

中海分红增利混合型证券投资基金 2016 年 半年度报告

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 其他指标..... | 错误！未定义书签。 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 错误！未定义书签。 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 33 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 34 |
| 7.3 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..... | 34 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |
| 7.6 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..... | 38 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 38 |
| 7.8 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..... | 38 |
| 7.9 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..... | 38 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 38 |

| | |
|--|------------------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 39 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 40 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 错误！未定义书签。 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 40 |
| 8.4 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..... | 40 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 40 |
| §10 重大事件揭示..... | 41 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 41 |
| 10.2 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..... | 41 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 41 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 41 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 41 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| 10.8 其他重大事件..... | 44 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 错误！未定义书签。 |
| §12 备查文件目录..... | 48 |
| 12.1 备查文件目录..... | 48 |
| 12.2 存放地点..... | 48 |
| 12.3 查阅方式..... | 48 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 中海分红增利混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 中海分红增利混合 |
| 基金主代码 | 398011 |
| 前端交易代码 | 398011 |
| 后端交易代码 | 398012 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005 年 6 月 16 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 725,387,138.90 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，主要通过投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行的上市各类债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取高比例分红收益和资本相对增值的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金采用现金股利精选的投资策略，即：通过公司开发的 DM 模型和 POD 模型筛选出现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司。</p> <p>1、股票选择策略</p> <p>股票投资组合构建通过以下三个阶段进行：</p> <p>第一阶段：历史上分红能力强股票筛选</p> <p>本基金运用本公司开发的 DM 模型对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）进行过去分红能力筛选。主要通过现金股息率、3 年平均分红额等 6 项指标进行综合评价以反应上市公司过去分红强度、持续性、稳定性及分红投资回报。初步筛选出除上证红利指数 50 家成份股外的 150 家左右的上市公司，连同上证红利指数成份股 50 家，共 200 家左右股票作为中海分红增利基金股票备选库（I）。</p> <p>第二阶段：分红潜力股票精选</p> <p>针对第一阶段筛选的股票备选库（I），本基金运用 POD 模型对其分红潜力进行精选。</p> <p>中海 POD 模型由 3 个大的指标分析单元和 5 个量化的核心指标构成。</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>模型所用数据全部为上市公司公布的历史数据，以保证客观性。中海 POD 模型 3 个大的分析单元分别是：企业盈利能力，财务健康状况及资产管理能力。通过企业盈利能力的分析，判断企业分红能力的基础是否坚实，未来分红潜力是否大；通过企业短期、长期负债等财务健康指标的分析，判断企业分红意愿；资产管理能力高的企业表明公司的经营效率高，管理层能力很强，有较好的核心竞争力。</p> <p>中海 POD 模型对备选库(I)中的股票进行进一步精选，形成 100 家左右上市公司的股票作为本基金股票备选库 (II)。</p> <p>第三阶段:股票投资组合构造。</p> <p>基金经理小组依据市场、行业景气度及内、外部研究报告，特别是研究员的实地调研报告，确定 50 只左右分红类股票。依据投资决策委员会确定的资产配置，完成股票资产投资组合的构造。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。根据基金资产总体配置计划，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>运用 B-S 模型、二叉树模型、隐含波动率等方法对权证估值进行测算，通过权证交易来锁定风险。通过承担适量风险，进行主动投资以获取超额收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 上证红利指数×70% + 上证国债指数×25% + 银行一年期定期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于中等风险的混合型基金，其风险收益特征从长期平均来看，低于单纯的股票型基金，高于单纯的债券型基金。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王莉 | 林葛 |
| | 联系电话 | 021-38429808 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | wangl@zhfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-9788、 021-38789788 | 95599 |
| 传真 | | 021-68419525 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 上海市浦东新区银城中路 | 北京市东城区建国门内大街 69 |

| | | |
|-------|---------------------------------------|---------------------------------|
| | 68 号 2905-2908 室及 30 层 | 号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 黄鹏 | 周慕冰 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.zhfund.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中海基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -44,902,239.66 |
| 本期利润 | -213,753,715.91 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2959 |
| 本期加权平均净值利润率 | -42.11% |
| 本期基金份额净值增长率 | -30.53% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -217,908,773.75 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3004 |
| 期末基金资产净值 | 507,478,365.15 |
| 期末基金份额净值 | 0.6996 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 150.74% |

注 1：以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 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。

3.2 基金净值表现

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

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 3.03% | 1.86% | -1.35% | 0.60% | 4.38% | 1.26% |
| 过去三个月 | -3.53% | 1.99% | -2.07% | 0.65% | -1.46% | 1.34% |
| 过去六个月 | -30.53% | 2.88% | -10.80% | 1.25% | -19.73% | 1.63% |
| 过去一年 | -36.52% | 3.14% | -22.65% | 1.65% | -13.87% | 1.49% |
| 过去三年 | -6.50% | 2.22% | 35.60% | 1.32% | -42.10% | 0.90% |
| 自基金合同生效起至今 | 150.74% | 1.71% | 153.79% | 1.37% | -3.05% | 0.34% |

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2005 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为上证红利指数*70%+上证国债指数*25%+银行一年期定期存款利率*5%，本基金主要投资于中国证券市场中现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行的各类债券。因此，我们选取市场认同度很高的上证红利指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数，同时考虑分红基金的特点，加入了一年期定期存款利率作为业绩比较基准的一部分。在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 70%左右，债券及现金的投资比例控制在 30%左右，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例和最新的一年期定期存款利率，来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照 70%、25%、5%的比例对基础指数和一年期定期存款利率进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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 2016 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 32 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|---|------------------|---|-----|--|
| 邱红丽 | 研究部 副总经理、本基金基金经理、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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经理 | 2014 年 11 月 18 日 | - | 6 年 | 邱红丽女士，英国纽卡斯尔大学跨文化交流与国际管理专业硕士。历任大连龙日木制品有限公司会计，交通银行大连开发区分行会计主管，上海康时信息系统有限公司财务总监，尊龙实业（香港）有限公司财务总监。2009 年 4 月进入我公司工作，历任定量财务分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理、研究副总监，现任研究部副经理。2014 年 3 月至今任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年 11 月至今任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2015 年 11 月至今任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经理。 |
|-----|---|------------------|---|-----|--|

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、风险管理事后分析等环节，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全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司

制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风控稽核部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

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，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

2016 年上半年证券市场出现了非常大的波动，前 2 个月市场出现大幅度快速下跌，几度出现熔断的局面，市场也出现了恐慌的情绪；随之在 3 月份市场整体呈现了一波反弹的走势，期间创业板的反弹程度好于主板；到了 2 季度市场整体呈现震荡走势，板块分化非常严重，部分主题板块和龙头各股涨幅较大，期间低估值的二线蓝筹板块出现了轮涨，市场情绪比较平稳，虽然没有出现明显的大量增量资金入场，但市场整体已经呈现出了底部逐渐抬高的启稳走势。

本基金在 16 年上半年一直坚持蓝筹+成长+主题投资的配置策略，在配置了能够保持持续增长的蓝筹股的前提下，配置了一些成长股，板块配置方面比较均衡。今年上半年市场板块表现分化非常严重，均衡的板块配置没有产生好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.6996 元（累计净值 2.0996 元）。报告期内本基金净值增长率为-30.53%，低于业绩比较基准 19.73 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 年下半年，宏观经济方面仍然存在一定的不确定性，我们预计 2016 年下半年经济情况会有所企稳。国际方面也存在一定的不确定性，海外经济体特别是美联储的加息预期可能对

货币市场走向产生一定的影响。美联储和欧元区货币政策措施也会对全球资本市场产生影响。政策方面，预计货币政策将在继续坚持稳增长的情况下，保持一定的宽松政策。在货币政策持续宽松和政策对市场呵护的双重背景下，以及目前人民币汇率形势、国内和国际外围的一些干扰因素等已经逐渐明朗和消化。我们对市场后期的走势比较乐观。

2016 年下半年预计市场投资机会较大的行业还是在国家一直倡导和扶持的新兴产业中（如新能源、新技术、新娱乐消费等），和国家战略发展的规划布局中（如养老、国企改革和供给侧改革等）。

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，本基金在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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中海基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中海基金管理有限公司在中海分红增利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中海分红增利混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 71,153,306.56 | 42,939,134.41 |
| 结算备付金 | | 787,908.96 | 3,080,536.52 |
| 存出保证金 | | 561,006.20 | 1,310,672.12 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 438,606,325.14 | 662,963,019.61 |
| 其中：股票投资 | | 438,606,325.14 | 662,963,019.61 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 20,800,351.12 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 11,610.04 | 10,775.73 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 77,307.80 | 81,859.50 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |

| 资产总计 | | 511,197,464.70 | 731,186,349.01 |
|---------------|----------|-------------------|---------------------|
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 2,538.50 | 22,587,783.87 |
| 应付赎回款 | | 1,097,751.77 | 1,145,593.19 |
| 应付管理人报酬 | | 619,240.67 | 904,965.79 |
| 应付托管费 | | 103,206.76 | 150,827.64 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 284,736.28 | 1,900,394.35 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 1,611,625.57 | 1,506,121.97 |
| 负债合计 | | 3,719,099.55 | 28,195,686.81 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 725,387,138.90 | 698,133,991.62 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -217,908,773.75 | 4,856,670.58 |
| 所有者权益合计 | | 507,478,365.15 | 702,990,662.20 |
| 负债和所有者权益总计 | | 511,197,464.70 | 731,186,349.01 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6996 元，基金份额总额 725,387,138.90 份。

6.2 利润表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2016年1月1日至 2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日 |
|------------------|----------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | -206,474,961.93 | 555,462,673.97 |
| 1.利息收入 | | 274,251.50 | 1,525,345.44 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 249,912.75 | 295,550.92 |
| 债券利息收入 | | - | 1,229,794.52 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 24,338.75 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -37,984,541.98 | 571,335,246.93 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -39,010,541.32 | 568,836,283.37 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | -107,010.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,025,999.34 | 2,605,973.56 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -168,851,476.25 | -18,212,036.34 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 86,804.80 | 814,117.94 |
| 减：二、费用 | | 7,278,753.98 | 23,230,418.36 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,793,819.35 | 12,056,518.23 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 632,303.20 | 2,009,419.68 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 2,648,259.19 | 8,939,670.74 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 204,372.24 | 224,809.71 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -213,753,715.91 | 532,232,255.61 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -213,753,715.91 | 532,232,255.61 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016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） | 698,133,991.62 | 4,856,670.58 | 702,990,662.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -213,753,715.91 | -213,753,715.91 |
| 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） | 27,253,147.28 | -9,011,728.42 | 18,241,418.86 |

| | | | |
|--|---------------------------------|-----------------|-------------------|
| 其中：1.基金申购款 | 136,170,535.88 | -41,508,368.28 | 94,662,167.60 |
| 2.基金赎回款 | -108,917,388.60 | 32,496,639.86 | -76,420,748.74 |
| 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） | 725,387,138.90 | -217,908,773.75 | 507,478,365.15 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 2,190,179,350.59 | -343,416,908.63 | 1,846,762,441.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 532,232,255.61 | 532,232,255.61 |
| 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） | -1,345,283,130.40 | -102,575,566.43 | -1,447,858,696.83 |
| 其中：1.基金申购款 | 383,486,381.24 | 13,815,493.95 | 397,301,875.19 |
| 2.基金赎回款 | -1,728,769,511.64 | -116,391,060.38 | -1,845,160,572.02 |
| 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） | 844,896,220.19 | 86,239,780.55 | 931,136,000.74 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中海分红增利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）原名国联分红增利混合型证券投资基金，由国联基金管理有限公司（现已更名为“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

证监基金字【2005】67号《关于同意国联分红增利混合型证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会2006年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定，并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号“关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复”批准，名称变更为中海基金管理有限公司；另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过，并经各基金托管人同意及中国证券监督管理委员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原“国联分红增利混合型证券投资基金”更名为“中海分红增利混合型证券投资基金”。

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，基金托管人为中国农业银行；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2005年6月16日生效，该日的基金份额总额为603,405,465.83份。

本基金主要投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司所发行的股票。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的80%。本基金投资组合的资产配置比例为：股票的投资比例为35%-95%；债券及现金的投资比例为5%-65%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金业绩比较基准为：上证红利指数*70%+上证国债指数*25%+银行一年期定期存款利率*5%。

6.4.2 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》、《中海分红增利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

6.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

6.4.6.1

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。

6.4.6.2

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。

6.4.6.3

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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

6.4.6.4

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 71,153,306.56 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 71,153,306.56 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | |
|---------------|-------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 439,918,970.84 | 438,606,325.14 | -1,312,645.70 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 439,918,970.84 | 438,606,325.14 | -1,312,645.70 |

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 11,063.65 |
| 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 | 319.14 |
| 应收债券利息 | - |
| 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 | 227.25 |
| 合计 | 11,610.04 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 283,936.28 |
| 银行间市场应付交易费用 | 800.00 |
| 合计 | 284,736.28 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 1,250,000.00 |
| 应付赎回费 | 3,789.83 |
| 预提费用 | 193,931.92 |
| 应付上海股票税金 | 12,800.00 |
| 其他 | 151,103.82 |
| 合计 | 1,611,625.57 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 698,133,991.62 | 698,133,991.62 |
| 本期申购 | 136,170,535.88 | 136,170,535.88 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -108,917,388.60 | -108,917,388.60 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 725,387,138.90 | 725,387,138.90 |

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

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 |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 87,171,791.25 | -82,315,120.67 | 4,856,670.58 |
| 本期利润 | -44,902,239.66 | -168,851,476.25 | -213,753,715.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,229,568.54 | -12,241,296.96 | -9,011,728.42 |
| 其中：基金申购款 | 13,527,025.99 | -55,035,394.27 | -41,508,368.28 |
| 基金赎回款 | -10,297,457.45 | 42,794,097.31 | 32,496,639.86 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 45,499,120.13 | -263,407,893.88 | -217,908,773.75 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 220,969.26 |
| 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 | 18,918.68 |
| 其他 | 10,024.81 |
| 合计 | 249,912.75 |

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 898,404,748.20 |
| 减：卖出股票成本总额 | 937,415,289.52 |
| 买卖股票差价收入 | -39,010,541.32 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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收益—其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,025,999.34 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,025,999.34 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -168,851,476.25 |
| ——股票投资 | -168,851,476.25 |
| ——债券投资 | - |
| ——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 | -168,851,476.25 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 80,326.24 |
| 转出基金补偿收入 | 6,478.56 |
| 合计 | 86,804.80 |

注：根据《中海分红增利混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的25%归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,648,259.19 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 2,648,259.19 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 银行费用 | 4,440.32 |

| | |
|-------|------------|
| 帐户服务费 | 6,000.00 |
| 合计 | 204,372.24 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构 |
| 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 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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 | 120,389,712.11 | 6.77% | 1,130,053,367.57 | 20.24% |

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016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 | 112,117.70 | 7.04% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 1,028,795.72 | 21.24% | 549,187.29 | 24.59% |

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,793,819.35 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 842,817.79 | 2,203,517.84 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 | 632,303.20 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2005 年 6 月 16 日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 15,332,480.00 | 75,332,480.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 15,332,480.00 | 75,332,480.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 2.1100% | 8.9200% |

注：本基金已按照招募说明书上列示的费率对基金管理人收取了基金投资的相关费用

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------------|---------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 71,153,306.56 | 220,969.26 | 46,451,104.94 | 245,266.62 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金在本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016年6月24日 | 2016年7月6日 | 新股流通受限 | 12.98 | 12.98 | 3,944 | 51,193.12 | 51,193.12 | - |
| 603016 | 新宏泰 | 2016年6月23日 | 2016年7月1日 | 新股流通受限 | 8.49 | 8.49 | 1,602 | 13,600.98 | 13,600.98 | - |
| 300520 | 科大国创 | 2016年6月30日 | 2016年7月8日 | 新股流通受限 | 10.05 | 10.05 | 926 | 9,306.30 | 9,306.30 | - |
| 002805 | 丰元股份 | 2016年6月29日 | 2016年7月7日 | 新股流通受限 | 5.80 | 5.80 | 971 | 5,631.80 | 5,631.80 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|---------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600576 | 万家文化 | 2016年4月11日 | 重大事项停牌 | 21.77 | - | - | 633,500 | 14,658,222.94 | 13,791,295.00 | - |
| 300299 | 富春通信 | 2016年2月29日 | 重大事项停牌 | 31.53 | - | - | 348,900 | 13,501,236.50 | 11,000,817.00 | - |
| 002587 | 奥拓电子 | 2016年4月 | 重大事项 | 14.45 | 2016年7月 | 14.00 | 651,400 | 7,853,073.40 | 9,412,730.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|--------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| | | 19 日 | 停牌 | | 28 日 | | | | | |
| 002632 | 道明光学 | 2016 年 6 月 22 日 | 重大事项停牌 | 11.98 | - | - | 780,080 | 9,742,251.28 | 9,345,358.40 | - |
| 600358 | 国旅联合 | 2016 年 4 月 5 日 | 重大事项停牌 | 13.50 | 2016 年 8 月 5 日 | 12.57 | 592,900 | 7,752,782.00 | 8,004,150.00 | - |
| 000638 | 万方发展 | 2016 年 1 月 5 日 | 重大事项停牌 | 23.68 | 2016 年 7 月 25 日 | 24.75 | 231,515 | 6,618,896.30 | 5,482,275.20 | - |
| 000002 | 万科 A | 2015 年 12 月 18 日 | 重大事项停牌 | 24.43 | 2016 年 7 月 4 日 | 21.99 | 6,200 | 112,096.00 | 151,466.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风控稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行

存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------|-------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 71,153,306.56 | - | - | - | - | - | 71,153,306.56 |
| 结算备付金 | 787,908.96 | - | - | - | - | - | 787,908.96 |
| 存出保证金 | 561,006.20 | - | - | - | - | - | 561,006.20 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 438,606,325.14 | 438,606,325.14 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 11,610.04 | 11,610.04 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 77,307.80 | 77,307.80 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 72,502,221.72 | - | - | - | - | 438,695,242.98 | 511,197,464.70 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,538.50 | 2,538.50 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,097,751.77 | 1,097,751.77 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 619,240.67 | 619,240.67 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 103,206.76 | 103,206.76 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 284,736.28 | 284,736.28 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,611,625.57 | 1,611,625.57 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 3,719,099.55 | 3,719,099.55 |
| 利率敏感度缺口 | 72,502,221.72 | - | - | - | - | 434,976,143.43 | 507,478,365.15 |
| 上年度末 2015年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 42,939,134.41 | - | - | - | - | - | 42,939,134.41 |

| | | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---|-----------------|----------------|
| 结算备付金 | 3,080,536.52 | - | - | - | - | 3,080,536.52 |
| 存出保证金 | 1,310,672.12 | - | - | - | - | 1,310,672.12 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | -662,963,019.61 | 662,963,019.61 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | -20,800,351.12 | 20,800,351.12 |
| 应收利息 | - | - | - | - | -10,775.73 | 10,775.73 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | -81,859.50 | 81,859.50 |
| 资产总计 | 47,330,343.05 | - | - | - | -683,856,005.96 | 731,186,349.01 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | -22,587,783.87 | 22,587,783.87 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | -1,145,593.19 | 1,145,593.19 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | -904,965.79 | 904,965.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | -150,827.64 | 150,827.64 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | -1,900,394.35 | 1,900,394.35 |
| 其他负债 | - | - | - | - | -1,506,121.97 | 1,506,121.97 |
| 负债总计 | - | - | - | - | -28,195,686.81 | 28,195,686.81 |
| 利率敏感度缺口 | 47,330,343.05 | - | - | - | -655,660,319.15 | 702,990,662.20 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2016 年 6 月 30 日） | 上年度末（2015 年 12 月 31 日） |
| | 利率下降 25 个基点 | 0.00 | 0.00 |
| | 利率上升 25 个基点 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 35-95%，债券和现金的投资比例为 5-65%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 438,606,325.14 | 86.43 | 662,963,019.61 | 94.31 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 438,606,325.14 | 86.43 | 662,963,019.61 | 94.31 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|----|--|
| 假设 | 测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。 |
| | 假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。 |
| | Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。 |
| | 假定市场无风险利率为一年定期存款利率。 |

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|-----|----------------|-----------------------------|-------------------|
| | | 本期末（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | +5% | 33,235,835.46 | 35,705,995.16 |
| -5% | -33,235,835.46 | -35,705,995.16 | |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

| | | | |
|----|--|-----------------|-------------------|
| 假设 | 假定基金收益率的分布服从正态分布。 | | |
| | 根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。 | | |
| | 以 95% 的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值（不足 100 个交易日不予计算）。 | | |
| 分析 | 风险价值 | 本期末（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 收益率绝对 VaR(%) | 4.09 | 4.97 |

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 438,606,325.14 | 85.80 |
| | 其中：股票 | 438,606,325.14 | 85.80 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 71,941,215.52 | 14.07 |
| 7 | 其他各项资产 | 649,924.04 | 0.13 |
| 8 | 合计 | 511,197,464.70 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 218,943,993.69 | 43.14 |
| 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 | 32,879,383.20 | 6.48 |
| 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 | 95,441,273.97 | 18.81 |
| J | 金融业 | 41,055,308.10 | 8.09 |
| K | 房地产业 | 21,185,620.46 | 4.17 |
| L | 租赁和商务服务业 | 19,846,905.87 | 3.91 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 136,807.85 | 0.03 |
| 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 | 9,117,032.00 | 1.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 438,606,325.14 | 86.43 |

7.3 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

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 | 002284 | 亚太股份 | 1,004,000 | 19,166,360.00 | 3.78 |
| 2 | 002273 | 水晶光电 | 666,600 | 18,658,134.00 | 3.68 |
| 3 | 600855 | 航天长峰 | 491,500 | 15,383,950.00 | 3.03 |
| 4 | 002797 | 第一创业 | 352,810 | 14,257,052.10 | 2.81 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|---------------|------|
| 5 | 300386 | 飞天诚信 | 427,700 | 14,186,809.00 | 2.80 |
| 6 | 000988 | 华工科技 | 705,400 | 14,143,270.00 | 2.79 |
| 7 | 600576 | 万家文化 | 633,500 | 13,791,295.00 | 2.72 |
| 8 | 600682 | XD 南京新 | 477,900 | 13,605,813.00 | 2.68 |
| 9 | 002673 | 西部证券 | 524,800 | 13,571,328.00 | 2.67 |
| 10 | 002276 | 万马股份 | 673,100 | 13,334,111.00 | 2.63 |
| 11 | 601198 | 东兴证券 | 541,200 | 13,226,928.00 | 2.61 |
| 12 | 002036 | 联创电子 | 564,900 | 13,224,309.00 | 2.61 |
| 13 | 002635 | 安洁科技 | 341,000 | 13,087,580.00 | 2.58 |
| 14 | 300222 | 科大智能 | 469,675 | 12,864,398.25 | 2.53 |
| 15 | 000050 | 深天马 A | 601,200 | 12,547,044.00 | 2.47 |
| 16 | 300098 | 高新兴 | 783,100 | 12,435,628.00 | 2.45 |
| 17 | 300078 | 思创医惠 | 366,527 | 12,256,662.88 | 2.42 |
| 18 | 603118 | 共进股份 | 297,630 | 12,110,564.70 | 2.39 |
| 19 | 300302 | 同有科技 | 371,494 | 12,062,410.18 | 2.38 |
| 20 | 002188 | 巴士在线 | 409,359 | 11,842,755.87 | 2.33 |
| 21 | 600730 | 中国高科 | 807,472 | 11,409,579.36 | 2.25 |
| 22 | 300299 | 富春通信 | 348,900 | 11,000,817.00 | 2.17 |
| 23 | 300459 | 浙江金科 | 337,600 | 9,962,576.00 | 1.96 |
| 24 | 600756 | 浪潮软件 | 327,608 | 9,861,000.80 | 1.94 |
| 25 | 000567 | 海德股份 | 304,094 | 9,624,575.10 | 1.90 |
| 26 | 002395 | 双象股份 | 351,928 | 9,579,480.16 | 1.89 |
| 27 | 002587 | 奥拓电子 | 651,400 | 9,412,730.00 | 1.85 |
| 28 | 002632 | 道明光学 | 780,080 | 9,345,358.40 | 1.84 |
| 29 | 600763 | 通策医疗 | 292,400 | 9,117,032.00 | 1.80 |
| 30 | 600198 | 大唐电信 | 452,300 | 8,991,724.00 | 1.77 |
| 31 | 300047 | 天源迪科 | 420,900 | 8,396,955.00 | 1.65 |
| 32 | 002368 | 太极股份 | 236,023 | 8,385,897.19 | 1.65 |
| 33 | 600358 | 国旅联合 | 592,900 | 8,004,150.00 | 1.58 |
| 34 | 002655 | 共达电声 | 460,900 | 7,443,535.00 | 1.47 |
| 35 | 300036 | 超图软件 | 292,400 | 7,163,800.00 | 1.41 |
| 36 | 300065 | 海兰信 | 166,100 | 6,424,748.00 | 1.27 |
| 37 | 002405 | 四维图新 | 241,950 | 5,951,970.00 | 1.17 |
| 38 | 300017 | 网宿科技 | 88,177 | 5,925,494.40 | 1.17 |
| 39 | 000638 | 万方发展 | 231,515 | 5,482,275.20 | 1.08 |
| 40 | 300516 | 久之洋 | 1,473 | 258,025.41 | 0.05 |
| 41 | 300512 | 中亚股份 | 1,873 | 187,150.16 | 0.04 |
| 42 | 603737 | 三棵树 | 1,327 | 154,038.16 | 0.03 |
| 43 | 000002 | 万 科 A | 6,200 | 151,466.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 44 | 603959 | 百利科技 | 2,815 | 116,681.75 | 0.02 |
| 45 | 002798 | 帝王洁具 | 1,056 | 91,555.20 | 0.02 |
| 46 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.02 |
| 47 | 300515 | 三德科技 | 1,355 | 63,508.85 | 0.01 |
| 48 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.01 |
| 49 | 601966 | 玲珑轮胎 | 3,944 | 51,193.12 | 0.01 |
| 50 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.01 |
| 51 | 603958 | 哈森股份 | 2,372 | 34,394.00 | 0.01 |
| 52 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629 | 24,565.32 | 0.00 |
| 53 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.00 |
| 54 | 603016 | 新宏泰 | 1,602 | 13,600.98 | 0.00 |
| 55 | 300520 | 科大国创 | 926 | 9,306.30 | 0.00 |
| 56 | 002805 | 丰元股份 | 971 | 5,631.80 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 002615 | 哈尔斯 | 44,238,517.07 | 6.29 |
| 2 | 600633 | 浙报传媒 | 27,530,900.86 | 3.92 |
| 3 | 002368 | 太极股份 | 21,384,390.51 | 3.04 |
| 4 | 600756 | 浪潮软件 | 20,649,739.94 | 2.94 |
| 5 | 000933 | *ST 神火 | 19,940,451.42 | 2.84 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 18,274,646.52 | 2.60 |
| 7 | 300148 | 天舟文化 | 18,021,167.40 | 2.56 |
| 8 | 002284 | 亚太股份 | 17,998,270.56 | 2.56 |
| 9 | 000988 | 华工科技 | 17,036,669.42 | 2.42 |
| 10 | 002797 | 第一创业 | 15,539,589.92 | 2.21 |
| 11 | 000888 | 峨眉山 A | 15,305,308.14 | 2.18 |
| 12 | 600855 | 航天长峰 | 14,554,099.28 | 2.07 |
| 13 | 600138 | 中青旅 | 14,531,311.15 | 2.07 |
| 14 | 002276 | 万马股份 | 14,517,482.20 | 2.07 |
| 15 | 300459 | 浙江金科 | 12,928,043.80 | 1.84 |
| 16 | 002174 | 游族网络 | 12,896,061.95 | 1.83 |
| 17 | 300302 | 同有科技 | 12,856,128.00 | 1.83 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 601198 | 东兴证券 | 12,496,740.00 | 1.78 |
| 19 | 002673 | 西部证券 | 12,496,386.52 | 1.78 |
| 20 | 300098 | 高新兴 | 12,487,534.64 | 1.78 |

注：本报告期内，累计买入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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 600836 | 界龙实业 | 50,551,419.54 | 7.19 |
| 2 | 600754 | 锦江股份 | 50,281,007.61 | 7.15 |
| 3 | 002615 | 哈尔斯 | 47,539,854.04 | 6.76 |
| 4 | 002699 | 美盛文化 | 46,317,136.72 | 6.59 |
| 5 | 600630 | 龙头股份 | 30,850,417.02 | 4.39 |
| 6 | 600650 | 锦江投资 | 27,734,585.68 | 3.95 |
| 7 | 601198 | 东兴证券 | 27,669,016.37 | 3.94 |
| 8 | 002466 | 天齐锂业 | 27,009,670.00 | 3.84 |
| 9 | 600633 | 浙报传媒 | 23,663,157.00 | 3.37 |
| 10 | 002086 | 东方海洋 | 18,002,229.28 | 2.56 |
| 11 | 000933 | *ST 神火 | 17,884,799.33 | 2.54 |
| 12 | 300148 | 天舟文化 | 17,091,541.02 | 2.43 |
| 13 | 002123 | 荣信股份 | 15,081,139.20 | 2.15 |
| 14 | 600138 | 中青旅 | 14,399,130.00 | 2.05 |
| 15 | 000888 | 峨眉山 A | 14,096,918.32 | 2.01 |
| 16 | 300458 | 全志科技 | 13,984,830.72 | 1.99 |
| 17 | 300263 | 隆华节能 | 13,252,030.27 | 1.89 |
| 18 | 002425 | 凯撒股份 | 12,385,679.72 | 1.76 |
| 19 | 002172 | 澳洋科技 | 11,200,057.41 | 1.59 |
| 20 | 002174 | 游族网络 | 10,836,056.36 | 1.54 |

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

7.4.3 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 | 881,910,071.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 898,404,748.20 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 561,006.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,610.04 |
| 5 | 应收申购款 | 77,307.80 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 649,924.04 |

7.12.4 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债。

7.12.5 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 | 600576 | 万家文化 | 13,791,295.00 | 2.72 | 重大事项停牌 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 41,732 | 17,382.04 | 32,452,309.34 | 4.47% | 692,934,829.56 | 95.53% |

8.2 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 | 3,920.87 | 0.0005% |

8.3 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 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2005年6月16日）基金份额总额 | 603,405,465.83 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 698,133,991.62 |
| 本报告期基金总申购份额 | 136,170,535.88 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 108,917,388.60 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 725,387,138.90 |

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 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、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 平安证券 | 1 | 399,282,153.52 | 22.44% | 371,851.85 | 23.36% | - |
| 银河证券 | 2 | 370,950,417.11 | 20.85% | 345,466.41 | 21.70% | - |
| 东兴证券 | 1 | 256,160,610.36 | 14.40% | 238,562.71 | 14.98% | - |
| 华创证券 | 2 | 185,161,660.45 | 10.41% | 143,700.94 | 9.03% | - |
| 浙商证券 | 1 | 180,727,819.52 | 10.16% | 132,166.17 | 8.30% | - |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 国联证券 | 1 | 120,389,712.11 | 6.77% | 112,117.70 | 7.04% | - |
| 国信证券 | 1 | 70,241,603.06 | 3.95% | 65,415.82 | 4.11% | - |
| 兴业证券 | 2 | 67,704,960.46 | 3.81% | 63,053.90 | 3.96% | - |
| 民生证券 | 2 | 59,572,796.00 | 3.35% | 55,479.87 | 3.48% | - |
| 中泰证券 | 1 | 35,795,163.09 | 2.01% | 33,335.76 | 2.09% | - |
| 国金证券 | 1 | 33,152,760.57 | 1.86% | 30,874.25 | 1.94% | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | 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、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。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：本报告期内新增了渤海证券、长城证券、浙商证券、西南证券、兴业证券、东北证券的深圳交易单元。退租了中信证券的上海交易单元。

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：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。

10.7.2 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 |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | 110,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------------|------------|
| 1 | 中海分红增利混合型证券投资基金年度最后一日净值公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月1日 |
| 2 | 中海基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月4日 |
| 3 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月5日 |
| 4 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰科技服务（深圳）前海有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月6日 |
| 5 | 中海基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月6日 |
| 6 | 中海基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月7日 |
| 7 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增上海联泰资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月15日 |
| 8 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月16日 |
| 9 | 中海分红增利混合型证券投资基金2015年第4季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年1月22日 |

| | | | |
|----|--|------------------|-----------------|
| 10 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 1 月 27 日 |
| 11 | 中海分红增利混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 年第 1 号） | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 1 月 29 日 |
| 12 | 中海分红增利混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号） | 中海基金网站 | 2016 年 1 月 29 日 |
| 13 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 2 月 18 日 |
| 14 | 中海基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 2 月 19 日 |
| 15 | 关于中海基金网上直销调整“e 通宝”认购、申购、定投优惠费率的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 22 日 |
| 16 | 中海分红增利混合型证券投资基金 2015 年年度报告 | 中海基金网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 17 | 中海分红增利混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 18 | 中海基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 29 日 |
| 19 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 30 日 |

| | | | |
|----|--|------------------|-----------------|
| 20 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 3 月 30 日 |
| 21 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 6 日 |
| 22 | 中海基金管理有限公司关于调整网上直销系统招商银行网银支付费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 8 日 |
| 23 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增中经北证（北京）资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 13 日 |
| 24 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 15 日 |
| 25 | 中海分红增利混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 21 日 |
| 26 | 中海基金管理有限公司关于支付宝基金支付业务下线的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 28 日 |
| 27 | 中海基金管理有限公司关于官方淘宝店停止认、申购业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 4 月 28 日 |
| 28 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京展恒基金销售股份有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 5 月 5 日 |
| 29 | 中海基金管理有限公司关于旗下 | 中国证券报、上海证 | 2016 年 5 月 11 日 |

| | | | |
|----|--|------------------|------------|
| | 部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 券报、证券时报 | |
| 30 | 中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年5月19日 |
| 31 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年5月30日 |
| 32 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京广源达信投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年6月8日 |
| 33 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年6月8日 |
| 34 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广投资管理有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年6月15日 |
| 35 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016年6月15日 |

| | | | |
|----|--|------------------|-----------------|
| 36 | 中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 6 月 24 日 |
| 37 | 中海基金管理有限公司关于旗下基金参与京东基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2016 年 6 月 28 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海分红增利混合型证券投资基金的文件
- 2、中海分红增利混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海分红增利混合型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准国联基金管理有限公司更名为中海基金管理有限公司的文件
- 5、中海分红增利混合型证券投资基金证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

11.3 查阅方式

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。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日