

# 中海分红增利混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §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	561,750,009.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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</p>

	<p>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	<p>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%</p>
风险收益特征	<p>本基金属混合型证券投资基金，为证券投资基金中的中高风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p>

### 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	黄乐军	贺倩
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-888-9788、021-38789788		95599
传真	021-68419525		010-68121816

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网	www.zhfund.com
--------------------	----------------

网址	
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

### §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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	20,670,733.44
本期利润	103,282,964.44
加权平均基金份额本期利润	0.1776
本期基金份额净值增长率	28.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2224
期末基金资产净值	436,825,642.43
期末基金份额净值	0.7776

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	6.97%	1.48%	1.18%	0.59%	5.79%	0.89%
过去三个月	-2.95%	1.86%	-4.51%	0.85%	1.56%	1.01%
过去六个月	28.68%	1.86%	7.49%	0.87%	21.19%	0.99%
过去一年	13.88%	2.00%	3.83%	0.87%	10.05%	1.13%
过去三年	11.15%	1.60%	15.26%	0.66%	-4.11%	0.94%
自基金合同生效起至今	178.72%	1.69%	192.52%	1.25%	-13.80%	0.44%

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 2019 年 6 月 30 日。

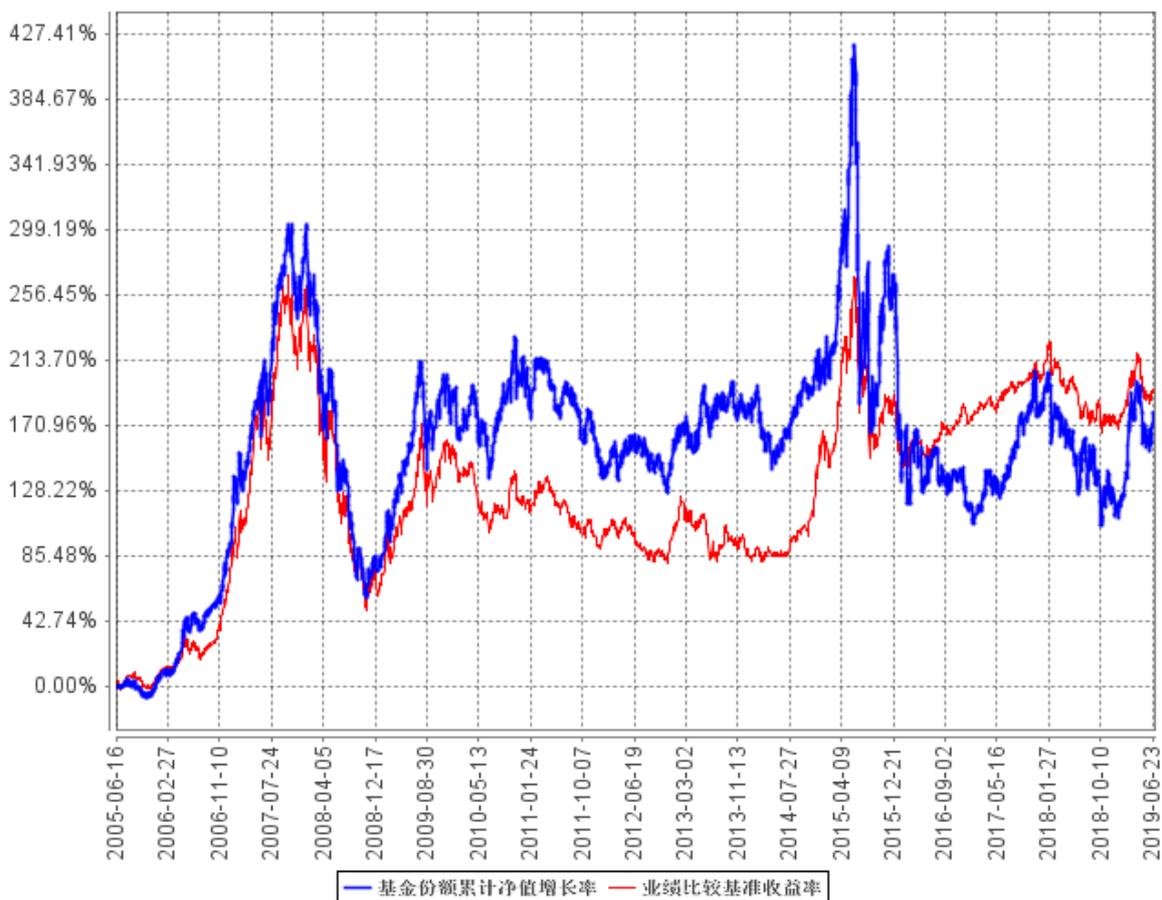
注 2：本基金的业绩比较基准为上证红利指数\*70%+上证国债指数\*25%+银行一年期定期存款利率\*5%，本基金主要投资于中国证券市场中现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券。因此，我们选取市场认同度很高的上证红利指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数，同时考虑分红基金的特点，加入了一年定期存款利率作为业绩比较基准的一部分。在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 70%左右，债券及现金的

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 2019 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 31 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	-	9 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。历任大连龙日本制品有限公司会计，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、研究部副经理，现任研究部总经理。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，公司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

2019 年上半年证券市场出现了较大幅度的波动，1 季度以成长股为代表的创业板和中小板块的行业龙头个股表现强劲，直至 4 月中旬，成长股走势开始回落，而以消费行业为代表的白马龙头股以核心资产的概念走势表现强劲。其中 5 月份由于中美贸易冲突情况出现反复，使一些科技类个股走势转弱，而业绩相对比较确定的消费类个股更加受到市场资金的偏爱。

国内环境方面，上半年经济数据整体平稳。二季度经济增长比一季度略弱。物价数据方面，上半年内猪价、食品和服务类价格推动 CPI 逐月上行。央行货币政策走向略有调整，由稳定宏观杠杆率转向有序推进结构性去杠杆。个别中小银行事件发生后，央行连续采取多种措施保持市场稳定，金融市场流动性十分充沛。上半年末上海证券交易所发布《科创板首次公开发行股票发行与上市业务指南》，科创板正式宣布成立。

国际环境方面，中美贸易谈判跌宕起伏，中美谈判如何相向而行，从而实现共赢将是彼此需要中长期探求的问题。全球经济增长乏力，各主要经济体货币政策进入拐点，在目前已经较低利率的环境下如何进一步放松货币成为大部分央行需要面临的挑战。全球金融市场可能进入新一轮动荡期。

本基金在 2019 年上半年一直坚持蓝筹+成长的配置策略，在配置了能够保持持续增长的蓝筹股的前提下，增加配置了一些科技成长股，板块配置方面比较均衡。相对重点的配置了计算机、通信和机械板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.7776 元(累计净值 2.1776 元)。报告期内本基金净值增长率为 28.68%，高于业绩比较基准 21.19 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 2019 年下半年，宏观经济方面仍然存在一定的不确定性。国内方面我们预计 2019 年下半年经济情况相对会比较稳定。国际方面存在一定的不确定性，海外经济体特别是美联储的降息预期可能对货币市场走向产生一定的影响。而下半年最大的不确定性还是中美贸易前情潜在的不确定性，它直接影响着市场的风险偏好。对于证券市场，我们认为中国经济本身存在很大韧性的前提下，货币政策持续稳健宽松和政策对市场呵护的双重背景下，以及资产配置荒的大环境下，中期市场还是会振荡向上。所以我们对市场中长期走势不悲观。同时我们认为后市板块和个股走势分化上还会比较严重。

2019 年下半年预计市场投资机会较大的行业会是在国家经济结构转型一直倡导和扶持的科技产业中（如 5G、电子、半导体、芯片等科技板块），和国家战略发展的规划布局中（如医疗、养老、消费、新能源等）。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### **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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	45,782,290.76	48,963,555.55
结算备付金		1,499,039.90	708,614.95
存出保证金		222,341.82	130,150.13
交易性金融资产	6.4.7.2	390,994,231.87	315,029,200.81
其中：股票投资		390,994,231.87	315,029,200.81
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		-	359,811.88
应收利息	6.4.7.5	9,396.41	10,137.25
应收股利		-	-
应收申购款		661,282.25	79,653.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		439,168,583.01	365,281,124.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		167,574.81	98,067.52
应付管理人报酬		512,546.86	468,005.66
应付托管费		85,424.51	78,000.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	576,849.02	302,190.05
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	1,000,545.38	1,319,029.91
负债合计		2,342,940.58	2,265,294.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	561,750,009.05	600,770,162.80
未分配利润	6.4.7.10	-124,924,366.62	-237,754,332.64
所有者权益合计		436,825,642.43	363,015,830.16
负债和所有者权益总计		439,168,583.01	365,281,124.22

注：报告截止日 2019 年 06 月 30

日，基金份额净值 0.7776 元，基金份额总额

561,750,009.05 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		108,658,288.97	-58,552,943.48
1.利息收入		186,792.03	195,200.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	186,766.69	195,200.06
债券利息收入		25.34	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,797,936.26	-24,022,586.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,814,546.30	-25,318,023.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,345.63	-
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	1,969,044.33	1,295,436.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	82,612,231.00	-34,752,911.40
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	61,329.68	27,354.21
<b>减：二、费用</b>		5,375,324.53	7,734,906.17

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,145,162.63	3,485,757.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,193.76	580,959.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,606,709.03	3,468,452.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.07	-
7. 其他费用	6.4.7.20	99,259.04	199,736.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		103,282,964.44	-66,287,849.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		103,282,964.44	-66,287,849.65

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	600,770,162.80	-237,754,332.64	363,015,830.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	103,282,964.44	103,282,964.44
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）	-39,020,153.75	9,547,001.58	-29,473,152.17
其中：1.基金申购款	34,560,967.49	-8,449,631.22	26,111,336.27
2.基金赎回款	-73,581,121.24	17,996,632.80	-55,584,488.44
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）	561,750,009.05	-124,924,366.62	436,825,642.43

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	639,475,125.34	-133,459,296.41	506,015,828.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-66,287,849.65	-66,287,849.65
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)	-38,705,024.45	9,206,856.93	-29,498,167.52
其中：1.基金申购款	20,665,895.76	-5,038,828.40	15,627,067.36
2.基金赎回款	-59,370,920.21	14,245,685.33	-45,125,234.88
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)	600,770,100.89	-190,540,289.13	410,229,811.76

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：

                    杨皓鹏  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，基金管理人和注册登记机构均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；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，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2005]BS074 号验资报告予以验证。

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上市的各种债券。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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 会计差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 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。

**6.4.7.2 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

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	27,952,395.69	2.48%	166,533,093.59	6.87%

**6.4.8.1.2 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。

**6.4.8.1.3 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。

**6.4.8.1.4 权证交易**

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	26,032.18	2.81%	26,032.18	4.51%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	155,090.91	7.60%	-	-

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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,145,162.63	3,485,757.51
其中：支付销售机构的客户维护费	710,559.37	755,080.84

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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	524,193.76	580,959.52

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。

### 6.4.8.3 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。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	0.00
报告期初持有的基金份额	-	15,332,480.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	15,332,480.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.5500%

注：本报告期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

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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	45,782,290.76	177,618.97	31,662,859.34	173,482.66

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2019 年半年度获得的利息收入为人民币 7,818.72 元（2018 年半年度：人民币 17,207.32 元），2019 年 6 月末结算备付金余额为人民币 1,499,039.9 元（2018 年 6 月末：人民币 1,341,369.84 元）。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

**6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

**6.4.9.2 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等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 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。

**6.4.9.3.2 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 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	390,994,231.87	89.03
	其中：股票	390,994,231.87	89.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47,281,330.66	10.77
8	其他各项资产	893,020.48	0.20
9	合计	439,168,583.01	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	216,170,791.74	49.49
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	11,680,760.00	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,074,935.46	18.10
J	金融业	13,065,525.19	2.99
K	房地产业	16,105,852.08	3.69
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,228,293.60	9.21
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	14,644,967.20	3.35
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	390,994,231.87	89.51

### 7.3 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	300012	华测检测	3,724,842	40,228,293.60	9.21
2	000063	中兴通讯	1,022,582	33,264,592.46	7.62
3	002271	东方雨虹	1,143,550	25,912,843.00	5.93
4	002371	北方华创	261,200	18,088,100.00	4.14
5	002463	沪电股份	1,314,873	17,908,570.26	4.10
6	600570	恒生电子	253,743	17,292,585.45	3.96
7	600745	闻泰科技	513,100	17,045,182.00	3.90
8	002841	视源股份	219,014	16,975,775.14	3.89
9	600536	中国软件	315,400	16,927,518.00	3.88
10	603679	华体科技	358,800	16,289,520.00	3.73

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 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	600216	浙江医药	27,239,076.46	7.50
2	002271	东方雨虹	23,295,834.39	6.42
3	300310	宜通世纪	20,769,287.61	5.72
4	000725	京东方A	16,495,283.00	4.54
5	002938	鹏鼎控股	16,329,545.14	4.50
6	002821	凯莱英	16,014,698.00	4.41
7	600536	中国软件	15,806,006.50	4.35
8	300347	泰格医药	15,554,408.60	4.28

9	300136	信维通信	15,464,686.68	4.26
10	601155	新城控股	15,314,266.40	4.22
11	600745	闻泰科技	15,130,183.84	4.17
12	000066	中国长城	14,612,437.00	4.03
13	601555	东吴证券	14,543,981.27	4.01
14	300017	网宿科技	14,494,037.00	3.99
15	300394	天孚通信	14,320,952.00	3.94
16	002792	通宇通讯	14,198,270.00	3.91
17	002230	科大讯飞	14,165,734.04	3.90
18	603679	华体科技	14,160,659.00	3.90
19	000625	长安汽车	14,128,284.80	3.89
20	300098	高新兴	12,834,097.21	3.54
21	002621	美吉姆	12,817,737.84	3.53
22	300659	中孚信息	12,816,012.20	3.53
23	002607	中公教育	12,520,064.27	3.45
24	002001	新和成	12,397,625.58	3.42
25	300014	亿纬锂能	12,376,968.00	3.41
26	300059	东方财富	12,123,963.00	3.34
27	300682	朗新科技	11,340,979.00	3.12
28	600004	白云机场	10,333,592.19	2.85
29	002191	劲嘉股份	10,013,500.00	2.76
30	603429	集友股份	9,714,689.20	2.68
31	002796	世嘉科技	9,548,029.00	2.63
32	600837	海通证券	9,483,704.00	2.61
33	600166	福田汽车	9,482,144.00	2.61
34	300292	吴通控股	8,231,927.31	2.27

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600216	浙江医药	26,568,594.02	7.32
2	600498	烽火通信	24,610,315.74	6.78
3	601155	新城控股	20,252,402.60	5.58

4	002281	光迅科技	19,078,157.58	5.26
5	300347	泰格医药	17,845,773.81	4.92
6	300451	创业慧康	16,009,080.74	4.41
7	002821	凯莱英	15,712,601.58	4.33
8	300012	华测检测	15,549,781.32	4.28
9	000002	万科A	15,497,058.40	4.27
10	002938	鹏鼎控股	15,496,439.00	4.27
11	300136	信维通信	15,054,713.20	4.15
12	300559	佳发教育	14,661,594.26	4.04
13	002044	美年健康	14,240,487.50	3.92
14	600048	保利地产	13,432,695.00	3.70
15	002230	科大讯飞	13,401,378.59	3.69
16	300059	东方财富	13,203,039.94	3.64
17	300310	宜通世纪	13,046,695.42	3.59
18	300253	卫宁健康	12,858,148.95	3.54
19	000625	长安汽车	12,848,567.56	3.54
20	600763	通策医疗	12,620,222.00	3.48
21	300015	爱尔眼科	12,540,474.78	3.45
22	002621	美吉姆	12,363,200.00	3.41
23	002001	新和成	12,200,860.20	3.36
24	300017	网宿科技	11,631,300.72	3.20
25	300760	迈瑞医疗	11,535,901.88	3.18
26	300682	朗新科技	11,112,841.00	3.06
27	002792	通宇通讯	10,837,770.00	2.99
28	002624	完美世界	10,431,809.66	2.87
29	300394	天孚通信	9,958,573.00	2.74
30	002739	万达电影	9,362,146.64	2.58
31	600837	海通证券	8,968,010.08	2.47
32	600166	福田汽车	8,956,793.00	2.47
33	002796	世嘉科技	8,610,782.00	2.37
34	603429	集友股份	8,277,383.60	2.28
35	002191	劲嘉股份	8,133,163.00	2.24
36	002463	沪电股份	7,661,037.00	2.11
37	600570	恒生电子	7,511,608.25	2.07
38	600845	宝信软件	7,323,191.02	2.02

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	549,887,217.42
卖出股票收入（成交）总额	580,348,963.66

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名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。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	222,341.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,396.41
5	应收申购款	661,282.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	893,020.48

### 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

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

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
33,903	16,569.33	1,814,396.93	0.32%	559,935,612.12	99.68%

### 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	3,901.54	0.0007%

### 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	600,770,162.80
本报告期基金总申购份额	34,560,967.49
减：本报告期基金总赎回份额	73,581,121.24
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	561,750,009.05

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，本基金管理人无重大人事变动。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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安永华明会计师事务所(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	
西南证券	1	300,198,303.52	26.61%	219,535.53	23.70%	-
浙商证券	1	179,161,753.46	15.88%	131,021.84	14.15%	-
华创证券	2	166,791,549.67	14.78%	155,333.26	16.77%	-
渤海证券	1	102,144,177.94	9.05%	74,698.45	8.06%	-
银河证券	2	89,689,125.56	7.95%	83,528.05	9.02%	-
光大证券	1	74,910,794.94	6.64%	69,764.41	7.53%	-
东兴证券	1	68,076,536.49	6.03%	63,399.21	6.84%	-
国信证券	1	57,072,319.68	5.06%	53,151.82	5.74%	-
兴业证券	2	38,367,021.22	3.40%	28,057.83	3.03%	-

国联证券	1	27,952,395.69	2.48%	26,032.18	2.81%	-
中泰证券	1	20,990,263.05	1.86%	19,548.42	2.11%	-
方正证券	1	2,987,020.27	0.26%	2,184.33	0.24%	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
平安证券	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；报风险管理部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内没有新增交易单元；退租了中信证券、海通证券、华宝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。

### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
西南证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	89,729.00	36.97%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	152,972.30	63.03%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

中海基金管理有限公司

2019年8月26日