

中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 21 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	中海保本混合
基金主代码	393001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 20 日
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
报告期末基金份额总额	66,518,071.71 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	中海优势精选混合
基金主代码	393001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日
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
报告期末基金份额总额	38,409,612.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	通过采用保本投资策略，在保证本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金以 CPPI 策略为基础，动态调整安全资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产的保值；在此基础上通过严谨的量化分析和实地调研，精选优质股票和债券进行投资布局，以实现基金资产的增值。</p> <p>（1）大类资产配置策略</p> <p>本基金以 CPPI 策略为依据，通过设置安全垫，对安全资产与风险资产的投资比例进行动态调整，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，确保到期保本。</p> <p>（2）单项资产投资策略</p>

	<p>1) 债券投资策略（可转债除外） 为了有效实现基金资产的保本目标，本基金将实施积极的债券投资策略，主要运用利率预期策略、收益率曲线策略、利差策略、套利策略等多种策略获取稳健收益，以实现基金资产到期保本。</p> <p>2) 可转换债券投资策略 在进行可转债筛选时，本基金将首先对可转债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；然后对可转债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；最后将可转债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。</p> <p>3) 二级市场股票投资策略 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，选择其中具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。</p> <p>4) 新股申购策略 本基金将充分依靠公司研究平台和股票估值体系、深入研究首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。</p> <p>5) 权证投资策略 本基金在严格控制风险的前提下，不主动进行权证投资，只在进行可分离债券投资时，被动参与权证投资。</p>
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险收益品种。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要投资具有估值优势、成长优势和财务优势的股票和较高投资价值的债券，通过构建股票与债券的动态均衡组合，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> 本基金将深入分析宏观经济、政策层面、市场估值及市场情绪四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，优化大类资产配置，即增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的

资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。

2、二级市场股票投资策略

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，选择其中具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。

(1) 定量分析

本基金通过综合考察上市公司的财务优势、成长优势和估值优势来进行个股的筛选。

本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、销售毛利率、利息保障比率。

本基金考察的成长指标主要包括：总资产增长率、预测主营收入增长率、预测净利润增长率。

本基金考察的估值指标主要包括：企业价值/息税折旧摊销前利润、市盈率、市净率。

本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分，按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票。

(2) 定性分析

本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的核心竞争优势，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。

本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括：公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。

3、新股申购策略

本基金将充分依靠公司研究平台和股票估值体系，深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

4、债券投资策略

本基金将实施积极的债券投资策略，主要运用利率预期策略、收益率曲线策略、利差策略、套利策略等多种策略获取稳健收益，以实现基金资产稳健增值。

久期配置策略：通过分析宏观经济的周期变化，预判利率变动的方向和趋势，从而确定债券组合的久期，以有效回避利率风险。

期限结构配置策略：在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

	利差策略：在确定债券组合的期限结构后，本基金将通过对不同类别债券的收益率差进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，预测其变动趋势，同时兼顾基本面分析，评价债券发行人的信用风险和信用级别，及时发现由于利差变动出现的价值被低估的债券品种，综合评判个券的投资价值，建立具体的个券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中国债券总指数×45%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，在证券投资基金中属于中等风险收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	蒋松云
	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798

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	2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日		2014 年	2013 年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	45,306,226.71	-1,079,531.61	17,920,396.47	21,034,849.29
本期利润	49,613,220.32	-5,154,660.18	25,336,601.70	13,992,580.73
加权平均基金份	0.3100	-0.0947	0.1168	0.0423

额本期利润				
本期基金份额净值增长率	25.49%	-3.36%	12.25%	3.43%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2542	0.3507	0.0326	0.0524
期末基金资产净值	93,020,958.19	51,879,656.36	197,433,836.79	278,657,116.88
期末基金份额净值	1.398	1.351	1.114	1.042

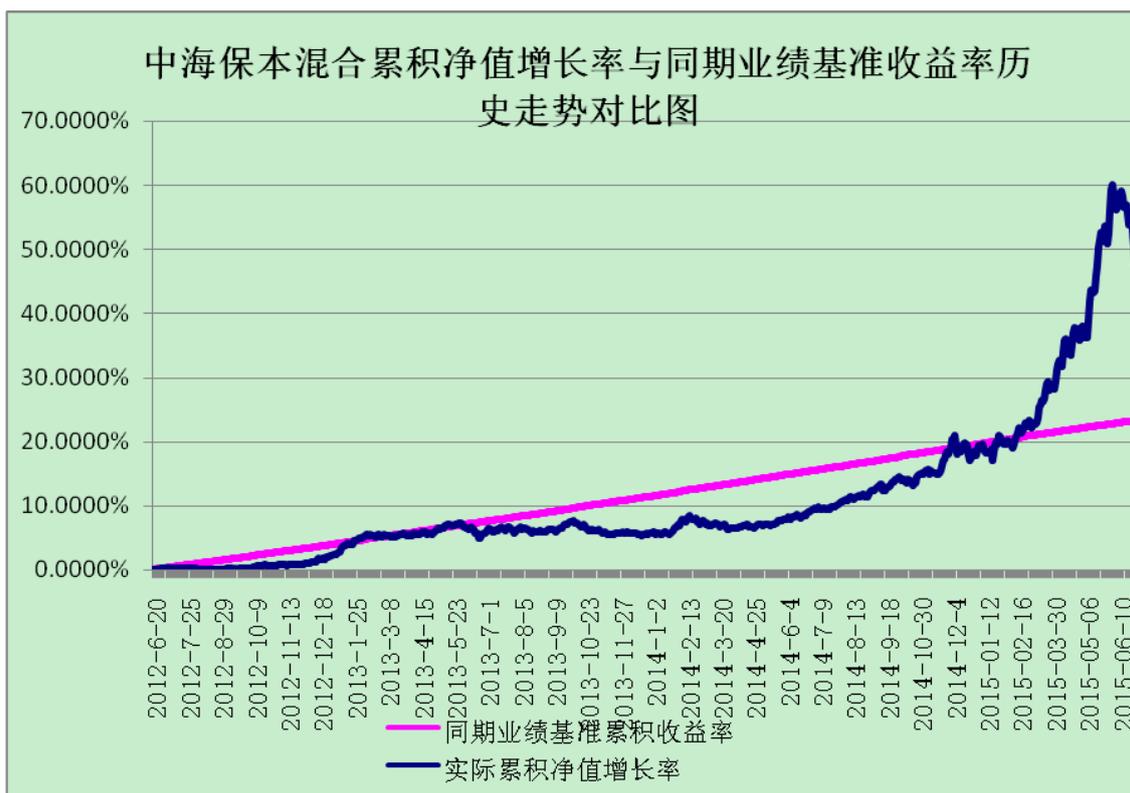
3.2 基金净值表现（转型前）

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

转型前						
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	16.21%	1.08%	1.52%	0.01%	14.69%	1.07%
过去六个月	25.49%	0.87%	3.13%	0.01%	22.36%	0.86%
过去一年	36.52%	0.68%	6.87%	0.01%	29.65%	0.67%
过去三年	48.76%	0.42%	23.12%	0.01%	25.64%	0.41%
自基金合同生效起至今	48.91%	0.41%	23.40%	0.01%	25.51%	0.40%

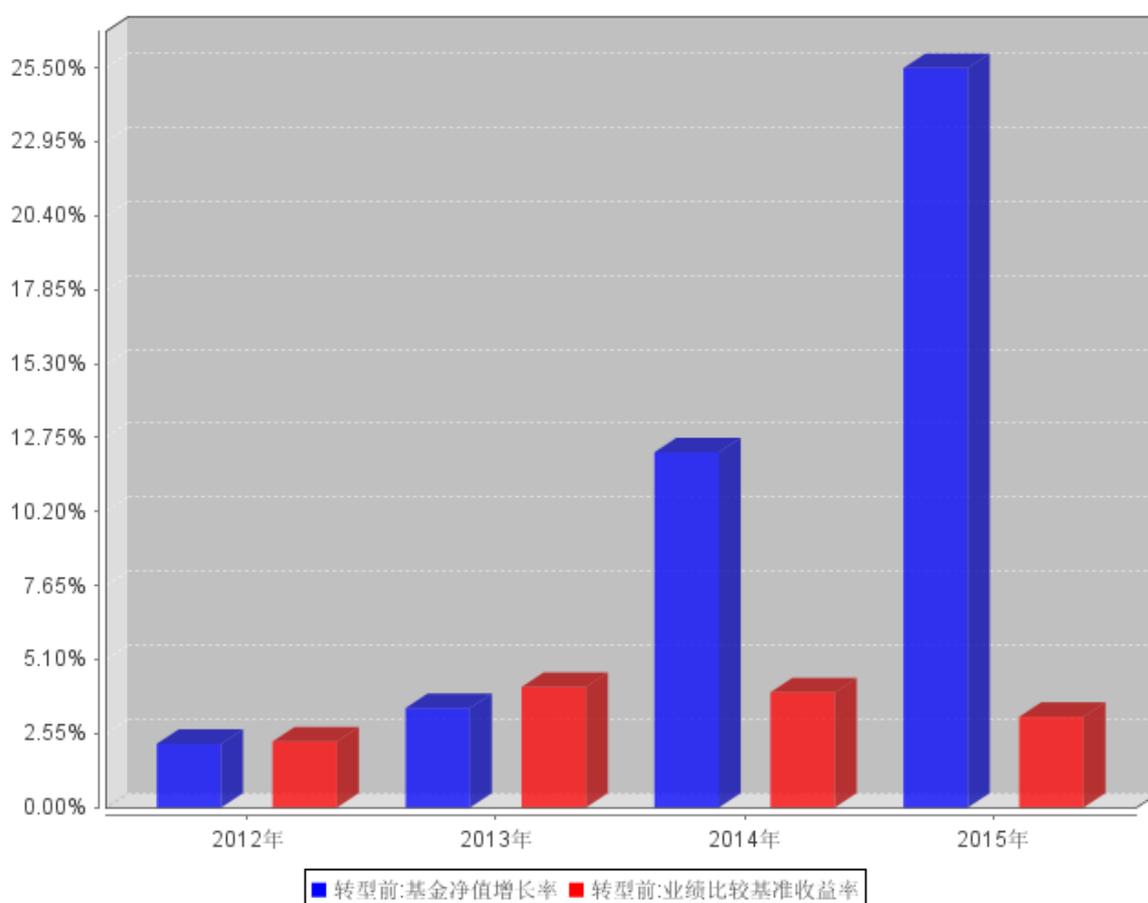
注：1，“自基金合同生效起至今”指 2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日。

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 过去五年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

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对比图



注：上图中 2015 年度是指 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日，相关数据未按自然年度进行折算。

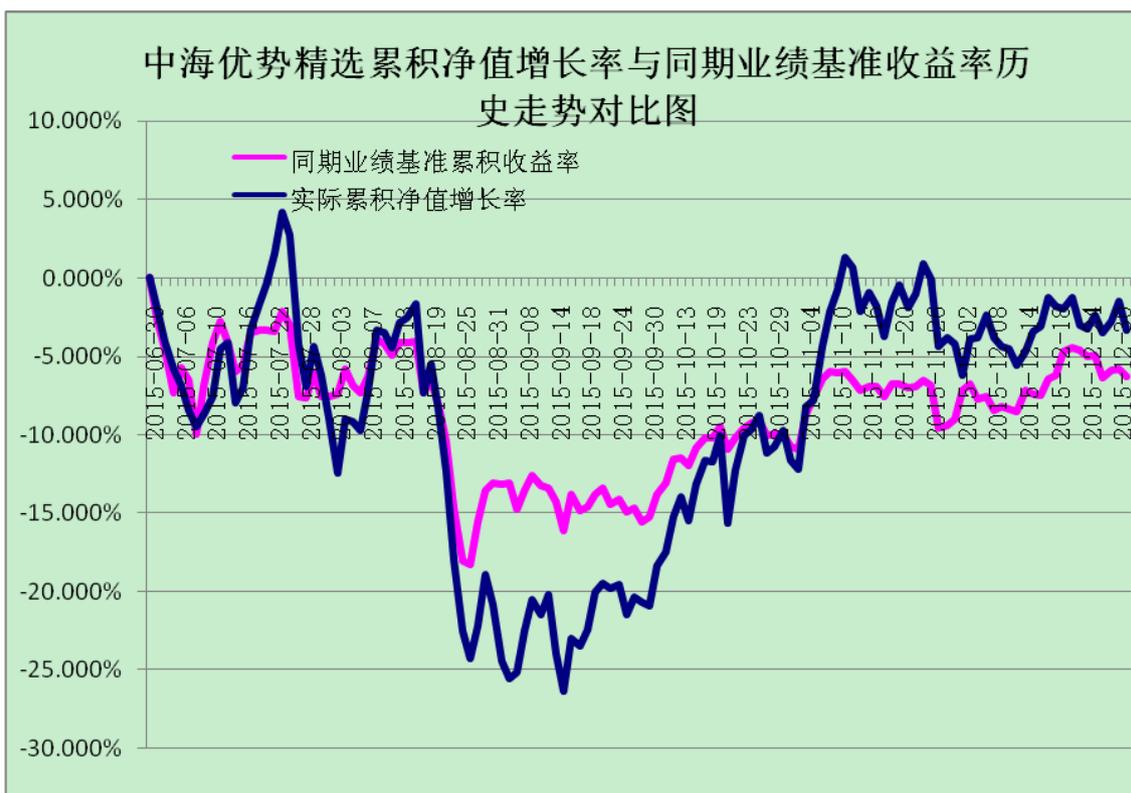
3.2 基金净值表现（转型后）

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

转型后						
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	22.15%	1.97%	10.50%	0.91%	11.65%	1.06%
过去六个月	-3.36%	2.46%	-6.32%	1.47%	2.96%	0.99%
自基金合同生效起至今	-3.36%	2.45%	-6.32%	1.47%	2.96%	0.98%

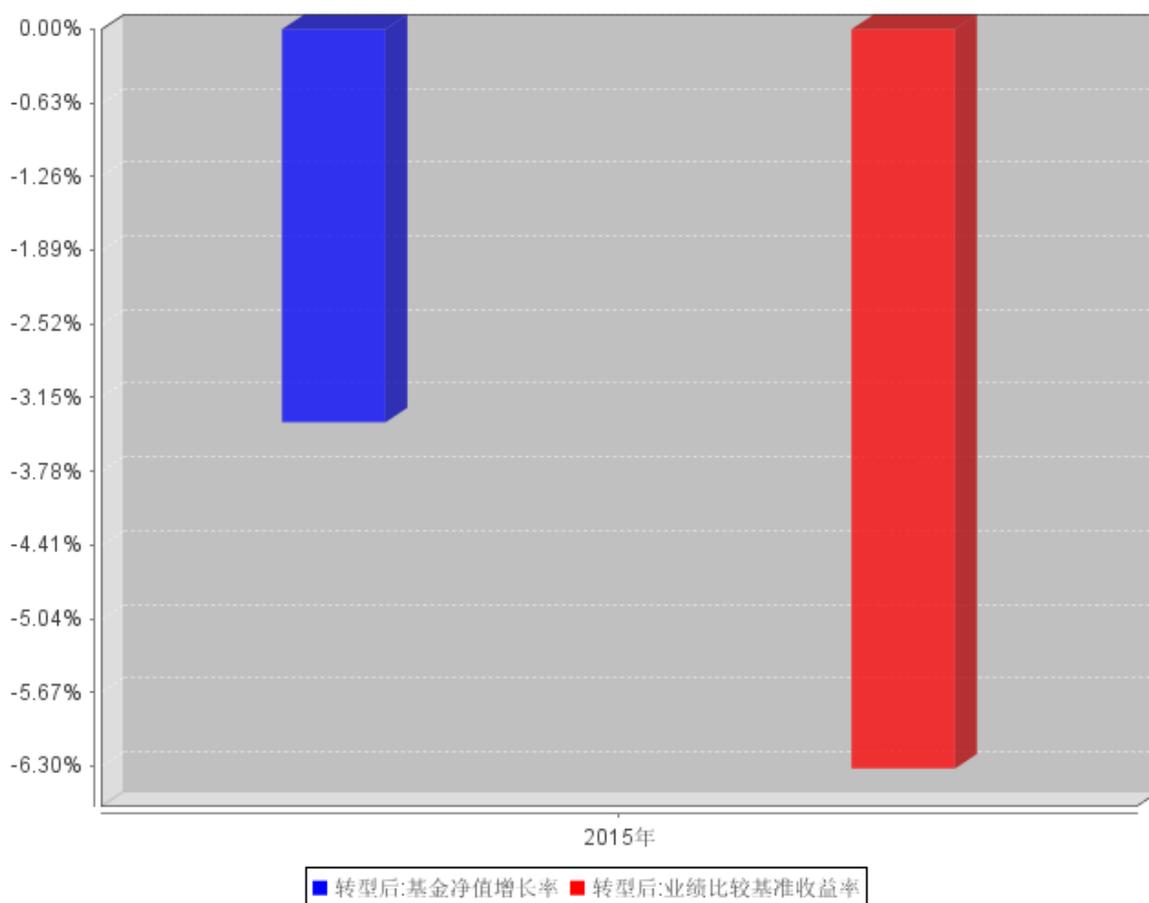
注：1，“自基金合同生效起至今”指 2015 年 7 月 1 日（基金转型生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

3.2.2 自基金转型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 自基金转型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

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上图中 2015 年度是指 2015 年 7 月 1 日(基金转型生效日)至 2015 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

转型前

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
2015	-	-	-	-	
2014	0.5000	11,485,555.25	-	11,485,555.25	
2013	0.1500	5,614,175.12	-	5,614,175.12	
合计	0.6500	17,099,730.37	-	17,099,730.37	

转型后

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
合计	-	-	-	-	

注：本基金在转型期后未发生利润分配。

§ 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 2015 年 12 月 31 日，共管理证券投资基金 30 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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、中海安鑫保本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、中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金基金经理、中海顺鑫保本混合型证券投资基金基金经理	2012 年 6 月 20 日	-	12 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

					<p>8 月任中海稳健收益债券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 月至今任中海安鑫保本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 4 月至今任中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金基金经理，2015 年 12 月至今任中海顺鑫保本混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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、中海安鑫保本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、中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金基金经理、中海顺鑫保本混合型证券投资基金基金经理	2012 年 6 月 20 日	-	12 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，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 任中海安 鑫保本混 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 4 月至今 任中海安 鑫宝 1 号 保本混合 型证券投 资基金基 金经理， 2015 年 12 月至今 任中海顺 鑫保本混 合型证券 投资基金 基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 2011 年修订了《中海基金公平交易管理办法》，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，除分管投资副总监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，并由风控稽核部对询价收益率偏离、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阈值的流程，在获得相关审批后，由风控稽核部暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后，风控稽核部立即启动暂停的投资风控阈值。

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）公司对所有组合在 2015 年全年日内，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

2015 年全年，公司遵循《中海基金公平交易管理办法》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，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

2015 年全年宏观经济表现较疲弱。全年 GDP 增长仅为 6.9%。季度和月度的高频经济数据标如工业增加值、固定资产投资等数据都非常低迷，物价数据持续处于较低区间。

经济低迷背景下，全年政府财政政策和货币政策均有所动作，以推动经济增长。

稳增长政策在多方面发力。上半年时地产行业政策出现重大调整：二套房的首付比例从六成降至四成，同时二手房的营业税从之前满 5 年免征调整为满 2 年免征。国家发改委发布《对发改办财金[2015]1327 号文件的补充说明》，正式放开城投债借新还旧。下半年时国务院发布国发（2015）51 号文《国务院关于调整和完善固定资产投资项目资本金制度的通知》，通知下调部分行业固定资产投资项目的资本金比例 5%-10%。城市地下综合管廊、城市停车场项目，以及经国务院批准的核电站等重大建设项目，可以在规定最低资本金比例基础上适当降低。新兴产业方面，两会期间李克强总理在政府工作报告中提出“互联网+”行动计划，推动移动互联网、云计算、大数据、物联网等新一代互联网技术与各行各业结合，促进电子商务、工业互联网和互联

网金融等新兴业态发展。

货币政策方面，央行全年连续下调存贷款基准利率和各类金融机构人民币存款准备金率。同时央行还通过降低逆回购利率等多种方式向市场注入流动性，降低社会融资成本，推动经济复苏。

除了传统的财政和货币政策外，政府决策层也提出了进行供给侧改革的理念。习近平总书记在中央财经领导小组会议上强调，在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革。李克强总理在主持召开“十三五”《规划纲要》编制工作会议时再次强调，要在供给侧和需求侧两端发力促进产业迈向中高端。年底的中央经济工作会议提出明年经济社会发展特别是结构性改革任务十分繁重，战略上要坚持稳中求进、把握好节奏和力度，战术上要抓住关键点，主要是抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务。一是积极稳妥化解产能过剩；二是帮助企业降低成本；三是化解房地产库存；四是扩大有效供给；五是防范化解金融风险。

债券市场方面，经济数据下滑及资金宽松全年推动长期利率债收益率下行，但是影响逐渐变弱。权益市场方面，对于改革和转型的预期推动创业板为代表的中小市值成长股在上半年上涨明显。但是临近半年末时，涨幅过多后的调整要求叠加大量投资者去杠杆的需求使得市场短期内出现急剧下跌。三季度后权益市场出现反弹，但是年底时美联储加息预期和人民币贬值预期对于境内人民币资产价格产生负面压力。

上半年内整体操作平稳，债券资产仓位逐步降低，权益资产仓位特别是中小市值成长性品种仓位在一季度时有所上升，净值稳定增长。上半年末时临近保本周期终结，组合内各项资产均有所减持。经过三季度的过渡期后，本基金转换为混合型基金进行运作，权益资产仓位有所提升，债券资产保持较低仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.351 元（累计净值 1.416 元）。报告期内本基金净值增长率为-3.36%，高于业绩比较基准 2.96 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 2016 年，经济预计继续在底部徘徊，短期难以出现强势回升。物价水平将保持低位。政策方面，将继续关注财政政策稳增长的效果和货币政策宽松的节奏和力度。经济结构调整与转型仍然是社会关注的主题，因此供给侧改革推进的力度和效果将非常重要。海外经济体特别是美国的复苏速度对全球经济格局会产生重要影响。美联储和欧元区货币政策措施会对全球资本市

场产生明显影响。

结合政府宏观政策导向和实体经济状况分析，2016 年债券市场仍有投资机会，经济数据低迷将推动债市收益率维持低位。权益市场方面，经济复苏的强度与政府政策导向的变化将继续影响市场整体走势和风格变化。

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，根据宏观经济走势适时调整大类资产配置比例和个券个股的组合。

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，本基金本报告期内未发生利润分配。

§ 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，本基金托管人在对中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份

额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本报告期内，中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

§ 6 审计报告(转型前)

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	普华永道中天审字(2016)第 20736 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	中海保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人；
引言段	我们审计了后附的中海保本混合型证券投资基金(以下简称

	<p>“中海保本混合基金”)的财务报表,包括 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p>	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是中海保本混合基金 的基金管理人中海基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)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。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	<p>我们认为,上述中海保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中海保本混合基金 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	薛 竞	赵 钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日	

§ 6 审计报告(转型后)

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	普华永道中天审字(2016)第 20751 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	中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中海优势精选基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中海优势精选基金的基金管理人中海基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 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。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 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。

审计意见段	我们认为，上述中海优势精选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中海优势精选基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛 竞	赵 钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：中海保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		82,436,856.68	19,222,844.47
结算备付金		665,840.67	760,268.51
存出保证金		131,669.66	109,710.79
交易性金融资产		17,852,545.77	186,208,250.28
其中：股票投资		17,625,862.17	40,099,603.38
基金投资		-	-
债券投资		226,683.60	146,108,646.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		0.00	0.00
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,160,531.13	563,051.93
应收利息		23,644.64	3,935,677.70
应收股利		-	-
应收申购款		494.54	6,328.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		103,271,583.09	210,806,131.83

负债和所有者权益	附注号	报告期初至转型前	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	12,557,796.76
应付赎回款		9,518,132.59	194,916.23
应付管理人报酬		161,495.00	207,630.03
应付托管费		26,915.82	34,604.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		425,112.19	324,438.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		118,969.30	52,908.26
负债合计		10,250,624.90	13,372,295.04
所有者权益:			
实收基金		66,518,071.71	177,293,979.18
未分配利润		26,502,886.48	20,139,857.61
所有者权益合计		93,020,958.19	197,433,836.79
负债和所有者权益总计		103,271,583.09	210,806,131.83

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.398 元，基金份额总额 66,518,071.71 份。

7.2 利润表

会计主体：中海保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		52,475,662.22	31,442,369.20
1. 利息收入		2,526,127.20	12,066,128.39
其中：存款利息收入		141,859.51	78,175.11
债券利息收入		2,327,503.36	11,944,069.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,764.33	43,883.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		45,396,363.89	11,614,443.22

列)			
其中：股票投资收益		44,303,422.52	10,867,592.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益		964,688.73	594,943.77
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		128,252.64	151,907.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		4,306,993.61	7,416,205.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		246,177.52	345,592.36
减：二、费用		2,862,441.90	6,105,767.50
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,159,216.28	2,729,144.01
2. 托管费	7.4.8.2.2	193,202.69	454,857.26
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,358,583.02	1,349,099.58
5. 利息支出		23,457.56	1,243,703.51
其中：卖出回购金融资产支出		23,457.56	1,243,703.51
6. 其他费用		127,982.35	328,963.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,613,220.32	25,336,601.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,613,220.32	25,336,601.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	177,293,979.18	20,139,857.61	197,433,836.79
二、本期经营活动产生的	-	49,613,220.32	49,613,220.32

基金净值变动数（本期净利润）			
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）	-110,775,907.47	-43,250,191.45	-154,026,098.92
其中：1. 基金申购款	14,043,087.97	5,210,633.20	19,253,721.17
2. 基金赎回款	-124,818,995.44	-48,460,824.65	-173,279,820.09
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	66,518,071.71	26,502,886.48	93,020,958.19
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	267,367,843.84	11,289,273.04	278,657,116.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	25,336,601.70	25,336,601.70
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）	-90,073,864.66	-5,000,461.88	-95,074,326.54
其中：1. 基金申购款	2,185,399.32	164,381.61	2,349,780.93
2. 基金赎回款	-92,259,263.98	-5,164,843.49	-97,424,107.47
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）	-	-11,485,555.25	-11,485,555.25
五、期末所有者权益（基金净值）	177,293,979.18	20,139,857.61	197,433,836.79

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：

黄鹏

基金管理人负责人

宋宇

主管会计工作负责人

周琳

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定,经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1850 号《关于核准中海保本混合型证券投资基金募集的批复》核准募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行;有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于 2012 年 6 月 20 日生效,该日的基金份额总额为 474,514,865.04 份,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2012]B059 号验资报告予以验证。

根据《中海保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金保本周期为 3 年,第一个保本周期自基金合同生效之日起至 3 个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金的第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为保证人,其承担保证责任的金额即保证范围为:在保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积(即“可赎回金额”)加上认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分(该差额部分即为“保本赔付差额”)。本基金于基金合同生效日(即 2012 年 6 月 20 日)开始保本周期,保本周期自基金合同生效之日起三年后对应日(2015 年 6 月 20 日为非工作日,顺延至下一工作日)止,即 2015 年 6 月 23 日为本基金保本周期到期日。

根据《中海保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《关于中海保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》,中海保本混合基金保本周期到期时,由于本基金未符合保本基金存续条件,将按照本基金合同的约定转型为非保本的混合型基金,即“中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金”。同时,本基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日(含第 5 个工作日),即 2015 年 6 月 23 日至 2015 年 6 月 30 日。本基金自 2015 年 7 月 1 日起转型为中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中海保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金投资组合的配置比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%,其

中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准：3 年期银行定期存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中海保本混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，自 2015 年 3 月 26 日起，本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更事项外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指

数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东

中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司
------------------------------	-------------

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国联证券	14,168,099.92	1.58%	57,266,002.21	6.39%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国联证券	-	-	15,412,414.53	4.83%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例（%）	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例（%）
国联证券	13,000,000.00	9.77%	254,100,000.00	9.80%

7.4.8.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
国联证券	12,899.01	1.67%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
国联证券	52,134.46	6.63%	31,650.71	9.80%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 6月30日	2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,159,216.28	2,729,144.01
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	501,732.36	1,188,699.12

注：支付基金管理人中海基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年 6月30日	2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	193,202.69	454,857.26

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	82,436,856.68	132,845.27	19,222,844.47	47,677.84

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项

7.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
300353	东土科技	2015年	重大事项	57.80	2015年	34.28	70,000	1,922,606.73	0024254,046,000.00

		6月 3日	停牌		10月 13日				
凯撒股 份	2015 年 4月 23日	重大 事项 停牌	26.31	2015年 9月 22日	21.09	120,000	1,652,033.69	3,157,200.00	-
002712	思美 传媒	2015 年 3月 19日	重大 事项 停牌	101.17	2015 年 7月 31日	66.10	28,301	1,989,937.70	2,863,212.17
-									
002589	瑞康 医药	2015 年 5月 21日	重大 事项 停牌	93.85	2015 年 10月 9日	46.88	29,000	1,254,192.78	2,721,650.00
-									
002292	奥飞 动漫	2015 年 5月 18日	重大 事项 停牌	37.29	2015 年 8月 28日	34.07	60,000	1,513,000.50	2,237,400.00
-									
603018	设计 股份	2015 年 4月 9日	重大 事项 停牌	86.68	2015 年 7月 3日	71.61	30,000	2,404,613.80	2,600,400.00
-									

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,827,083.60 元，属于第二层次的余额为 15,025,462.17 元，无第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 136,913,596.28 元，第二层次 49,294,654.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	转型后至报告期末
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	4,040,258.96
结算备付金		489,506.09
存出保证金		105,000.67
交易性金融资产	7.4.7.2	47,587,429.86
其中：股票投资		37,067,568.46
基金投资		-
债券投资		10,519,861.40
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		234,857.52
应收利息	7.4.7.5	328,597.32
应收股利		-
应收申购款		22,590.96
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		52,808,241.38
负债和所有者权益	附注号	转型后至报告期末
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		-
应付证券清算款		520,194.71
应付赎回款		14,423.85
应付管理人报酬		71,260.73
应付托管费		11,876.77
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	239,694.40
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	71,134.56
负债合计		928,585.02
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	38,409,612.82
未分配利润	7.4.7.10	13,470,043.54
所有者权益合计		51,879,656.36
负债和所有者权益总计		52,808,241.38

注：1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.351 元，基金份额总额 38,409,612.82 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-3,644,133.42
1. 利息收入		222,939.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	83,282.44
债券利息收入		139,657.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		190,062.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	145,336.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-45,280.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
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	90,006.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,075,128.57
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	17,993.55
减：二、费用		1,510,526.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	516,155.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	86,025.87
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	764,094.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	144,250.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,154,660.18
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,154,660.18

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 1 日至 2015 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）	66,518,071.71	26,502,886.48	93,020,958.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-5,154,660.18	-5,154,660.18
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）	-28,108,458.89	-7,878,182.76	-35,986,641.65
其中：1. 基金申购款	1,794,308.10	619,090.20	2,413,398.30
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-29,902,766.99	-8,497,272.96	-38,400,039.95
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	38,409,612.82	13,470,043.54	51,879,656.36

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：

_____ 黄鹏	_____ 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

中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金(原中海保本混合型证券投资基金，以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定，经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1850号《关于核准中海保本混合型证券投资基金募集的批复》核准募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于2012年6月20日生效，该日的基金份额总额为474,514,865.04份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2012]B059号验资报告予以验证。

根据《中海保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《关于中海保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》，中海保本混合基金保本周期到期时，由于本基金未符合保本基金存续条件，将按照本基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金”。同时，本基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日)，即2015年6月23日至2015年6月30日。本基金自2015年7月1日起转型为中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金。

根据《中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合的配置比例为：股票资产占基金资产的30%—80%，债券资产占基金资产的20%—70%，权证投资占基金资产净值的0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准：沪深300指数×55%+中国债券总指数×45%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他

金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的

参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有

明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	4,040,258.96
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,040,258.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	34,074,260.56	37,067,568.46	2,993,307.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	10,628,137.30	10,519,861.40
	银行间市场	-	-
	合计	10,628,137.30	10,519,861.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	44,702,397.86	47,587,429.86	2,885,032.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	633.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	220.30
应收债券利息	327,696.77
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	47.20
合计	328,597.32

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	239,694.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	239,694.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
----	--------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.46
预提费用	70,000.00
其他	1,132.10
合计	71,134.56

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	66,518,071.71	66,518,071.71
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,794,308.10	1,794,308.10
本期赎回（以“-”号填列）	-29,902,766.99	-29,902,766.99
本期末	38,409,612.82	38,409,612.82

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	26,273,918.85	228,967.63	26,502,886.48
本期利润	-1,079,531.61	-4,075,128.57	-5,154,660.18
本期基金份额交易产生的变动数	-8,607,144.95	728,962.19	-7,878,182.76
其中：基金申购款	626,977.27	-7,887.07	619,090.20
基金赎回款	-9,234,122.22	736,849.26	-8,497,272.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,587,242.29	-3,117,198.75	13,470,043.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,293.77

其他	1,066.86
合计	83,282.44

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	251,981,780.99
卖出股票成本总额	251,836,444.98
买卖股票差价收入	145,336.01

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-45,280.65
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-45,280.65

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,683,485.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,591,460.65
减：应收利息总额	137,305.86
债券投资收益	-45,280.65

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	90,006.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	90,006.80

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,075,128.57

——股票投资	-3,896,169.07
——债券投资	-178,959.50
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-4,075,128.57

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	13,133.45
转出基金补偿收入	4,860.10
合计	17,993.55

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	764,094.75
银行间市场交易费用	-
合计	764,094.75

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
审计费用	45,204.81
信息披露费	80,656.84
银行费用	389.00
帐户服务费	18,000.00
合计	144,250.65

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东
中海恒信资产管理（上海）有限公司（以下简称“中海恒信”）	基金管理人的控股子公司

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国联证券	58,634,690.59	11.12%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期回购债券 成交总额的比例
国联证券	16,115,985.83	62.78%

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	53,429.20	11.56%	2,137.28	0.89%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
当期应支付的管理费	516,155.49
其中：支付销售机构的客户维护费	219,667.94

注：支付基金管理人中海基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月1日至2015年12月31日
当期应支付的托管费	86,025.87

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内未与关联方进行银行间市场交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年7月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	4,040,258.96	78,921.81

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项

7.4.11 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
300036	超图软件	2015年10月30日	重大事项停牌	43.18	2016年1月15日	35.11	41,589	1,231,489.78	6002711,795,813.02

航天信 息	2015 年 10月 12日	重大 事项 停牌	71.49	-	-	18,700	993,459.00	1,336,863.00	-
300242	明家 科技	2015 年 12月 18日	重大 事项 停牌	49.96	2016 年 1月 22日	44.96	15,700	644,319.93	784,372.00
-									

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 33,150,520.44 元，属于第二层次的余额为 14,436,909.42 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观

察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告(转型前)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,625,862.17	17.07
	其中：股票	17,625,862.17	17.07
2	固定收益投资	226,683.60	0.22
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	0.00	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	83,102,697.35	80.47
7	其他资产	2,316,339.97	2.24
8	合计	103,271,583.09	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,440,600.00	10.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,721,650.00	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
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	2,863,212.17	3.08
M	科学研究和技术服务业	2,600,400.00	2.80
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,625,862.17	18.95

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300353	东土科技	70,000	4,046,000.00	4.35
2	002425	凯撒股份	120,000	3,157,200.00	3.39
3	002712	思美传媒	28,301	2,863,212.17	3.08
4	002589	瑞康医药	29,000	2,721,650.00	2.93
5	603018	设计股份	30,000	2,600,400.00	2.80

6	002292	奥飞动漫	60,000	2,237,400.00	2.41
---	--------	------	--------	--------------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600271	航天信息	10,564,546.43	5.35
2	603686	龙马环卫	7,432,053.52	3.76
3	300178	腾邦国际	7,222,181.00	3.66
4	300273	和佳股份	7,110,638.83	3.60
5	600366	宁波韵升	6,828,592.39	3.46
6	2030	达安基因	6,645,511.80	3.37
7	300287	飞利信	6,488,287.05	3.29
8	600776	东方通信	6,455,311.00	3.27
9	2339	积成电子	5,572,907.00	2.82
10	1696	宗申动力	5,275,843.61	2.67
11	300020	银江股份	5,187,305.00	2.63
12	2642	荣之联	4,929,600.66	2.50
13	600685	广船国际	4,856,190.88	2.46
14	600170	上海建工	4,844,685.00	2.45
15	600820	隧道股份	4,749,867.02	2.41
16	300353	东土科技	4,675,051.35	2.37
17	2405	四维图新	4,659,523.55	2.36
18	2178	延华智能	4,620,777.40	2.34
19	300339	润和软件	4,592,556.00	2.33
20	2235	安妮股份	4,470,056.41	2.26
21	600676	交运股份	4,465,525.00	2.26
22	300030	阳普医疗	4,443,924.30	2.25
23	2580	圣阳股份	4,288,162.75	2.17
24	2322	理工监测	4,215,323.06	2.14
25	600767	运盛实业	4,194,519.00	2.12
26	300253	卫宁软件	4,167,964.00	2.11
27	600655	豫园商城	4,099,517.99	2.08

28	2126	银轮股份	3,965,970.26	2.01
----	------	------	--------------	------

注：本报告期内，累计买入股票成本总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603686	龙马环卫	11,113,598.00	5.63
2	600271	航天信息	10,837,530.09	5.49
3	300178	腾邦国际	7,962,730.90	4.03
4	300273	和佳股份	7,592,746.70	3.85
5	2339	积成电子	7,495,549.00	3.80
6	2030	达安基因	7,390,636.66	3.74
7	300287	飞利信	7,280,621.80	3.69
8	600366	宁波韵升	7,105,925.29	3.60
9	600776	东方通信	6,748,839.16	3.42
10	300020	银江股份	6,546,545.60	3.32
11	2249	大洋电机	6,173,200.00	3.13
12	300299	富春通信	6,049,732.00	3.06
13	1696	宗申动力	5,855,305.46	2.97
14	300049	福瑞股份	5,810,968.50	2.94
15	300016	北陆药业	5,433,285.95	2.75
16	600820	隧道股份	5,428,950.00	2.75
17	2642	荣之联	5,241,687.42	2.65
18	300339	润和软件	5,239,386.00	2.65
19	600109	国金证券	5,148,857.78	2.61
20	2178	延华智能	5,137,079.92	2.60
21	2405	四维图新	5,131,506.84	2.60
22	300030	阳普医疗	5,018,854.45	2.54
23	2235	安妮股份	5,017,192.55	2.54
24	2126	银轮股份	4,974,263.60	2.52
25	601166	兴业银行	4,945,844.00	2.51
26	600685	广船国际	4,675,098.68	2.37
27	600655	豫园商城	4,665,408.80	2.36
28	600170	上海建工	4,643,507.58	2.35
29	24	招商地产	4,639,922.60	2.35
30	600676	交运股份	4,579,964.12	2.32

31	601727	上海电气	4,480,869.14	2.27
32	600067	冠城大通	4,472,363.84	2.27
33	300166	东方国信	4,411,428.00	2.23
34	603806	福斯特	4,287,625.00	2.17
35	2580	圣阳股份	4,277,731.32	2.17
36	600767	运盛实业	4,211,467.25	2.13
37	601233	桐昆股份	4,210,339.03	2.13
38	2322	理工监测	4,182,234.09	2.12
39	601318	中国平安	4,135,377.56	2.09
40	601788	光大证券	3,969,445.00	2.01
41	300253	卫宁软件	3,966,088.35	2.01
42	2318	久立特材	3,954,955.32	2.00
43	601186	中国铁建	3,949,841.00	2.00

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	413,981,812.58
卖出股票收入（成交）总额	484,794,896.89

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	226,683.60	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	226,683.60	0.24

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	1,560	226,683.60	0.24

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	131,669.66
2	应收证券清算款	2,160,531.13
3	应收股利	-
4	应收利息	23,644.64
5	应收申购款	494.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,316,339.97

8.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值	流通受限情况说明

				比例 (%)	
1	300353	东土科技	4,046,000.00	4.35	重大事项停牌
2	002425	凯撒股份	3,157,200.00	3.39	重大事项停牌
3	002712	思美传媒	2,863,212.17	3.08	重大事项停牌
4	002589	瑞康医药	2,721,650.00	2.93	重大事项停牌
5	603018	设计股份	2,600,400.00	2.80	重大事项停牌
6	002292	奥飞动漫	2,237,400.00	2.41	重大事项停牌

8.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告(转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,067,568.46	70.19
	其中：股票	37,067,568.46	70.19
2	固定收益投资	10,519,861.40	19.92
	其中：债券	10,519,861.40	19.92
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,529,765.05	8.58
7	其他资产	691,046.47	1.31
8	合计	52,808,241.38	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,575,341.60	3.04

B	采矿业	-	-
C	制造业	19,148,287.73	36.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,604,585.38	6.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,491,893.00	4.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,265,179.62	8.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,069,578.00	2.06
L	租赁和商务服务业	2,005,736.00	3.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	621,621.00	1.20
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,166,194.36	2.25
S	综合	1,119,151.77	2.16
	合计	37,067,568.46	71.45

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 (转型后)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002172	澳洋科技	125,000	1,860,000.00	3.59
2	300036	超图软件	41,589	1,795,813.02	3.46
3	002308	威创股份	64,161	1,581,568.65	3.05
4	002086	东方海洋	53,221	1,575,341.60	3.04
5	300458	全志科技	12,500	1,487,500.00	2.87
6	000516	国际医学	67,600	1,487,200.00	2.87

7	002098	浔兴股份	89,673	1,386,344.58	2.67
8	300188	美亚柏科	26,888	1,363,221.60	2.63
9	600271	航天信息	18,700	1,336,863.00	2.58
10	002712	思美传媒	10,063	1,288,064.00	2.48

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000728	国元证券	5,171,045.92	9.97
2	300463	迈克生物	4,385,333.00	8.45
3	002659	中泰桥梁	3,454,442.64	6.66
4	002123	荣信股份	3,223,218.00	6.21
5	300016	北陆药业	3,186,582.00	6.14
6	002465	海格通信	3,145,134.26	6.06
7	600185	格力地产	3,058,075.00	5.89
8	600038	中直股份	3,043,207.09	5.87
9	002712	思美传媒	3,041,743.00	5.86
10	600061	国投安信	2,977,015.00	5.74
11	000559	万向钱潮	2,940,197.10	5.67
12	000651	格力电器	2,908,466.00	5.61
13	002111	威海广泰	2,892,558.92	5.58
14	300244	迪安诊断	2,873,939.00	5.54
15	300367	东方网力	2,833,862.00	5.46
16	300188	美亚柏科	2,760,581.00	5.32
17	600820	隧道股份	2,718,177.00	5.24
18	600713	南京医药	2,709,883.00	5.22
19	300431	暴风科技	2,670,671.16	5.15
20	600136	道博股份	2,634,512.00	5.08
21	002245	澳洋顺昌	2,544,037.00	4.90
22	600594	益佰制药	2,500,229.00	4.82
23	600836	界龙实业	2,478,685.00	4.78
24	002013	中航机电	2,426,109.00	4.68

25	600098	广州发展	2,423,147.00	4.67
26	002074	国轩高科	2,396,696.74	4.62
27	300036	超图软件	2,393,373.00	4.61
28	002354	天神娱乐	2,385,721.00	4.60
29	600282	南钢股份	2,382,878.00	4.59
30	002439	启明星辰	2,381,839.00	4.59
31	603989	艾华集团	2,337,135.50	4.50
32	600895	张江高科	2,313,898.00	4.46
33	002126	银轮股份	2,256,841.56	4.35
34	601989	中国重工	2,245,329.00	4.33
35	000700	模塑科技	2,231,630.16	4.30
36	600661	新南洋	2,221,702.00	4.28
37	002137	麦达数字	2,208,269.00	4.26
38	300147	香雪制药	2,192,082.90	4.23
39	600325	华发股份	2,146,369.00	4.14
40	300450	先导智能	2,137,331.00	4.12
41	002555	三七互娱	2,123,475.00	4.09
42	002462	嘉事堂	2,099,783.00	4.05
43	002086	东方海洋	2,081,993.21	4.01
44	000568	泸州老窖	2,078,414.12	4.01
45	300020	银江股份	2,068,545.00	3.99
46	002098	浔兴股份	2,051,554.00	3.95
47	300224	正海磁材	2,037,898.00	3.93
48	600685	中船防务	2,030,955.50	3.91
49	601318	中国平安	2,008,267.50	3.87
50	002172	澳洋科技	1,911,451.00	3.68
51	002308	威创股份	1,855,708.00	3.58
52	600663	陆家嘴	1,827,904.00	3.52
53	300271	华宇软件	1,815,375.62	3.50
54	600030	中信证券	1,782,996.00	3.44
55	300279	和晶科技	1,763,792.00	3.40
56	601336	新华保险	1,703,043.30	3.28
57	002339	积成电子	1,679,266.00	3.24
58	600676	交运股份	1,673,459.31	3.23
59	002466	天齐锂业	1,669,348.00	3.22
60	300336	新文化	1,669,132.00	3.22

61	600271	航天信息	1,640,299.00	3.16
62	300242	明家科技	1,637,586.05	3.16
63	300287	飞利信	1,636,625.22	3.15
64	600576	万家文化	1,609,091.00	3.10
65	002573	清新环境	1,602,722.00	3.09
66	600170	上海建工	1,592,311.00	3.07
67	000028	国药一致	1,585,753.00	3.06
68	601998	中信银行	1,584,727.23	3.05
69	002405	四维图新	1,583,579.00	3.05
70	600284	浦东建设	1,581,639.15	3.05
71	600818	中路股份	1,575,000.00	3.04
72	300339	润和软件	1,570,707.00	3.03
73	601788	光大证券	1,550,372.00	2.99
74	300145	南方泵业	1,544,317.00	2.98
75	002551	尚荣医疗	1,543,800.00	2.98
76	603588	高能环境	1,530,647.00	2.95
77	600055	华润万东	1,527,900.00	2.95
78	600048	保利地产	1,523,383.24	2.94
79	000977	浪潮信息	1,515,705.00	2.92
80	000768	中航飞机	1,508,693.00	2.91
81	600629	华建集团	1,506,060.00	2.90
82	000502	绿景控股	1,497,071.00	2.89
83	000733	振华科技	1,488,790.00	2.87
84	000516	国际医学	1,471,631.00	2.84
85	600109	国金证券	1,460,837.00	2.82
86	601901	方正证券	1,455,460.00	2.81
87	600036	招商银行	1,431,702.28	2.76
88	002343	慈文传媒	1,425,116.00	2.75
89	601328	交通银行	1,424,288.46	2.75
90	300253	卫宁健康	1,423,695.00	2.74
91	002250	联化科技	1,420,640.00	2.74
92	000919	金陵药业	1,420,240.00	2.74
93	600511	国药股份	1,419,998.00	2.74
94	600587	新华医疗	1,416,710.52	2.73
95	600837	海通证券	1,415,938.00	2.73
96	600422	昆药集团	1,374,899.00	2.65

97	300090	盛运环保	1,333,912.30	2.57
98	300363	博腾股份	1,306,527.26	2.52
99	600115	东方航空	1,305,672.00	2.52
100	600708	光明地产	1,293,265.00	2.49
101	603308	应流股份	1,284,658.41	2.48
102	300458	全志科技	1,277,379.00	2.46
103	002522	浙江众成	1,275,519.00	2.46
104	002491	通鼎互联	1,268,406.00	2.44
105	300165	天瑞仪器	1,264,558.00	2.44
106	600976	健民集团	1,249,203.00	2.41
107	600635	大众公用	1,218,501.00	2.35
108	600838	上海九百	1,215,089.10	2.34
109	300011	鼎汉技术	1,212,511.00	2.34
110	601199	江南水务	1,195,468.00	2.30
111	600798	宁波海运	1,190,694.00	2.30
112	002347	泰尔重工	1,186,543.00	2.29
113	002366	台海核电	1,176,560.00	2.27
114	300033	同花顺	1,143,750.00	2.20
115	300299	富春通信	1,137,776.00	2.19
116	300059	东方财富	1,137,013.00	2.19
117	300199	翰宇药业	1,121,280.00	2.16
118	300376	易事特	1,120,319.00	2.16
119	300398	飞凯材料	1,117,876.00	2.15
120	000558	莱茵体育	1,096,438.00	2.11
121	600645	中源协和	1,095,048.00	2.11
122	002271	东方雨虹	1,090,546.52	2.10
123	601313	江南嘉捷	1,087,695.00	2.10
124	300077	国民技术	1,078,744.47	2.08
125	002273	水晶光电	1,070,327.27	2.06
126	600016	民生银行	1,050,000.00	2.02
127	300190	维尔利	1,038,669.00	2.00

注：本报告期内，累计买入股票成本总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000728	国元证券	4,735,180.90	9.13
2	002712	思美传媒	4,655,319.87	8.97
3	300463	迈克生物	3,703,346.00	7.14
4	300353	东土科技	3,635,917.02	7.01
5	002425	凯撒股份	3,629,746.25	7.00
6	002123	荣信股份	3,434,988.73	6.62
7	600061	国投安信	3,423,504.14	6.60
8	002659	中泰桥梁	3,369,717.80	6.50
9	002343	慈文传媒	3,250,069.00	6.26
10	002465	海格通信	2,981,583.07	5.75
11	000559	万向钱潮	2,940,408.90	5.67
12	002111	威海广泰	2,827,976.85	5.45
13	300450	先导智能	2,753,893.40	5.31
14	002466	天齐锂业	2,737,442.88	5.28
15	600820	隧道股份	2,709,539.47	5.22
16	600185	格力地产	2,665,097.71	5.14
17	300367	东方网力	2,645,246.50	5.10
18	000651	格力电器	2,583,117.00	4.98
19	600038	中直股份	2,540,784.23	4.90
20	601989	中国重工	2,484,888.50	4.79
21	300244	迪安诊断	2,462,115.40	4.75
22	002354	天神娱乐	2,420,887.04	4.67
23	300188	美亚柏科	2,318,496.66	4.47
24	600685	中船防务	2,298,005.00	4.43
25	300224	正海磁材	2,276,610.30	4.39
26	600713	南京医药	2,272,914.50	4.38
27	603989	艾华集团	2,241,727.49	4.32
28	002013	中航机电	2,135,829.37	4.12
29	300020	银江股份	2,133,892.00	4.11
30	600594	益佰制药	2,087,664.00	4.02
31	601318	中国平安	2,074,860.00	4.00
32	002074	国轩高科	2,071,099.50	3.99
33	002555	三七互娱	2,059,703.60	3.97
34	300431	暴风科技	2,037,372.00	3.93
35	600098	广州发展	2,026,942.00	3.91
36	002589	瑞康医药	2,025,236.46	3.90

37	002462	嘉事堂	2,021,705.17	3.90
38	600836	界龙实业	1,994,469.84	3.84
39	002439	启明星辰	1,967,131.33	3.79
40	603018	设计股份	1,934,507.22	3.73
41	300145	南方泵业	1,900,403.25	3.66
42	300336	新文化	1,852,257.59	3.57
43	300271	华宇软件	1,836,122.43	3.54
44	002137	麦达数字	1,822,887.52	3.51
45	002339	积成电子	1,786,041.61	3.44
46	601336	新华保险	1,784,103.00	3.44
47	000028	国药一致	1,760,731.00	3.39
48	002573	清新环境	1,751,192.96	3.38
49	600511	国药股份	1,746,842.00	3.37
50	000502	绿景控股	1,723,750.00	3.32
51	000568	泸州老窖	1,723,095.74	3.32
52	002292	奥飞动漫	1,710,074.66	3.30
53	300279	和晶科技	1,685,229.00	3.25
54	600663	陆家嘴	1,674,471.90	3.23
55	600030	中信证券	1,662,596.00	3.20
56	300287	飞利信	1,638,056.95	3.16
57	002245	澳洋顺昌	1,634,076.80	3.15
58	300147	香雪制药	1,593,963.49	3.07
59	601998	中信银行	1,585,919.10	3.06
60	002250	联化科技	1,544,969.00	2.98
61	000977	浪潮信息	1,510,986.00	2.91
62	000733	振华科技	1,502,142.25	2.90
63	600109	国金证券	1,481,002.00	2.85
64	603588	高能环境	1,477,042.00	2.85
65	600055	华润万东	1,476,348.22	2.85
66	002551	尚荣医疗	1,474,757.20	2.84
67	600661	新南洋	1,472,489.00	2.84
68	600048	保利地产	1,472,372.00	2.84
69	601788	光大证券	1,454,274.00	2.80
70	600325	华发股份	1,453,850.50	2.80
71	300253	卫宁健康	1,446,786.00	2.79
72	601199	江南水务	1,439,713.00	2.78
73	000919	金陵药业	1,437,350.00	2.77
74	600136	道博股份	1,417,047.10	2.73

75	002405	四维图新	1,361,369.78	2.62
76	300016	北陆药业	1,361,024.00	2.62
77	002126	银轮股份	1,350,713.00	2.60
78	000768	中航飞机	1,341,110.00	2.59
79	601901	方正证券	1,325,423.00	2.55
80	600284	浦东建设	1,318,760.00	2.54
81	601328	交通银行	1,315,858.00	2.54
82	600036	招商银行	1,307,679.00	2.52
83	002522	浙江众成	1,297,784.48	2.50
84	300101	振芯科技	1,291,916.36	2.49
85	600629	华建集团	1,289,693.90	2.49
86	600170	上海建工	1,289,581.68	2.49
87	600115	东方航空	1,286,788.40	2.48
88	300059	东方财富	1,285,153.41	2.48
89	002491	通鼎互联	1,283,520.90	2.47
90	600587	新华医疗	1,281,162.00	2.47
91	600895	张江高科	1,275,911.58	2.46
92	600282	南钢股份	1,270,150.00	2.45
93	603308	应流股份	1,269,455.21	2.45
94	000555	神州信息	1,268,398.00	2.44
95	002273	水晶光电	1,264,661.00	2.44
96	300339	润和软件	1,255,679.00	2.42
97	300165	天瑞仪器	1,254,437.00	2.42
98	300011	鼎汉技术	1,247,634.57	2.40
99	600635	大众公用	1,241,056.00	2.39
100	601313	江南嘉捷	1,236,380.00	2.38
101	600837	海通证券	1,213,360.00	2.34
102	002366	台海核电	1,207,511.70	2.33
103	600818	中路股份	1,206,807.00	2.33
104	600838	上海九百	1,206,400.07	2.33
105	002347	泰尔重工	1,199,922.00	2.31
106	600798	宁波海运	1,194,748.49	2.30
107	002271	东方雨虹	1,184,625.00	2.28
108	600676	交运股份	1,175,880.50	2.27
109	300077	国民技术	1,164,122.42	2.24
110	600422	昆药集团	1,120,096.00	2.16
111	600645	中源协和	1,119,145.02	2.16
112	300090	盛运环保	1,115,760.75	2.15

113	300033	同花顺	1,115,161.00	2.15
114	000700	模塑科技	1,112,936.00	2.15
115	300166	东方国信	1,106,288.00	2.13
116	300190	维尔利	1,098,642.00	2.12
117	002367	康力电梯	1,081,813.12	2.09
118	300376	易事特	1,067,750.00	2.06
119	600708	光明地产	1,056,575.27	2.04
120	300199	翰宇药业	1,046,229.00	2.02

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	275,174,320.34
卖出股票收入（成交）总额	251,981,780.99

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,019,411.40	11.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,500,450.00	8.67
	其中：政策性金融债	4,500,450.00	8.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,519,861.40	20.28

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	020081	15 贴债 07	57,580	5,688,328.20	10.96
2	018001	国开 1301	45,000	4,500,450.00	8.67
3	019419	14 国债 19	3,280	331,083.20	0.64

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	105,000.67
2	应收证券清算款	234,857.52
3	应收股利	-
4	应收利息	328,597.32
5	应收申购款	22,590.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	691,046.47

8.12.2 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。

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300036	超图软件	1,795,813.02	3.46	重大事项停牌
2	600271	航天信息	1,336,863.00	2.58	重大事项停牌

8.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息(转型前)**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,594	41,730.28	740,068.05	1.11%	65,778,003.66	98.89%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,954.19	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,269	30,267.62	740,068.05	1.93%	37,669,544.77	98.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,961.41	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月1日）基金份额总额	61,865,695.57
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,793,953.84
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	25,250,036.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	38,409,612.82

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人免去俞忠华先生副总经理职务。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内已预提审计费 70,000.00 元，截至 2015 年 12 月 31 日暂未支付。该事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东方证券	1	67,840,059.86	12.87%	62,774.73	13.59%	-
海通证券	2	62,287,290.64	11.82%	45,550.77	9.86%	-
国联证券	1	58,634,690.59	11.12%	53,429.20	11.56%	-
东北证券	2	50,775,786.44	9.63%	46,529.26	10.07%	-
中信建投	2	49,870,962.83	9.46%	37,184.58	8.05%	-
国金证券	1	48,499,346.64	9.20%	45,167.14	9.78%	-
招商证券	1	41,308,845.70	7.84%	38,470.74	8.33%	-
华泰证券	2	32,129,438.10	6.09%	29,922.16	6.48%	-
方正证券	1	24,303,393.53	4.61%	17,773.10	3.85%	-
安信证券	2	23,013,780.56	4.37%	21,432.95	4.64%	-
中泰证券	2	21,354,761.39	4.05%	19,887.93	4.30%	-
东兴证券	1	11,507,388.56	2.18%	10,716.80	2.32%	-
广发证券	1	10,435,940.00	1.98%	9,719.04	2.10%	-
平安证券	1	9,363,607.89	1.78%	8,720.48	1.89%	-
国泰君安	2	6,914,816.34	1.31%	6,439.72	1.39%	-
长江证券	1	5,206,312.07	0.99%	4,848.41	1.05%	-
国信证券	1	3,709,680.19	0.70%	3,454.82	0.75%	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	8,719,619.41	33.97%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	16,115,985.83	62.78%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	331,280.00	1.29%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	504,720.00	1.97%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	232,508,216.81	25.87%	211,675.67	27.42%	-
方正证券	1	143,350,810.44	15.95%	101,836.48	13.19%	-
国泰君安	2	108,849,335.42	12.11%	99,096.67	12.84%	-
长江证券	1	86,765,163.65	9.65%	78,991.52	10.23%	-
国金证券	1	77,085,712.96	8.58%	70,179.06	9.09%	-
海通证券	2	68,747,703.01	7.65%	52,285.38	6.77%	-
申万宏源	1	49,451,071.35	5.50%	45,019.79	5.83%	-
光大证券	1	42,248,170.33	4.70%	38,462.21	4.98%	-
中信建投	2	35,844,409.59	3.99%	25,464.11	3.30%	-
东北证券	2	27,423,934.95	3.05%	24,966.58	3.23%	-
国联证券	1	14,168,099.92	1.58%	12,899.01	1.67%	-
招商证券	1	12,277,551.04	1.37%	11,177.43	1.45%	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风控稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	7,997.33	0.01%	-	-	-	-
长江证券	30,508,033.05	36.59%	50,000,000.00	37.59%	-	-
国金证券	9,081,247.31	10.89%	15,000,000.00	11.28%	-	-
海通证券	456,851.84	0.55%	15,000,000.00	11.28%	-	-
申万宏源	31,167,111.19	37.38%	-	-	-	-
光大证券	11,875,701.03	14.24%	25,000,000.00	18.80%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	278,510.00	0.33%	15,000,000.00	11.28%	-	-
国联证券	-	-	13,000,000.00	9.77%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

中海基金管理有限公司
2016 年 3 月 25 日