

中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

2017年3月31日

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示
基金管理人和基金份额持有人的权益不受损害的前提下,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。
基金管理人的董事会及董事承诺本基金根据基金合同的规定,于2017年4月18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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金管理人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。

报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中海蓝筹混合
基金管理人代码	399031
交易代码	399031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月31日
报告期末基金份额总额	143,369,4023份

通过投资股票、债券及货币市场工具等资产,追求资产的长期稳定增值。

本基金的投资策略,优先考虑于行业景气度较高的行业,并结合对宏观经济形势的判断,选择具有较好成长性的行业或板块,通过配置行业或板块内具代表性的优质个股,从而获取长期稳定的收益。

本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。

报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 3 基金产品概况

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -2,640,984.52

2.本期利润 6,228,904.46

3.期末可供基金份额总额 99,737,270.01

4.期末基金份额净值 0.9967

注:1.本期利润为2017年1月1日至2017年3月31日,上述基金份额持有人不包括基金份额持有人认购或交易基金的现金费用(例如,申购、赎回、费率等),计入费用后实际收益水平要低于总份额净值。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.基金净值是指基金份额净值增长率。

3.21 本报告期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 净值增长(%) 净值增长标准差 (%) 标准差 (%) 标准差系数(%)

过去三个月 0.30% 0.07% 0.28% 0.32%

3.22 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

图示: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

注:1.上图所示日期为基金合同生效日,即2009年12月31日。

2.本基金的净值增长率=净值增长率-同期业绩比较基准收益率。

3.本基金的净值增长率是经托管人复核后计算得出的。

4.3 管理人报告

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.2 公司异常交易行为的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.3 公司公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.4 公司异常交易行为的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.5 公司公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.6 公司异常交易行为的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.7 公司公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.8 公司异常交易行为的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.9 公司公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.10 公司异常交易行为的专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、综合平衡等得以贯彻,根据公司制度,通过系统禁止公司组合之间(除指数组合外)的频繁交易。

对于场外交易,风控部门严格执行公平交易规定,对场外交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易进行事前审核,风控部门对场外关联交易可能存在的非公平交易行为。

本报告期内,公司对不同时间阶段的关联交易进行了溢价率样本的采集,进行了相关的假设检验,对于相对溢价率的统计分析,并对关联交易占优次度进行了重要性分析,并针对交易占优次度进行了时间序列分析。

多维的公平交易监控制度使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期内,公司根据制度要求,对不同时间阶段的关联交易进行了统计分析,对可能出现的公司制度中的异常交易,均要求相关当事人和审批人按照公司制度予以保留。

4.3.11 公司公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度,公司从研究、投资、交易、风险管理等方面等环节,对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易和投资管理活动的公平公正性进行了明确规定。

公司通过定期研究、交易等部门的协调配合,要求各部门各组合研究共享成果,投资交易统一纳入交易室,由交易室通过公平交易模块并具体执行关联交易,使公平交易制度中的定价优先、价格优先、比例分配、