

中海合鑫灵活配置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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)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.....	7
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.....	12
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.....	12
§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	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39

7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
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.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
§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.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中海合鑫混合
基金主代码	001005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 11 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	97,871,938.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的资产配置和策略精选个股，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业精选策略</p> <p>本基金主要从宏观经济周期和行业生命周期两个层次来分析不同行业的周期性属性。本基金基于“投资时钟理论”对宏观经济周期进行分析，将宏观经济周期分解为复苏、过热、滞胀和衰退四个阶段，根据不同行业在宏观经济周期各阶段的表现进行最优配置。本基金还将根据行业本身的生命周期分析，将行业生命周期分为创始期、成长期、成熟期和收缩期四个阶段，本基金重点加强对成长期行业和成熟期行业的配置。本基金将采用宏观经济周期分析为主，兼顾行业生命周期分析的最优选择进行行业精选。</p> <p>（2）股票精选策略</p> <p>本基金对精选行业内的个股选择将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>1) 定量方式</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具</p>

	<p>有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>2) 定性方式</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而下的资产配置。利用宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置。</p> <p>(2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。</p> <p>(3) 债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。</p> <p>本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+5%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，

	高于债券型基金和货币市场基金。
--	-----------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	张燕
	联系电话	021-38429808	0755-8319 9084
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9788、 021-38789788	95555
传真		021-68419525	0755-8319 5201
注册地址		上海市浦东新区银城中路 68号2905-2908室及30层	深圳深南大道7088号招商银行 大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68号2905-2908室及30层	深圳深南大道7088号招商银行 大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		黄鹏	李建红

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
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	-19,167,308.03
本期利润	-20,714,164.28

加权平均基金份额本期利润	-0.1952
本期加权平均净值利润率	-29.81%
本期基金份额净值增长率	-26.16%
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	-32,747,970.81
期末可供分配基金份额利润	-0.3346
期末基金资产净值	65,487,040.55
期末基金份额净值	0.669
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	-33.10%

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

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	4.37%	1.47%	0.49%	0.02%	3.88%	1.45%
过去三个月	4.53%	1.31%	1.50%	0.02%	3.03%	1.29%
过去六个月	-26.16%	2.20%	3.05%	0.02%	-29.21%	2.18%
过去一年	-39.62%	2.75%	6.45%	0.02%	-46.07%	2.73%
自基金合同生效起至今	-33.10%	2.62%	9.49%	0.02%	-42.59%	2.60%

注：“自基金合同生效起至今”指2015年2月11日(基金合同生效日)至2016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

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



注：按相关法规规定，本基金自基金合同 2015 年 2 月 11 日生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
许定晴	代理投资总监、投资副总监、本基金基金经理	2015年4月8日	-	13年	许定晴女士，苏州大学金融学专业硕士。曾任国联证券股份有限公司研究员。2004年3月进入本公司工作，历任分析师、高级分析师、基金经理助理、研究总监，现任代理投资总监、投资副总监。2010年3月至2012年7月任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2011年12月至2015年4月任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2015年4月至今任中海合鑫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。

注 3：许定晴女士于 7 月 29 日离任本基金基金经理，夏春晖先生于 7 月 29 日任本基金基金经理。

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，人民币汇率波动加大，工业增速在年初创出新低。而货币政策超增使得房地产和基建投资随后出现明显改善，经济企稳，1、2 季度 GDP 增速皆维持在 6.7%。海外市场，美国对加息的纠结时刻影响投资者情绪，而英国脱欧则成为最大黑天鹅事件。

股市在年初熔断机制正式实施起出现数次熔断，指数呈现巨幅调整，随后横盘震荡。期中新能源汽车板块、电子板块以及部分周期板块受到投资者追捧。本基金在年初熔断期间受到较大影响，行业配置主要集中在供给侧改革受益行业以及产品价格回升的行业。

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 0.669 元（累计净值 0.669 元）。报告期内本基金净值增长率为-26.16%，低于业绩比较基准 29.21 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

国内经济虽然短期企稳，但地产销量增速见顶回落，制造业与民间投资均现负增长，皆预示下半年经济依然承压。海外市场来看，英国脱欧影响尚未结束，地缘事件频起，全球处于格局重塑期，不稳定因素较多。下半年投资方面，我们将重点关注供给侧改革收益板块。目前来看国内宏观调控思路转向供给侧管理，既是当前经济困境下的主动求变，也是产能严重过剩背景下的选择。中央多次强调以“壮士断腕”的决心去产能，预计政策力度将持续超出市场预期。同时在全球开启黑天鹅模式，英国脱欧影响尚未结束，地缘政治不稳定的情形下，我们还将重点关注受益避险需求的贵金属板块以及军工板块。而下半年在整体风险偏好下降的过程中，具有安全边际的

价值成长股也将是我们关注的重点。整体而言，下半年我们将谨慎操作。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、

准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中海合鑫灵活配置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	22,313,997.83	4,446,090.51
结算备付金		463,662.74	502,713.09
存出保证金		108,389.49	232,740.55
交易性金融资产	6.4.7.2	39,812,880.65	76,469,680.67
其中：股票投资		39,812,880.65	76,469,680.67
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		3,684,316.83	2,090,520.72
应收利息	6.4.7.5	3,245.32	1,522.93
应收股利		-	-
应收申购款		54,199.68	811,676.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		66,440,692.54	84,554,944.54
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		-	1,635,776.29
应付赎回款		502,979.73	12,851.95
应付管理人报酬		85,549.25	103,524.80
应付托管费		14,258.22	17,254.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	220,953.74	286,338.09

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	129,911.05	60,006.87
负债合计		953,651.99	2,115,752.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	97,871,938.97	91,010,852.11
未分配利润	6.4.7.10	-32,384,898.42	-8,571,659.70
所有者权益合计		65,487,040.55	82,439,192.41
负债和所有者权益总计		66,440,692.54	84,554,944.54

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.669 元，基金份额总额 97,871,938.97 份。

6.2 利润表

会计主体：中海合鑫灵活配置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 2 月 11 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-19,204,901.85	94,417,642.11
1.利息收入		73,948.52	1,255,940.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	73,948.52	820,418.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	435,522.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,996,836.43	94,603,171.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-18,192,607.14	93,751,450.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	195,770.71	851,720.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,546,856.25	-3,263,649.39
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	264,842.31	1,822,179.67
减：二、费用		1,509,262.43	5,942,578.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	517,565.89	3,000,089.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,261.03	500,014.87

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	763, 118. 39	2, 281, 821. 18
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	142, 317. 12	160, 653. 04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20, 714, 164. 28	88, 475, 063. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20, 714, 164. 28	88, 475, 063. 78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海合鑫灵活配置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）	91, 010, 852. 11	-8, 571, 659. 70	82, 439, 192. 41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20, 714, 164. 28	-20, 714, 164. 28
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）	6, 861, 086. 86	-3, 099, 074. 44	3, 762, 012. 42
其中：1. 基金申购款	76, 529, 025. 48	-27, 434, 616. 63	49, 094, 408. 85
2. 基金赎回款	-69, 667, 938. 62	24, 335, 542. 19	-45, 332, 396. 43
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）	97, 871, 938. 97	-32, 384, 898. 42	65, 487, 040. 55
项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 11 日（基金合同生效日）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)	684,119,263.95	-	684,119,263.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	88,475,063.78	88,475,063.78
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)	-504,775,526.83	-69,029,454.79	-573,804,981.62
其中：1.基金申购款	10,038,742.09	2,948,054.18	12,986,796.27
2.基金赎回款	-514,814,268.92	-71,977,508.97	-586,791,777.89
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)	179,343,737.12	19,445,608.99	198,789,346.11

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：

<u>黄鹏</u>	<u>宋宇</u>	<u>周琳</u>
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

中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]6号《关于准予中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,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》和《中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币684,024,909.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第127号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为684,119,263.95份基金份额,其中认购资金利息折合94,354.95份基金份额。本基金的基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、可转债等)、资产支持证券以及法律

法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的配置比例为：投资于股票的比例占基金资产的 0-95%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)+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》、《中海合鑫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 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未发生重大会计差错。

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：

(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。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。

(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	22,313,997.83
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	22,313,997.83

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	37,554,808.18	39,812,880.65	2,258,072.47
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	37,554,808.18	39,812,880.65	2,258,072.47

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	2,987.92
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	208.70
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	48.70
合计	3,245.32

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	220,953.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	220,953.74

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	-
应付赎回费	623.71

预提费用	129,287.34
合计	129,911.05

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	91,010,852.11	91,010,852.11
本期申购	76,529,025.48	76,529,025.48
本期赎回(以“-”号填列)	-69,667,938.62	-69,667,938.62
- 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	97,871,938.97	97,871,938.97

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	-11,369,694.71	2,798,035.01	-8,571,659.70
本期利润	-19,167,308.03	-1,546,856.25	-20,714,164.28
本期基金份额交易产生的变动数	-2,210,968.07	-888,106.37	-3,099,074.44
其中：基金申购款	-26,296,230.25	-1,138,386.38	-27,434,616.63
基金赎回款	24,085,262.18	250,280.01	24,335,542.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-32,747,970.81	363,072.39	-32,384,898.42

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
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	3,732.16
其他	1,001.45

合计	73,948.52
----	-----------

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	294,313,404.87
减：卖出股票成本总额	312,506,012.01
买卖股票差价收入	-18,192,607.14

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	195,770.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	195,770.71

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	-1,546,856.25
——股票投资	-1,546,856.25
——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	-1,546,856.25

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	257,430.80
转出基金补偿收入	7,411.51

合计	264,842.31
----	------------

注：根据《中海合鑫灵活配置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	763,118.39
银行间市场交易费用	-
合计	763,118.39

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	29,835.26
信息披露费	99,452.08
银行费用	1,029.78
帐户服务费	12,000.00
合计	142,317.12

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
招商银行股份有限公司	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

注：本报告期及上年度可比期间本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

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均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均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均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

注：本报告期及上年度可比期间本基金均无应支付关联方的佣金。

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2月11日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	517,565.89	3,000,089.24
其中：支付销售机构的客户维护费	277,101.09	1,282,954.19

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2月11日(基金合同生效日)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
当期发生的基金应支付的托管费		86,261.03		500,014.87

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均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**

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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均未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年2月11日(基金合同生效日)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
招商银行	22,313,997.83	69,214.91	20,787,270.27	789,414.99

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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均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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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
600330	天通股份	2016年5月23日	重大事项停牌	15.89	-	-	106,300	1,460,617.00	1,689,107.00	-
002452	长高集团	2016年6月14日	重大事项停牌	12.02	2016年7月12日	10.82	110,000	1,372,129.00	1,322,200.00	-
300284	苏交科	2016年5月20日	重大事项停牌	19.49	2016年8月10日	21.44	9,376	188,889.49	182,738.24	-

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工商银行；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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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公司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

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人运用多种量化工具对基金市场风险进行定量测定与控制。

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	22,313,997.83	-	-	-	-	-	22,313,997.83
结算备付金	463,662.74	-	-	-	-	-	463,662.74
存出保证金	108,389.49	-	-	-	-	-	108,389.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	39,812,880.65	39,812,880.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,684,316.83	3,684,316.83
应收利息	-	-	-	-	-	3,245.32	3,245.32
应收申购款	-	-	-	-	-	54,199.68	54,199.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,886,050.06	-	-	-	-	43,554,642.48	66,440,692.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	502,979.73	502,979.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	85,549.25	85,549.25
应付托管费	-	-	-	-	-	14,258.22	14,258.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	220,953.74	220,953.74
其他负债	-	-	-	-	-	129,911.05	129,911.05
负债总计	-	-	-	-	-	953,651.99	953,651.99
利率敏感度缺口	22,886,050.06	-	-	-	-	42,600,990.49	65,487,040.55
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	4,446,090.51	-	-	-	-	-	4,446,090.51
结算备付金	502,713.09	-	-	-	-	-	502,713.09
存出保证金	232,740.55	-	-	-	-	-	232,740.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,469,680.67	76,469,680.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,090,520.72	2,090,520.72
应收利息	-	-	-	-	-	1,522.93	1,522.93
应收申购款	-	-	-	-	-	811,676.07	811,676.07
资产总计	5,181,544.15	-	-	-	-	79,373,400.39	84,554,944.54
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,635,776.29	1,635,776.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,851.95	12,851.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,524.80	103,524.80
应付托管费	-	-	-	-	-	17,254.13	17,254.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	286,338.09	286,338.09
其他负债	-	-	-	-	-	60,006.87	60,006.87
负债总计	-	-	-	-	-	2,115,752.13	2,115,752.13
利率敏感度缺口	5,181,544.15	-	-	-	-	-77,257,648.26	82,439,192.41

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

本基金没有持有外汇资产及负债，故汇率变化不会对本基金产生重大的影响。

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。本基金投资于股票的比例占基金资产的

0%-95%，本基金持有的现金或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	39,812,880.65	60.80	76,469,680.67	92.76
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	39,812,880.65	60.80	76,469,680.67	92.76

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%	2,049,091.19	3,866,050.78
	-5%	-2,049,091.19	-3,866,050.78

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(%)	2.83	4.46

§ 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	39,812,880.65	59.92
	其中：股票	39,812,880.65	59.92
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	22,777,660.57	34.28
7	其他各项资产	3,850,151.32	5.79
8	合计	66,440,692.54	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	17,955,253.34	27.42
C	制造业	16,344,200.89	24.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	20,920.00	0.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	323,004.38	0.49
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	4,986,763.80	7.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	182,738.24	0.28
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	39,812,880.65	60.80

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	600988	赤峰黄金	210,055	3,917,525.75	5.98
2	600547	山东黄金	84,749	3,297,583.59	5.04
3	601198	东兴证券	121,000	2,957,240.00	4.52
4	300011	鼎汉技术	123,464	2,897,700.08	4.42
5	002007	华兰生物	87,460	2,746,244.00	4.19
6	600395	盘江股份	325,500	2,688,630.00	4.11
7	000983	西山煤电	326,400	2,660,160.00	4.06
8	601069	西部黄金	109,300	2,536,853.00	3.87
9	002155	湖南黄金	163,700	2,155,929.00	3.29
10	601555	东吴证券	151,457	2,029,523.80	3.10
11	600521	华海药业	80,603	1,960,264.96	2.99
12	600330	天通股份	106,300	1,689,107.00	2.58
13	002284	亚太股份	70,700	1,349,663.00	2.06

14	002452	长高集团	110,000	1,322,200.00	2.02
15	600436	片仔癀	29,193	1,313,976.93	2.01
16	002664	信质电机	21,573	733,913.46	1.12
17	600259	广晟有色	12,200	698,572.00	1.07
18	000970	中科三环	47,837	694,114.87	1.06
19	600869	智慧能源	32,854	338,396.20	0.52
20	600006	东风汽车	37,514	332,749.18	0.51
21	002245	澳洋顺昌	25,294	323,004.38	0.49
22	600702	沱牌舍得	12,550	316,762.00	0.48
23	002339	积成电子	14,018	255,688.32	0.39
24	600110	诺德股份	20,764	204,317.76	0.31
25	300284	苏交科	9,376	182,738.24	0.28
26	000070	特发信息	4,230	110,910.60	0.17
27	002196	方正电机	2,287	78,192.53	0.12
28	601611	中国核建	1,000	20,920.00	0.03

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	600395	盘江股份	9,042,067.14	10.97
2	002458	益生股份	7,700,227.20	9.34
3	000983	西山煤电	7,287,146.00	8.84
4	600547	山东黄金	7,169,685.00	8.70
5	002234	民和股份	6,884,440.86	8.35
6	601069	西部黄金	6,800,490.02	8.25
7	600491	龙元建设	5,757,315.11	6.98
8	300284	苏交科	5,754,864.85	6.98
9	601555	东吴证券	5,675,105.69	6.88
10	002245	澳洋顺昌	5,016,462.85	6.09
11	000970	中科三环	5,011,805.00	6.08
12	600988	赤峰黄金	4,866,345.00	5.90
13	601198	东兴证券	4,723,642.14	5.73
14	300197	铁汉生态	4,656,441.98	5.65
15	000709	河钢股份	4,300,588.00	5.22

16	300401	花园生物	4,290,320.38	5.20
17	002502	骅威文化	3,865,776.00	4.69
18	300011	鼎汉技术	3,777,172.30	4.58
19	600521	华海药业	3,665,399.13	4.45
20	600570	恒生电子	3,660,832.00	4.44
21	600073	上海梅林	3,430,292.32	4.16
22	600348	阳泉煤业	3,412,978.18	4.14
23	600259	广晟有色	3,358,739.75	4.07
24	300078	思创医惠	3,239,599.00	3.93
25	300144	宋城演艺	3,192,212.00	3.87
26	000060	中金岭南	2,959,573.00	3.59
27	600068	葛洲坝	2,954,850.20	3.58
28	600000	浦发银行	2,917,670.54	3.54
29	601166	兴业银行	2,915,752.00	3.54
30	600188	兖州煤业	2,865,529.62	3.48
31	600685	中船防务	2,865,387.42	3.48
32	600702	沱牌舍得	2,846,356.00	3.45
33	002155	湖南黄金	2,829,398.00	3.43
34	600869	智慧能源	2,812,417.00	3.41
35	002339	积成电子	2,789,226.76	3.38
36	002196	方正电机	2,766,959.50	3.36
37	601012	隆基股份	2,727,818.87	3.31
38	600231	凌钢股份	2,707,834.92	3.28
39	000807	云铝股份	2,675,983.00	3.25
40	002007	华兰生物	2,666,217.64	3.23
41	600029	南方航空	2,641,375.72	3.20
42	002664	信质电机	2,592,114.00	3.14
43	300166	东方国信	2,549,026.76	3.09
44	600507	方大特钢	2,536,407.44	3.08
45	000703	恒逸石化	2,463,156.65	2.99
46	000001	平安银行	2,365,876.00	2.87
47	601118	海南橡胶	2,360,668.00	2.86
48	002200	云投生态	2,325,689.00	2.82
49	603010	万盛股份	2,238,134.20	2.71
50	600782	新钢股份	2,227,717.00	2.70
51	002456	欧菲光	2,201,245.50	2.67

52	002599	盛通股份	2,124,352.00	2.58
53	600136	当代明诚	2,079,954.66	2.52
54	000620	新华联	2,070,639.50	2.51
55	002546	新联电子	2,057,818.00	2.50
56	600436	片仔癀	2,035,089.50	2.47
57	600006	东风汽车	2,032,745.00	2.47
58	600110	诺德股份	2,002,850.00	2.43
59	002292	奥飞娱乐	1,970,561.00	2.39
60	002378	章源钨业	1,908,463.00	2.31
61	300294	博雅生物	1,898,515.00	2.30
62	600886	国投电力	1,873,470.00	2.27
63	000860	顺鑫农业	1,833,983.00	2.22
64	002714	牧原股份	1,820,802.00	2.21
65	600141	兴发集团	1,804,311.99	2.19
66	600057	象屿股份	1,801,704.00	2.19
67	600545	新疆城建	1,778,950.00	2.16
68	601699	潞安环能	1,758,980.20	2.13
69	002271	东方雨虹	1,735,986.32	2.11
70	002020	京新药业	1,679,056.70	2.04
71	000878	云南铜业	1,652,098.00	2.00

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	002458	益生股份	8,330,063.28	10.10
2	002234	民和股份	7,903,361.80	9.59
3	600491	龙元建设	6,183,854.22	7.50
4	300144	宋城演艺	5,945,430.57	7.21
5	300284	苏交科	5,548,934.33	6.73
6	600395	盘江股份	5,494,689.41	6.67
7	002245	澳洋顺昌	5,277,909.71	6.40
8	000970	中科三环	4,964,696.77	6.02
9	600547	山东黄金	4,511,815.64	5.47
10	300197	铁汉生态	4,494,630.66	5.45

11	000807	云铝股份	4,324,441.43	5.25
12	601555	东吴证券	4,147,402.22	5.03
13	000983	西山煤电	4,132,994.06	5.01
14	300401	花园生物	4,107,561.13	4.98
15	000060	中金岭南	4,000,132.67	4.85
16	002196	方正电机	3,934,492.61	4.77
17	600570	恒生电子	3,920,982.15	4.76
18	000709	河钢股份	3,876,148.29	4.70
19	600073	上海梅林	3,624,936.34	4.40
20	601069	西部黄金	3,578,210.00	4.34
21	000488	晨鸣纸业	3,507,818.01	4.26
22	002241	歌尔股份	3,430,743.08	4.16
23	002502	骅威文化	3,400,632.41	4.13
24	600068	葛洲坝	3,062,447.82	3.71
25	600136	当代明诚	3,047,774.56	3.70
26	002588	史丹利	3,032,299.28	3.68
27	600895	张江高科	3,010,999.43	3.65
28	601166	兴业银行	2,949,592.27	3.58
29	600348	阳泉煤业	2,946,014.56	3.57
30	600000	浦发银行	2,932,426.00	3.56
31	600869	智慧能源	2,859,143.90	3.47
32	600702	沱牌舍得	2,762,338.00	3.35
33	601012	隆基股份	2,744,320.20	3.33
34	002339	积成电子	2,628,755.63	3.19
35	600188	兖州煤业	2,627,963.06	3.19
36	600259	广晟有色	2,627,504.10	3.19
37	601336	新华保险	2,615,381.80	3.17
38	000703	恒逸石化	2,582,546.23	3.13
39	002345	潮宏基	2,568,473.08	3.12
40	300188	美亚柏科	2,540,850.30	3.08
41	000516	国际医学	2,533,956.31	3.07
42	600507	方大特钢	2,527,248.42	3.07
43	002445	中南文化	2,486,812.97	3.02
44	002200	云投生态	2,462,244.98	2.99
45	600783	鲁信创投	2,430,373.71	2.95
46	002664	信质电机	2,425,137.96	2.94
47	000001	平安银行	2,383,605.50	2.89
48	002456	欧菲光	2,380,513.83	2.89

49	603010	万盛股份	2,371,186.25	2.88
50	000620	新华联	2,334,071.73	2.83
51	300078	思创医惠	2,304,757.00	2.80
52	000700	模塑科技	2,284,382.77	2.77
53	600231	凌钢股份	2,263,900.00	2.75
54	600685	中船防务	2,225,758.17	2.70
55	002612	朗姿股份	2,205,767.30	2.68
56	601058	赛轮金宇	2,174,019.97	2.64
57	300109	新开源	2,135,415.10	2.59
58	600029	南方航空	2,106,419.64	2.56
59	603019	中科曙光	2,090,709.00	2.54
60	300166	东方国信	2,079,075.43	2.52
61	600110	诺德股份	2,068,543.46	2.51
62	601118	海南橡胶	2,044,799.92	2.48
63	002599	盛通股份	2,013,808.00	2.44
64	002271	东方雨虹	1,996,853.78	2.42
65	002546	新联电子	1,993,987.00	2.42
66	600782	新钢股份	1,987,840.00	2.41
67	002439	启明星辰	1,981,360.93	2.40
68	002717	岭南园林	1,955,700.00	2.37
69	002292	奥飞娱乐	1,940,659.07	2.35
70	600521	华海药业	1,926,140.27	2.34
71	000860	顺鑫农业	1,908,793.07	2.32
72	600886	国投电力	1,869,066.00	2.27
73	002714	牧原股份	1,821,432.50	2.21
74	600006	东风汽车	1,814,019.59	2.20
75	002378	章源钨业	1,808,729.01	2.19
76	300294	博雅生物	1,804,349.70	2.19
77	600545	新疆城建	1,761,169.90	2.14
78	002224	三力士	1,757,823.70	2.13
79	300291	华录百纳	1,747,904.45	2.12
80	600057	象屿股份	1,699,788.50	2.06
81	600855	航天长峰	1,684,329.00	2.04
82	300115	长盈精密	1,667,611.25	2.02
83	601699	潞安环能	1,667,443.55	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。

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	277,396,068.24
卖出股票收入（成交）总额	294,313,404.87

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。

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被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	108,389.49
2	应收证券清算款	3,684,316.83
3	应收股利	-
4	应收利息	3,245.32
5	应收申购款	54,199.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,850,151.32

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换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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 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
5,163	18,956.41	1,288,506.18	1.32%	96,583,432.79	98.68%

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	190,854.25	0.1950%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月11日）基金份额总额	684,119,263.95
本报告期期初基金份额总额	91,010,852.11
本报告期基金总申购份额	76,529,025.48
减：本报告期基金总赎回份额	69,667,938.62
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	97,871,938.97

§ 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，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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	
兴业证券	2	571,706,003.11	100.00%	418,089.03	100.00%	-
东方证券	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。

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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

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	中海合鑫灵活配置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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016 年 1 月 6 日

	基金转换及定期定额投资业务的公告		
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8日
8	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
9	中海合鑫灵活配置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
11	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
12	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中泰证券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2月19日
13	关于中海基金网上直销调整“e	中国证券报、上海证	2016年3月22日

	通宝”认购、申购、定投优惠费率的公告	券报、证券时报	
14	中海合鑫灵活配置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
15	中海合鑫灵活配置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
16	中海合鑫灵活配置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 3 月 26 日
17	中海合鑫灵活配置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 3 月 26 日
18	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
19	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
20	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
21	中海合鑫灵活配置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
22	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
23	中海基金管理有限公司关于官方	中国证券报、上海证	2016 年 4 月 28 日

	淘宝店停止认、申购业务的公告	券报、证券时报	
24	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
25	中海基金管理有限公司关于旗下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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年5月11日
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016年6月15日

	(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		
31	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6月23日
32	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、中国证监会准予注册募集中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金的文件
- 2、中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金合同
- 3、中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

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