

中海分红增利混合型证券投资基金

[2017]第一季度报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:中海银行股份有限公司

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责任。
基金托管人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。

基金管理人的董事及高级管理人员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。

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。

本报告期财务数据未经审计。

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

回顾整个一季度，本基金一直坚持落基+成长+主题的投资策略，在配置了能够保持持续增长的蓝筹+成长的前提下，积极参与一些有持续性的主题性投资机会。

一季度操作上会基本延续我们一贯的操作风格，并增加一些跟国家经济转型相关的板块配置。比如增加对改革、电子、一带一路、新能源等板块配置。

4.5 报告期内基金业绩表现
截至2017年3月31日，本基金份额净值0.6513元(累计净值2.0513元)。报告期内本基金净值增长率为3.39%，高于同期基准涨幅3.58%个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权证投资	420,000,333.04	91.56
其中:股票		420,000,333.04	91.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
货币市场基金	-	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,161,764.79	7.71
8	其他资产	3,469,362.72	0.74
9	合计	407,630,277.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	339,081,372.07	72.00	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,794,817.57	15.46	
E 建筑业	18,079,186.26	3.09	
F 批发和零售业	91,303.17	0.02	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H 餐饮业和住宿业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	
J 金融业	-	-	
K 房地产业	-	-	
L 租赁和商务服务业	-	-	
M 科学研究、技术服务业	16,900.36	0.00	
N 水、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.01	
O 国际贸易、代理和商务服务业	-	-	
P 教育	-	-	
Q 卫生和社会工作	-	-	
R 文化、体育和娱乐业	-	-	
S 综合	-	-	
95	合计	420,000,333.04	100.00

5.3 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股票投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22
2	000606	宝钢股份	2,052,430.00	0.17
3	000699	中航飞机	1,320,067.00	0.11
4	002098	航天机电	1,406,144.00	0.11
5	300010	华仁药业	293,000.00	0.02
6	300433	蓝思科技	592,516.00	0.02
7	000417	合肥百货	2,041,275.00	0.02
8	002666	欧菲光	451,900.00	0.01
9	002723	光启技术	742,401.00	0.01
10	000693	中航资本	603,260.00	0.01

5.4 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债券投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000306	国债	46,822,430.00	3.82
2	000606	宝钢股份	36,660,205.04	3.03
3	000699	中航飞机	32,520,943.00	2.70
4	002098	航天机电	26,059,302.00	2.20
5	300010	华仁药业	19,726,340.00	1.65
6	000433	蓝思科技	18,202,091.52	1.52
7	000417	合肥百货	17,947,202.50	1.46
8	002666	欧菲光	17,108,304.00	1.38
9	002723	光启技术	16,892,027.00	1.36
10	000693	中航资本	16,266,440.00	1.36

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22

5.6 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权证投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22

5.9 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基金投资明细

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000306	国债	46,822,430.00	3.82

5.10 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股票投资组合情况

序号 证券代码 证券简称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

序号	证券代码	证券简称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002030	国电南瑞	2,710,261.00	0.22
2	000606	宝钢股份	36,660,205.04	0.30
3	000699	中航飞机	32,520,943.00	0.27
4	002098	航天机电	26,059,302.00	0.22
5	300010	华仁药业	19,726,340.00	0.17
6	000433	蓝思科技	18,202,091.52	0.15
7	000417	合肥百货	17,947,202.50	0.15
8	002666	欧菲光	17,108,304.00	0.14
9	002723	光启技术	16,892,027.00	0.14
10	000693	中航资本	16,266,440.00	