金分服务券A        | 0000253       |
| 中海基金分服务券A        | 0000252       |
| 中海基金分服务券A        | 0000251       |
| 中海基金分服务券A        | 0000250       |
| 中海基金分服务券A        | 0000249       |
| 中海基金分服务券A        | 0000248       |
| 中海基金分服务券A        | 0000247       |
| 中海基金分服务券A        | 0000246       |
| 中海基金分服务券A        | 0000245       |
| 中海基金分服务券A        | 0000244       |
| 中海基金分服务券A        | 0000243       |
| 中海基金分服务券A        | 0000242       |
| 中海基金分服务券A        | 0000241       |
| 中海基金分服务券A        | 0000240       |
| 中海基金分服务券A        | 0000239       |
| 中海基金分服务券A        | 0000238       |
| 中海基金分服务券A        | 0000237       |
| 中海基金分服务券A        | 0000236       |
| 中海基金分服务券A        | 0000235       |
| 中海基金分服务券A        | 0000234       |
| 中海基金分服务券A        | 0000233       |
| 中海基金分服务券A        | 0000232       |
| 中海基金分服务券A        | 0000231       |
| 中海基金分服务券A        | 0000230       |
| 中海基金分服务券A        | 0000229       |
| 中海基金分服务券A        | 0000228       |
| 中海基金分服务券A        | 0000227       |
| 中海基金分服务券A        | 0000226       |
| 中海基金分服务券A        | 0000225       |
| 中海基金分服务券A        | 0000224       |
| 中海基金分服务券A        | 0000223       |
| 中海基金分服务券A        | 0000222       |
| 中海基金分服务券A        | 0000221       |
| 中海基金分服务券A        | 0000220       |
| 中海基金分服务券A        | 0000219       |
| 中海基金分服务券A        | 0000218       |
| 中海基金分服务券A        | 0000217       |
| 中海基金分服务券A        | 0000216       |
| 中海基金分服务券A        | 0000215       |
| 中海基金分服务券A        | 0000214       |
| 中海基金分服务券A        | 0000213       |
| 中海基金分服务券A        | 0000212       |
| 中海基金分服务券A        | 0000211       |
| 中海基金分服务券A        | 0000210       |
| 中海基金分服务券A        | 0000209       |
| 中海基金分服务券A        | 0000208       |
| 中海基金分服务券A        | 0000207       |
| 中海基金分服务券A        | 0000206       |
| 中海基金分服务券A        | 0000205       |
| 中海基金分服务券A        | 0000204       |
| 中海基金分服务券A        | 0000203       |
| 中海基金分服务券A        | 0000202       |
| 中海基金分服务券A        | 0000201       |
| 中海基金分服务券A        | 0000200       |
| 中海基金分服务券A        | 0000199       |
| 中海基金分服务券A        | 0000198       |
| 中海基金分服务券A        | 0000197       |
| 中海基金分服务券A        | 0000196       |
| 中海基金分服务券A        | 0000195       |
| 中海基金分服务券A        | 0000194       |
| 中海基金分服务券A        | 0000193       |
| 中海基金分服务券A        | 0000192       |
| 中海基金分服务券A        | 0000191       |
| 中海基金分服务券A        | 0000190       |
| 中海基金分服务券A        | 0000189       |
| 中海基金分服务券A        | 0000188       |
| 中海基金分服务券A        | 0000187       |
| 中海基金分服务券A        | 0000186       |
| 中海基金分服务券A        | 0000185       |
| 中海基金分服务券A        | 0000184       |
| 中海基金分服务券A        | 0000183       |
| 中海基金分服务券A        | 0000182       |
| 中海基金分服务券A        | 0000181       |
| 中海基金分服务券A        | 0000180       |
| 中海基金分服务券A        | 0000179       |
| 中海基金分服务券A        | 0000178       |
| 中海基金分服务券A        | 0000177       |
| 中海基金分服务券A        | 0000176       |
| 中海基金分服务券A        | 0000175       |
| 中海基金分服务券A        | 0000174       |
| 中海基金分服务券A        | 0000173       |
| 中海基金分服务券A        | 0000172       |
| 中海基金分服务券A        | 0000171       |
| 中海基金分服务券A        | 0000170       |
| 中海基金分服务券A        | 0000169       |
| 中海基金分服务券A        | 0000168       |
| 中海基金分服务券A        | 0000167       |
| 中海基金分服务券A        | 0000166       |
| 中海基金分服务券A        | 0000165       |
| 中海基金分服务券A        | 0000164       |
| 中海基金分服务券A        | 0000163       |
| 中海基金分服务券A        | 0000162       |
| 中海基金分服务券A        | 0000161       |
| 中海基金分服务券A        | 0000160       |
| 中海基金分服务券A        | 0000159       |
| 中海基金分服务券A        | 0000158       |
| 中海基金分服务券A        | 0000157       |
| 中海基金分服务券A        | 0000156       |
| 中海基金分服务券A        | 0000155       |
| 中海基金分服务券A        | 0000154       |
| 中海基金分服务券A        | 0000153       |
| 中海基金分服务券A        | 0000152       |
| 中海基金分服务券A        | 0000151       |
| 中海基金分服务券A        | 0000150       |
| 中海基金分服务券A        | 0000149       |
| 中海基金分服务券A        | 0000148       |
| 中海基金分服务券A        | 0000147       |
| 中海基金分服务券A        | 0000146       |
| 中海基金分服务券A        | 0000145       |
| 中海基金分服务券A        | 0000144       |
| 中海基金分服务券A        | 0000143       |
| 中海基金分服务券A        | 0000142       |
| 中海基金分服务券A        | 0000141       |
| 中海基金分服务券A        | 0000140       |
| 中海基金分服务券A        | 0000139       |
| 中海基金分服务券A        | 0000138       |
| 中海基金分服务券A        | 0000137       |
| 中海基金分服务券A        | 0000136       |
| 中海基金分服务券A        | 0000135       |
| 中海基金分服务券A        | 0000134       |
| 中海基金分服务券A        | 0000133       |
| 中海基金分服务券A        | 0000132       |
| 中海基金分服务券A        | 0000131       |
| 中海基金分服务券A        | 0000130       |
| 中海基金分服务券A        | 0000129       |
| 中海基金分服务券A        | 0000128       |
| 中海基金分服务券A        | 0000127       |
| 中海基金分服务券A        | 0000126       |
| 中海基金分服务券A        | 0000125       |
| 中海基金分服务券A        | 0000124       |
| 中海基金分服务券A        | 0000123       |
| 中海基金分服务券A        | 0000122       |
| 中海基金分服务券A        | 0000121       |
| 中海基金分服务券A        | 0000120       |
| 中海基金分服务券A        | 0000119       |
| 中海基金分服务券A        | 0000118       |
| 中海基金分服务券A        | 0000117       |
| 中海基金分服务券A        | 0000116       |
| 中海基金分服务券A        | 0000115       |
| 中海基金分服务券A        | 0000114       |
| 中海基金分服务券A        | 0000113       |
| 中海基金分服务券A        | 0000112       |
| 中海基金分服务券A        | 0000111       |
| 中海基金分服务券A        | 0000110       |
| 中海基金分服务券A        | 0000109       |
| 中海基金分服务券A        | 0000108       |
| 中海基金分服务券A        | 0000107       |
| 中海基金分服务券A        | 0000106       |
| 中海基金分服务券A        | 0000105       |
| 中海基金分服务券A        | 0000104       |
| 中海基金分服务券A        | 0000103       |
| 中海基金分服务券A        | 0000102       |
| 中海基金分服务券A        | 0000101       |
| 中海基金分服务券A        | 0000100       |
| 中海基金分服务券A        | 0000099       |
| 中海基金分服务券A        | 0000098       |
| 中海基金分服务券A        | 0000097       |
| 中海基金分服务券A        | 0000096       |
| 中海基金分服务券A        | 0000095       |
| 中海基金分服务券A        | 0000094       |
| 中海基金分服务券A        | 0000093       |
| 中海基金分服务券A        | 0000092       |
| 中海基金分服务券A        | 0000091       |
| 中海基金分服务券A        | 0000090       |
| 中海基金分服务券A        | 0000089       |
| 中海基金分服务券A        | 0000088       |
| 中海基金分服务券A        | 0000087       |
| 中海基金分服务券A        | 0000086       |
| 中海基金分服务券A        | 0000085       |
| 中海基金分服务券A        | 0000084       |
| 中海基金分服务券A        | 0000083       |
| 中海基金分服务券A        | 0000082       |
| 中海基金分服务券A        | 0000081       |
| 中海基金分服务券A        | 0000080       |
| 中海基金分服务券A        | 0000079       |
| 中海基金分服务券A        | 0000078       |
| 中海基金分服务券A        | 0000077       |
| 中海基金分服务券A        | 0000076       |
| 中海基金分服务券A        | 0000075       |
| 中海基金分服务券A        | 0000074       |
| 中海基金分服务券A        | 0000073       |
| 中海基金分服务券A        | 0000072       |
| 中海基金分服务券A        | 0000071       |
| 中海基金分服务券A        | 0000070       |
| 中海基金分服务券A        | 0000069       |
| 中海基金分服务券A        | 0000068       |
| 中海基金分服务券A        | 0000067       |
| 中海基金分服务券A        | 0000066       |
| 中海基金分服务券A        | 0000065       |
| 中海基金分服务券A        | 0000064       |
| 中海基金分服务券A        | 0000063       |
| 中海基金分服务券A        | 0000062       |
| 中海基金分服务券A        | 0000061       |
| 中海基金分服务券A        | 0000060       |
| 中海基金分服务券A        | 0000059       |
| 中海基金分服务券A        | 0000058       |
| 中海基金分服务券A        | 0000057       |
| 中海基金分服务券A        | 0000056       |
| 中海基金分服务券A        | 0000055       |
| 中海基金分服务券A        | 0000054       |
| 中海基金分服务券A        | 0000053       |
| 中海基金分服务券A        | 0000052       |
| 中海基金分服务券A        | 0000051       |
| 中海基金分服务券A        | 0000050       |
| 中海基金分服务券A        | 0000049       |
| 中海基金分服务券A        | 0000048       |
| 中海基金分服务券A        | 0000047       |
| 中海基金分服务券A        | 0000046       |
| 中海基金分服务券A        | 0000045       |
| 中海基金分服务券A        | 0000044       |
| 中海基金分服务券A        | 0000043       |
| 中海基金分服务券A        | 0000042       |
| 中海基金分服务券A        | 0000041       |
| 中海基金分服务券A        | 0000040       |
| 中海基金分服务券A        | 0000039       |
| 中海基金分服务券A        | 0000038       |
| 中海基金分服务券A        | 0000037       |
| 中海基金分服务券A        | 0000036       |
| 中海基金分服务券A        | 0000035       |
| 中海基金分服务券A        | 0000034       |
| 中海基金分服务券A        | 0000033       |
| 中海基金分服务券A        | 0000032       |
| 中海基金分服务券A        | 0000031       |
| 中海基金分服务券A        | 0000030       |
| 中海基金分服务券A        | 0000029       |
| 中海基金分服务券A        | 0000028       |
| 中海基金分服务券A        | 0000027       |
| 中海基金分服务券A        | 0000026       |
| 中海基金分服务券A        | 0000025       |
| 中海基金分服务券A        | 0000024       |
| 中海基金分服务券A        | 0000023       |
| 中海基金分服务券A        | 0000022       |
| 中海基金分服务券A        | 0000021       |
| 中海基金分服务券A        | 0000020       |
| 中海基金分服务券A        | 0000019       |
| 中海基金分服务券A        | 0000018       |
| 中海基金分服务券A        | 0000017       |
| 中海基金分服务券A        | 0000016       |
| 中海基金分服务券A        | 0000015       |
| 中海基金分服务券A        | 0000014       |
| 中海基金分服务券A        | 0000013       |
| 中海基金分服务券A        | 0000012       |
| 中海基金分服务券A        | 0000011       |
| 中海基金分服务券A        | 0000010       |
| 中海基金分服务券A        | 0000009       |
| 中海基金分服务券A        | 0000008       |
| 中海基金分服务券A        | 0000007       |
| 中海基金分服务券A        | 0000006       |
| 中海基金分服务券A        | 0000005       |
| 中海基金分服务券A        | 0000004       |
| 中海基金分服务券A        | 0000003       |
| 中海基金分服务券A        | 0000002       |
| 中海基金分服务券A        | 0000001       |
| 中海基金分服务券A        | 0000000       |