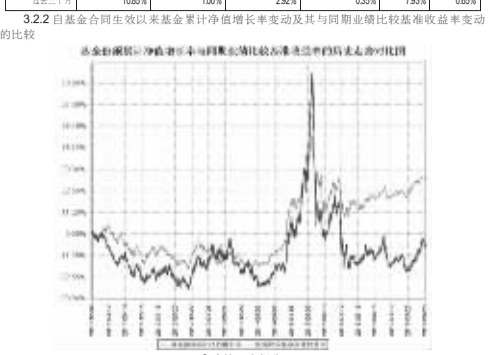


中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

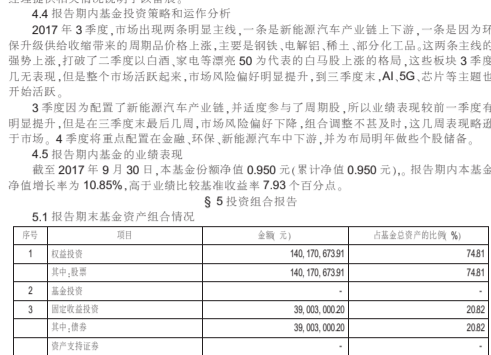
4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

4.3.2 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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

4.3.2 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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

5.103 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets, including cash, derivatives, and bank deposits.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四内五人的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6 开放式基金份额变动

Table showing the change in open-ended fund shares from the beginning to the end of the reporting period.

6.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

6.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

6.3 披露方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

6.4 咨询网站

咨询电话：(021)38789788 400-888-9788

6.5 公司网址

http://www.zhlfund.com

6.6 基金托管人

中国工商银行股份有限公司

6.7 基金销售机构

基金管理人直销及基金销售机构

6.8 备查文件目录

1. 中国证监会核准募集中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金的文件

2. 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3. 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4. 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

5. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6. 基金合同

7. 基金招募说明书

8. 基金托管协议

9. 基金销售协议

10. 基金投资政策

11. 基金定期报告

12. 基金临时报告

13. 基金合同

14. 基金托管协议

15. 基金销售协议

16. 基金投资政策

17. 基金定期报告

18. 基金临时报告

19. 基金合同

20. 基金托管协议

21. 基金销售协议

22. 基金投资政策

23. 基金定期报告

24. 基金临时报告

25. 基金合同

26. 基金托管协议

27. 基金销售协议

28. 基金投资政策

29. 基金定期报告

30. 基金临时报告

31. 基金合同

32. 基金托管协议

33. 基金销售协议

34. 基金投资政策

35. 基金定期报告

36. 基金临时报告

37. 基金合同

38. 基金托管协议

39. 基金销售协议

40. 基金投资政策

41. 基金定期报告

42. 基金临时报告

43. 基金合同

44. 基金托管协议

45. 基金销售协议

46. 基金投资政策

47. 基金定期报告

48. 基金临时报告

49. 基金合同

50. 基金托管协议

51. 基金销售协议

52. 基金投资政策

53. 基金定期报告

54. 基金临时报告

55. 基金合同

56. 基金托管协议

57. 基金销售协议

58. 基金投资政策

59. 基金定期报告

60. 基金临时报告

61. 基金合同

62. 基金托管协议

63. 基金销售协议

64. 基金投资政策

65. 基金定期报告

66. 基金临时报告

67. 基金合同

68. 基金托管协议

69. 基金销售协议

70. 基金投资政策

71. 基金定期报告

72. 基金临时报告

73. 基金合同

74. 基金托管协议

75. 基金销售协议

76. 基金投资政策

77. 基金定期报告

78. 基金临时报告

79. 基金合同

80. 基金托管协议

81. 基金销售协议

82. 基金投资政策

83. 基金定期报告

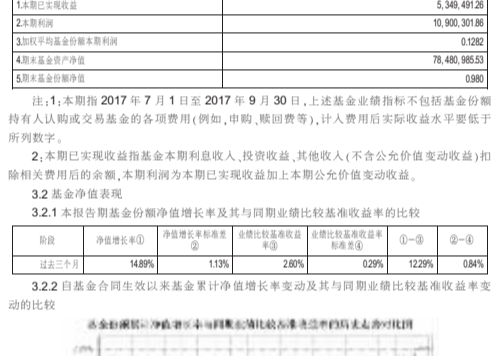
84. 基金临时报告

85. 基金合同

中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

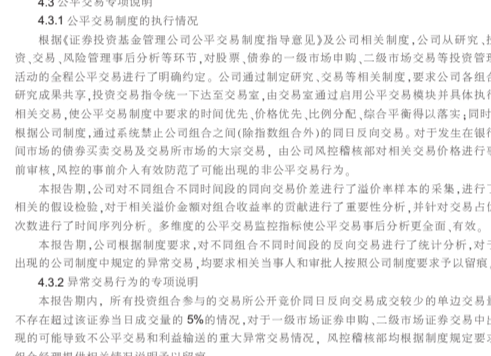
4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

4.3.2 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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description of the fund manager(s).

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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

4.3.2 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。

4.3.3 公平交易专项说明

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、风险控制等环节入手，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的公平交易情况进行了明确约定。

5.103 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

Table showing the composition of other assets, including cash, derivatives, and bank deposits.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四内五人的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6 开放式基金份额变动

Table showing the change in open-ended fund shares from the beginning to the end of the reporting period.

6.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

6.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

6.3 披露方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

6.4 咨询网站

咨询电话：(021)38789788 400-888-9788

6.5 公司网址

http://www.zhlfund.com

6.6 基金托管人

中国工商银行股份有限公司

6.7 基金销售机构

基金管理人直销及基金销售机构

1. 中国证监会核准募集中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金的文件

2. 中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3. 中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4. 中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注

5. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6. 基金合同

7. 基金招募说明书

8. 基金托管协议

9. 基金销售协议

10. 基金投资政策

11. 基金定期报告

12. 基金临时报告

13. 基金合同

14. 基金托管协议

15. 基金销售协议

16. 基金投资政策

17. 基金定期报告

18. 基金临时报告

19. 基金合同

20. 基金托管协议

21. 基金销售协议

22. 基金投资政策