

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券  
投资基金  
2016 年年度报告 摘要

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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 2017 年 3 月 24 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 2016 年 4 月 28 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 中海沪港深价值优选混合      |
| 基金主代码      | 002214           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 4 月 28 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 | 171,057,867.76 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过对国家政策导向以及行业发展趋势的研究，在沪深港三地证券市场中优选出具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严格控制投资组合风险的前提下力争获得超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 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>本基金将在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和港股两地股票配置比例及投资策略：</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>本基金对于国内 A 股选择将采用自上而下的分析方法，在行业发展趋势中选择具有优势的上市公司进行投资。</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。</p> <p>本基金基于“投资时钟理论”对宏观经济周期进行分析，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，重点加强对成长期行业和成熟期行业的配置。</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</p> |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>进行投资。</p> <p>①定量方式<br/>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，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>②定性方式<br/>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>(2) 港股投资策略<br/>本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。<br/>本基金主要采用自上而下、重点挑选最符合国家产业政策和行业发展方向的主题，然后自下而上、精选个股的投资策略，重点投资于受益于经济结构转型及相关主题且具备估值优势的股票。</p> <p>1) 主题及行业发掘<br/>本基金通过投资研究团队持续关注政府财政及货币政策等宏观经济因素、产业振兴计划等政府政策导向来发掘具有以下特性的行业：具有长期可持续增长模式/享有强劲的长期增长；具有高进入壁垒和健康的竞争格局；受益于政策支持；新兴行业以及有升级潜力的行业；具有催化剂的行业。</p> <p>2) 股票精选策略<br/>对上市公司进行系统性分析，其中主要关注：<br/>①采用预期市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)及企业价值倍数(EV/EBITDA)等方法优选出财务透明稳健、管理出色且成长性较好的个股。<br/>②低估值、相对于A股折价或股价没有充分反映投资价值的、具有持续竞争优势的企业。<br/>③相对于A股较为稀缺或具有独特投资属性的公司。<br/>④符合国家战略导向、具备高成长性的企业。<br/>⑤具有股价催化剂、具有估值重估潜力的股票。</p> <p>3、债券投资策略<br/>(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。<br/>(2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。<br/>(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>个券选择：基于各个投资品种具体情况，自下而上的资产配置。</p> <p>个券选择应遵循如下原则：</p> <p>相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低品种。</p> <p>流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。</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 | 沪深 300 指数 X45%+恒生指数 X45%+中证全债指数 X10%  |
| 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                    | 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、<br>021-38789788 | 95599              |
| 传真      |      | 021-68419525                  | 010-68121816       |

### 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 | 2016 年 4 月 28 日<br>(基金合同生效<br>日)-2016 年 12 月<br>31 日 | 2015 年  | 2014 年  |
|---------------|--|---------|---------|
| 本期已实现收益       | -34,841.48   | -       | -       |
| 本期利润          | 1,622,729.09   | -       | -       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0166   | -       | -       |
| 本期基金份额净值增长率   | 9.80%  | -       | -       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末  | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0123   | -       | -       |
| 期末基金资产净值      | 187,798,852.46                                       | -       | -       |
| 期末基金份额净值      | 1.098  | -       | -       |

注 1：本基金合同于 2016 年 4 月 28 日生效。

注 2：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。

注 3：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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -2.40%       | 0.71%               | -1.90%             | 0.64%                 | -0.50% | 0.07% |
| 过去六个月          | 7.96%        | 0.81%               | 5.01%              | 0.65%                 | 2.95%  | 0.16% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 9.80%        | 0.74%               | 3.79%              | 0.71%                 | 6.01%  | 0.03% |

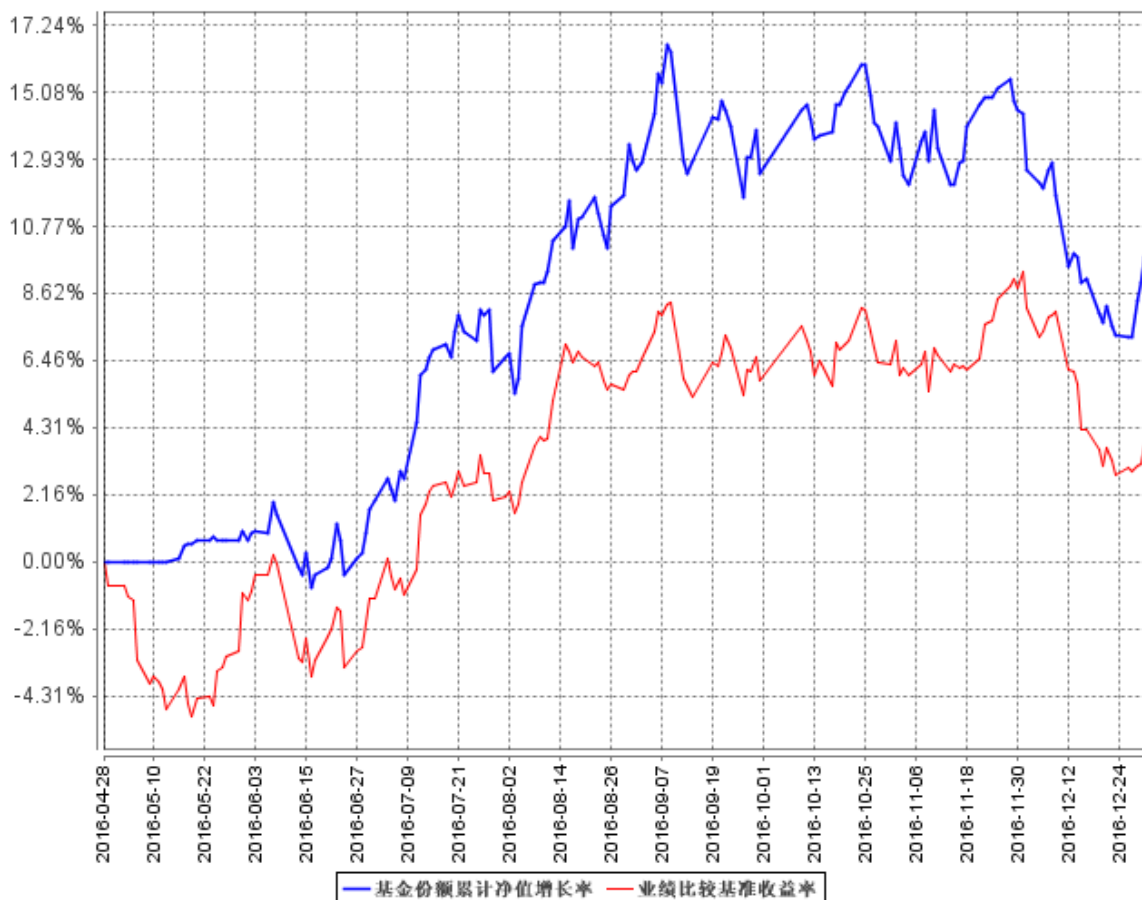
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中国全券指数×10%，本基金

的投资范围为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）、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、权证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资股票资产的比例占基金资产的 0%—95%，债券资产占基金资产的 0%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0—95%，投资于香港联合交易所上市股票的比例占基金资产的 0—95%），本基金还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。因此，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、恒生指数和中国全债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，选择 45%作为基准指数中沪深股票资产所代表的长期平均权重，同样选择 45%作为基准指数中港股资产所代表的长期平均权重，并选择 10%作为债券资产所代表的长期平均权重，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 45%、45%、10%的比例对基础指数进行再平衡，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



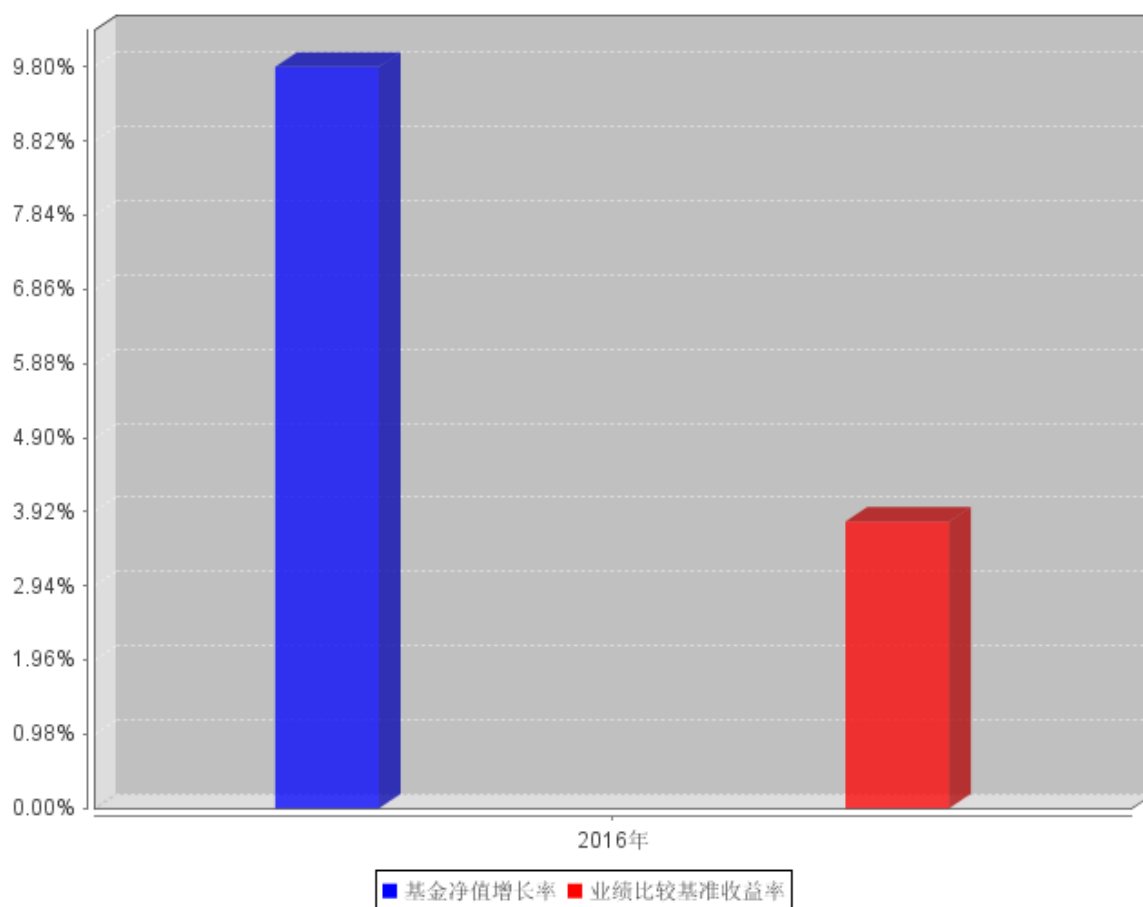
注 1：按相关法规规定，本基金自基金合同 2016 年 4 月 28 日生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

注 2：本基金合同生效日 2016 年 4 月 28 日起至披露时点不满一年。

### 3.2.3 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 2016 年度是指 2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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

注：本基金自基金合同生效日起至本报告期末未发生利润分配。

## § 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 2016 年 12 月 31 日，共管理证券投资基金 33 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 |        |   |
| 林翠萍 | 本基金基金经理   | 2016 年 4 月 28 日 | -    | 18 年   | 林翠萍女士，美国斯克<br>兰顿大学企业管理硕<br>士。历任中华经济研<br>究院研究助理，京华（元<br>大）证券股份有限公司<br>研究员、自营部交易<br>员，保诚（瀚亚）证<br>券投资信托股份有限<br>公司基金经理，富鼎（中<br>国信托）证券投资信<br>托股份有限公司投研处<br>协理，联邦证券投资<br>信托股份有限公司基<br>金经理，华南永昌证<br>券投资信托股份有限<br>公司研究经理，金鼎（联博）<br>证券投资信托股份有<br>限公司基金经理，华顿<br>证券投资信托股份有<br>限公司资深经理，未<br>来资产证券投资信托<br>股份有限公司资深副<br>总经理。2015 年 8 月进入<br>本公司工作，曾任投<br>研中心拟任基金经理，<br>2016 年 4 月至今任中<br>海沪港深价值优选灵<br>活配置混合型证券投<br>资基金基金经理。 |
| 姚晨曦 | 本基金基<br>金经理、<br>中海消费<br>主题精选<br>混合型证<br>券投资基<br>金基金经<br>理、中海<br>能源策略<br>混合型证<br>券投资基<br>金基金经<br>理 | 2016 年 4 月 28 日 | -    | 9 年    | 姚晨曦先生，复旦大<br>学金融学专业硕士。曾任<br>上海申银万国证券研<br>究所二级分析师。2009<br>年 5 月进入本公司工<br>作，历任分析师、分<br>析师兼基金助理。2015<br>年 4 月至今任中<br>海消费主题精选混<br>合型证券投资基<br>金基金经理，2015 年 4 月<br>至今任中海能源策略混<br>合型证券投资基<br>金基金   |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 经理,2016年4月至今任中海沪港深价值优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《证券业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 2013 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 2016 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

2016 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

2016 年全球股市起伏震荡。年初，在美国联准会将持续升息的预期下，美元走强，投资人忧

虑新兴市场恐怕再现资金出走潮，使得避险情绪高涨，导致全球资本市场风险偏好急速下降，主要股市皆大幅下挫；年中，虽然遭逢英国脱欧公投的冲击，然而随着美国联准会升息预期减缓，加上日本、欧洲持续进行货币宽松政策以刺激经济，使得商品原物料价格触底弹升，全球股市也展开反弹行情。到了年底，美国总统大选结果由 Trump 意外当选，市场一反原来担忧，开始乐观期待 Trump 新政将启动大规模财政刺激方案与基础建设，通膨预期升温，持续带动原物料价格及美元走强，股市也出现一波「Trump 交易」行情。

报告期内，本基金总体选股主轴坚持了以企业的商业模式具备中长期竞争优势的投资思路，期间随着企业盈利的回升，股价也跟着水涨船高；另外，深港通开放的政策激励，也推动了港股估值的修复，基金净值也随之走扬。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.098 元(累计净值 1.098 元)。报告期内本基金净值增长率为 9.8%，高于业绩比较基准 6.01 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

2017 年全球金融市场最大的风险来自于欧、美政治的不确定性。美国新任总统 Trump 经济政策重点由货币转向财政刺激，市场预期将带动通胀与经济成长。不过，随着 Trump 正式上台后推动备受争议的政策，社会意见分歧加剧；加上其所提名的内阁成员，多数仍然未获国会通过，未来是否能如期推动其他政策，不无疑问。另一方面，欧洲面临德、法的大选变数，更增添市场的不确定性。

好的方面，国际货币基金组织近日发布的最新一期《世界经济展望》，将今年中国经济增速预期维持在 6.6% 不变。亚洲开发银行去年 9 月底发布的报告，则上调了今、明两年中国经济增长率预期值。瑞银（UBS）也对中国今年经济增速预估从此前的 6.6% 小幅上调至 6.7%。伴随着海外对中国经济认识的修复，叠加中国改革预期，港股对海外资金的吸引力不断增强。

尽管国际局势诸多变数，不过，港股市场因低估值和高分红成为投资的价值洼地，在全球经济复苏缓慢，资金在全球范围内寻找高收益资产的背景下，港股对海外内资金仍具有较强的吸引力。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由监察稽核部门遵守独立、客观、公正的原则，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方法对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

管理人各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、管理人内部的规章制度以及各项业务规范流程，运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据基金监管法律法规的不断更新与完善，推动各部门加强内部制度建设，确保制度对各项业务和管理环节的全覆盖、提高制度和流程的合规性、合理性和可操作性。

(2) 开展基金法律法规和管理人内部各项基本制度的培训学习工作，树立员工规范意识、合规意识和风险意识，形成员工主动、自觉进行内部控制的风险管理文化，构建主动进行管理人内部风险控制和自觉接受监察稽核的平台。

(3) 全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金销售、投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作。

(4) 按照中国证监会的要求，在管理内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

(5) 根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。2017 年我们将继续紧紧抓住风险控制和合规性两条主线，构建一个制度修订规范化、风险责任岗位化、风险检测细致化、风险评估科学化的长效风险控制机制，提高内部监察工作的计划性、科学性和有效性，实现基金合法合规运作。

## 4.7 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

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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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**

本报告期内，本基金于 2016 年 7 月 22 日至 2016 年 9 月 05 日出现超过连续二十个工作日基金份额持有人不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### **§ 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 12 月 31 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本基金的投资运作、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本基金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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 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(2017)第 20109 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      | 中海沪港深价值优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沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中海沪港深价值优选”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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沪港深价值优选 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：<br><br>(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；<br>(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  |



|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>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> |
| 审计意见段     | 我们认为，上述中海沪港深价值优选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，公允反映了中海沪港深价值优选 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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    | 2017 年 3 月 24 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                         |                          |
| 银行存款       |     | 33,209,761.63           | -                        |
| 结算备付金      |     | 1,139,671.05            | -                        |
| 存出保证金      |     | 7,320.42                | -                        |
| 交易性金融资产    |     | 155,145,261.00          | -                        |
| 其中：股票投资    |     | 155,145,261.00          | -                        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 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          |            | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        |            | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            |            | 7,081.43                   | -                           |
| 应收股利            |            | 10,103.56                  | -                           |
| 应收申购款           |            | 24,573.94                  | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            |            | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 189,543,773.03             | -                           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 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         |            | 1,009,957.87               | -                           |
| 应付赎回款           |            | 59,586.19                  | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 241,918.43                 | -                           |
| 应付托管费           |            | 40,319.75                  | -                           |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          |            | 102,986.98                 | -                           |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            |            | 290,151.35                 | -                           |
| 负债合计            |            | 1,744,920.57               | -                           |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            |            | 171,057,867.76             | -                           |
| 未分配利润           |            | 16,740,984.70              | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 187,798,852.46             | -                           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 189,543,773.03             | -                           |

注：本基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，无上年度末数据，下同。

报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.098 元，基金份额总额 171,057,867.76 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号       | 本期<br>2016 年 4 月 28 日(基<br>金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-----------|---|--|
| <b>一、收入</b>                |           | 3,487,167.71  | -  |
| 1. 利息收入                    |           | 274,982.03  | -  |
| 其中：存款利息收入                  |           | 194,251.54  | -  |
| 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                 |           | 80,730.49   | -  |
| 其他利息收入                     |           | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |           | 209,902.88  | -  |
| 其中：股票投资收益                  |           | -177,544.53   | -  |
| 基金投资收益                     |           | -   | -  |
| 债券投资收益                     |           | -   | -  |
| 资产支持证券投资收益                 |           | -   | -  |
| 贵金属投资收益                    |           | -   | -  |
| 衍生工具收益                     |           | 47,180.55   | -  |
| 股利收益                       |           | 340,266.86  | -  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |           | 1,657,570.57  | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |           | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |           | 1,344,712.23  | -  |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 1,864,438.62  | -  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 1,041,824.55  | -  |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 173,637.42  | -  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | -   | -  |
| 4. 交易费用                    |           | 333,495.23  | -  |
| 5. 利息支出                    |           | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | -   | -  |
| 6. 其他费用                    |           | 315,481.42  | -  |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 1,622,729.09  | -  |
| 减：所得税费用                    |           | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 1,622,729.09  | -  |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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）                        | 221,570,748.81                                   | -             | 221,570,748.81  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 1,622,729.09  | 1,622,729.09    |
| 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）      | -50,512,881.05                                   | 15,118,255.61 | -35,394,625.44  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 165,229,677.90                                   | 20,961,603.65 | 186,191,281.55  |
| 2. 基金赎回款                               | -215,742,558.95                                  | -5,843,348.04 | -221,585,906.99 |
| 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）                        | 171,057,867.76                                   | 16,740,984.70 | 187,798,852.46  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 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）                        | -  | -             | -               |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（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）      | -  | -             | -               |
| 其中：1. 基金申购款                            | -  | -             | -               |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -             | -               |
| 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）             | - | - | - |

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：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <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   |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中海沪港深价值优选灵活配置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[2015] 2745 号《关于准予中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,于 2016 年 3 月 14 日至 2016 年 4 月 22 日向社会公开募集。本基金为契约型,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 221,530,126.56 元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验字[2016]第 435 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 221,570,748.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 40,622.25 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为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批准上市的股票)、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券等)、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合的资产配置比例为:投资于股票资产占基金资产的比例为 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%,投资于香港联合交易所上市股票的比例占基金资产的 0-95%),投资于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%。本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数收益率×10%。

### 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》、《中海沪港深价值优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 2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 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。

#### 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、买入返售金融资产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卖出回购金融资产款和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》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

### 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、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国农业银行股份有限公司       | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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、基金销售机构     |
| 法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司  | 基金管理人的股东            |
| 中海恒信资产管理(上海)有限公司   | 基金管理人的控股子公司         |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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<br>2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至<br>2016 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|---|----------------------|---|----------------------|
|       | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 国联证券  | 168,950,925.39                                      | 92.23%               | -   | -                    |

##### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 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<br>2016年4月28日(基金合同生效日)至<br>2016年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                            |
|-------|---|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|       | 回购成交金额                                    | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 国联证券  | 1,129,000,000.00                          | 100.00%                    | -                                | -                          |

#### 7.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年4月28日(基金合同生效日)至<br>2016年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                      |
|-------|---|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                      | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期权证<br>成交总额的比<br>例 |
| 国联证券  | 47,180.55                                 | 100.00%              | -                                | -                    |

#### 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<br>2016年4月28日(基金合同生效日)至2016年12月31日 |                       |           |                         |
|-------|---------------------------------------|-----------------------|-----------|-------------------------|
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金<br>总量的比例        | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣<br>金总额的比例        |
| 国联证券  | 137,058.84                            | 92.94%                | 94,773.52 | 92.02%                  |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日      |                       |           |                         |
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣<br>金总额的比例<br>(%) |

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。

#### 7.4.8.2 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<br>2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,041,824.55                                     | -   |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 208,763.56                                       | -   |

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。

#### 7.4.8.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 4 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 173,637.42                                       | -   |

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。

#### 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:本报告期内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<br>2016年4月28日(基金合同生效日)<br>至2016年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015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 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 33,209,761.63                             | 167,715.86 | -                                | -      |

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。

**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：本基金在本报告期末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**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项

**7.4.9 期末（2016年12月31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：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌流通受限股票。

**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 2016 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 155,145,261.00 元，无属于第二层次以及第三层次的余额。

(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 2016 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

### 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    | 155,145,261.00 | 81.85         |
|    | 其中：股票   | 155,145,261.00 | 81.85         |
| 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      | 34,349,432.68  | 18.12  |
| 7 | 其他各项资产            | 49,079.35      | 0.03   |
| 8 | 合计                | 189,543,773.03 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 7,177,608.00  | 3.82          |
| C  | 制造业              | 4,990,760.00  | 2.66          |
| 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           | -             | -             |
| 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         | -             | -             |
| 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               | -             | -             |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -             |
| S  | 综合               | -             | -             |
|    | 合计               | 12,168,368.00 | 6.48          |



## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| B 消费者非必需品 | 40,169,171.00  | 21.39        |
| C 消费者常用品  | 5,869,412.00   | 3.13         |
| D 能源      | 5,862,780.00   | 3.12         |
| E 金融      | 26,357,202.00  | 14.03        |
| F 医疗保健    | 6,067,005.00   | 3.23         |
| G 工业      | 8,942,040.00   | 4.76         |
| H 信息技术    | 39,605,403.00  | 21.09        |
| I 电信服务    | 7,476,080.00   | 3.98         |
| J 公用事业    | 2,627,800.00   | 1.40         |
| 合计        | 142,976,893.00 | 76.13        |

## 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  | 0700 | 腾讯控股   | 86,700    | 14,712,123.00 | 7.83         |
| 2  | 2318 | 中国平安   | 220,000   | 7,636,200.00  | 4.07         |
| 3  | 2018 | 瑞声科技   | 114,500   | 7,215,790.00  | 3.84         |
| 4  | 0388 | 香港交易所  | 43,000    | 7,046,410.00  | 3.75         |
| 5  | 0175 | 吉利汽车   | 1,045,000 | 6,928,350.00  | 3.69         |
| 6  | 1299 | 友邦保险   | 170,400   | 6,667,752.00  | 3.55         |
| 7  | 2020 | 安踏体育   | 297,000   | 6,150,870.00  | 3.28         |
| 8  | 0857 | 中国石油股份 | 1,134,000 | 5,862,780.00  | 3.12         |
| 9  | 0981 | 中芯国际   | 501,500   | 5,466,350.00  | 2.91         |
| 10 | 2382 | 舜宇光学科技 | 174,000   | 5,284,380.00  | 2.81         |

## 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  | 0700 | 腾讯控股      | 15,155,473.35 | 8.07   |
| 2  | 0388 | 香港交易所     | 7,795,479.72  | 4.15   |
| 3  | 2318 | 中国平安      | 7,408,302.35  | 3.94   |
| 4  | 2018 | 瑞声科技      | 7,037,739.85  | 3.75   |
| 5  | 1299 | 友邦保险      | 7,020,920.31  | 3.74   |
| 6  | 0175 | 吉利汽车      | 5,998,578.38  | 3.19   |
| 7  | 0857 | 中国石油股份    | 5,739,039.94  | 3.06   |
| 8  | 2382 | 舜宇光学科技    | 5,722,211.44  | 3.05   |
| 9  | 2020 | 安踏体育      | 5,680,043.57  | 3.02   |
| 10 | 0665 | 海通国际      | 5,524,151.47  | 2.94   |
| 11 | 1186 | 中国铁建      | 4,913,815.54  | 2.62   |
| 12 | 1970 | IMAXCHINA | 4,577,730.64  | 2.44   |
| 13 | 0981 | 中芯国际      | 4,492,646.84  | 2.39   |
| 14 | 2920 | 中国粗粮王饮品   | 4,492,646.84  | 2.39   |
| 15 | 0066 | 港铁公司      | 4,202,244.66  | 2.24   |
| 16 | 1928 | 金沙中国有限公司  | 4,029,703.07  | 2.15   |
| 17 | 3969 | 中国通号      | 3,987,783.68  | 2.12   |
| 18 | 2313 | 申洲国际      | 3,955,668.65  | 2.11   |
| 19 | 0762 | 中国联通      | 3,932,063.84  | 2.09   |
| 20 | 0027 | 银河娱乐      | 3,786,231.07  | 2.02   |

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  | 000807 | 云铝股份 | 1,770,112.00 | 0.94            |
| 2  | 600362 | 江西铜业 | 1,724,945.00 | 0.92            |
| 3  | 600497 | 驰宏锌锗 | 1,622,314.00 | 0.86            |
| 4  | 601899 | 紫金矿业 | 586,201.00   | 0.31            |
| 5  | 600188 | 兖州煤业 | 581,906.64   | 0.31            |
| 6  | 300011 | 鼎汉技术 | 554,506.00   | 0.30            |
| 7  | 002103 | 广博股份 | 453,172.00   | 0.24            |

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

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 | 168,422,402.23 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,757,167.27  |

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

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。

### 8.12.2 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   | 7,320.42  |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | 10,103.56 |
| 4  | 应收利息    | 7,081.43  |
| 5  | 应收申购款   | 24,573.94 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 49,079.35 |

### 8.12.3 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。

**8.12.4 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 |
|----|------|------|-------------|---------------|----------|
|----|------|------|-------------|---------------|----------|

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5 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****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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 2,452        | 69,762.59     | 142,866,398.51 | 83.52%     | 28,191,469.25 | 16.48%     |

**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 | 233,484.81 | 0.1365%  |

**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<br>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                    | 0                  |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年4月28日）基金份额总额          | 221,570,748.81 |
| 本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              | 165,229,677.90 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 215,742,558.95 |
| 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） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 171,057,867.76 |

## § 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。

### 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

本报告期内本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 40,000.00 元，截至 2016 年 12 月 31 日已支付 20,000.00 元，目前该会计师事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 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

### 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 |    |
| 国联证券   | 1      | 168,950,925.39 | 92.23%       | 137,058.84 | 92.94%     | -  |
| 西南证券   | 1      | 7,286,256.87   | 3.98%        | 5,328.30   | 3.61%      | -  |
| 华西证券   | 1      | 2,847,171.24   | 1.55%        | 2,082.07   | 1.41%      | -  |
| 渤海证券   | 1      | 2,370,658.00   | 1.29%        | 1,733.64   | 1.18%      | -  |
| 浙商证券   | 1      | 1,220,558.00   | 0.67%        | 892.62     | 0.61%      | -  |
| 东北证券   | 1      | 504,000.00     | 0.28%        | 368.57     | 0.25%      | -  |
| 兴业证券   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 第一创业证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 长城证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 宏源证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民生证券   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中国国际金融 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 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，和华创证券的深圳交易单元。

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。

### 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 |
| 国联证券 | -    | -            | 1,129,000,000.00 | 100.00%        | 47,180.55 | 100.00%      |
| 西南证券 | -    | -            | -                | -              | -         | -            |
| 华西证券 | -    | -            | -                | -              | -         | -            |



|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 渤海证券   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券   | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券   | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券   | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券   | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券   | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券   | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投   | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券   | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券   | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券   | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券   | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券   | - | - | - | - | - | - |

中海基金管理有限公司  
2017年3月31日