

中海优质成长证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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 2017 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	中海优质成长混合
基金主代码	398001
前端交易代码	398001
后端交易代码	398002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 9 月 28 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,532,339,886.54 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	品质过滤，成长精选。 （一）资产配置 本基金由公司投资决策委员会基于如下的分析判断并结合《基金合同》中的投资限制和投资比例限制来确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例： 1、根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化来把握宏观经济发展对证券市场的影响方向和力度，判断证券市场的发展趋势和风险收益特征； 2、根据基金投资者对开放式基金的认识程度，以及基金行业的管理经验，判断基金申购和赎回净现金流量。 （二）股票组合的构建 1、选股标准 本基金投资对象是优质成长企业的权益类证券。优质成长即注重上市公司品质和成长性的结合。主要从三方面考察上市公司的品质：① 财务健康，现金流充沛、业绩真实可靠；② 公司在所属行业内具有比较竞争优势；③ 良好的经营管理能力。同时从如下两个方面考察上市公司的成长性：① 公司应具有较强的潜在获利能力和较高的净利润增长率；② 公司产

	品或服务的需求总量不断扩大。 2、备选股票库的构建 备选股票库通过以下两个阶段构建： 第一阶段：品质与历史成长性过滤 本基金运用 GOQ 模型（Growth On High Quality Model）对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）的品质和历史成长性进行过滤。主要通过经营性现金流、总资产回报率等指标对其财务状况进行评价。通过相对市场份额、超额毛利率等指标对行业竞争优势进行评价。通过净利润增长率等指标对历史成长性进行评价。GOQ 模型根据上述指标对上市公司进行综合评价排序，初步筛选出 300 家左右的上市公司作为股票备选库（I）。 第二阶段：成长精选 针对第一阶段筛选的股票备选库（I），本基金运用 α 公司评级系统对其进行成长精选。 中海 α 公司评级系统由 4 个大的指标分析单元和 50 个具体评分指标构成，其中客观性评分指标 30 个，主观性评分指标 20 个。中海 α 公司评级系统 4 个大的分析单元分别是：企业成长的行业基本情况评价，企业成长的政策等非市场因素评价，企业成长的内在因素深度分析，企业成长的盈利与风险情况评价。 中海 α 公司评级系统的设置充分体现了主客观结合的评价原则，评级系统中可量化客观性指标的设置保证了选股过程的客观性和可比性。与一般的主观评级系统相比较，这种主客观结合的指标体系既充分保障了评价结果的全面与客观可比性，又有利于引导研究员对目标公司做更加深入细致的研究，提高评价结果的准确度。 本基金运用 α 公司评级系统的评价结果，对备选库（I）中的股票进行进一步精选，形成 150 家左右上市公司的股票备选库（II）。 3、股票投资组合的构建 基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断，特别是通过对公司管理团队的考量以及公司竞争力的全面分析，对股票备选库（II）中的股票做出合适的投资判断，在此基础上形成最终的股票投资组合，并进行适时的调整。 （三）债券组合的构建 本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。本基金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。
--	---

业绩比较基准	沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产的长期稳定增长。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	陆志俊
	联系电话	021-38429808	95559
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95559
传真		021-68419525	021-62701216

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

§ 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-39,900,432.94
本期利润	92,788,206.20
加权平均基金份额本期利润	0.0255
本期基金份额净值增长率	6.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0499
期末基金资产净值	1,487,890,978.81
期末基金份额净值	0.4212

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。

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	8.92%	0.88%	3.76%	0.50%	5.16%	0.38%
过去三个月	4.18%	1.00%	4.60%	0.46%	-0.42%	0.54%
过去六个月	6.44%	0.92%	8.12%	0.43%	-1.68%	0.49%
过去一年	-2.36%	0.96%	12.56%	0.50%	-14.92%	0.46%
过去三年	25.98%	2.23%	56.37%	1.31%	-30.39%	0.92%
自基金合同 生效起至今	383.07%	1.62%	180.32%	1.34%	202.75%	0.28%

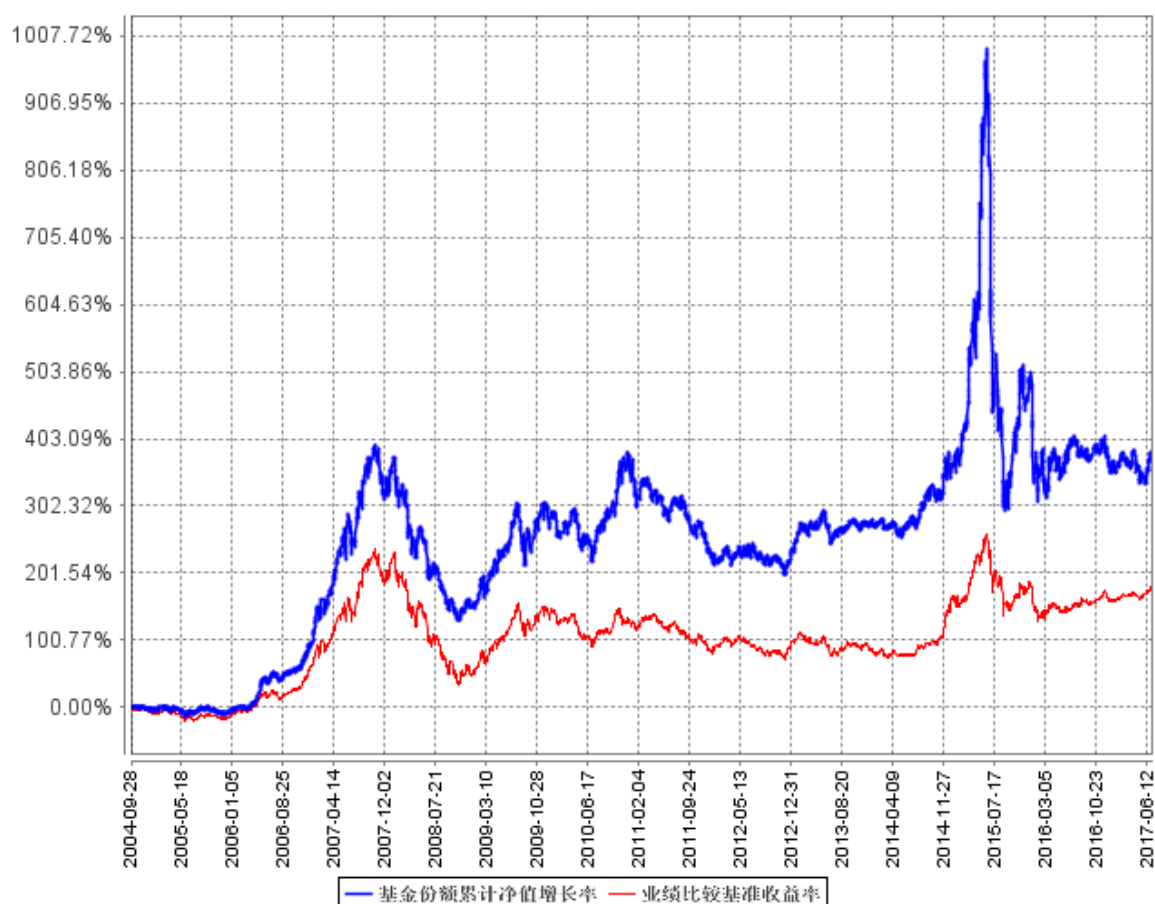
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2004 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 30%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 75%左右，债券投资比例控制在 25%左右。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，以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照 75%、25%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：鉴于《新华富时指数使用许可协议》期限届满终止，中海基金管理有限公司作为基金管理人，已于 2007 年 6 月 1 日将中海优质成长证券投资基金业绩比较基准由“新华富时 A600 成长指数*75%+新华富时中国国债指数*25%”变更为“沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%”。

注 2：截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§ 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 2017 年 6 月 30 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		

于航	本基金基金经理、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海增强收益债券型证券投资基金基金经理、中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理	2015 年 4 月 17 日	-	7 年	于航先生，复旦大学运筹学与控制论专业博士。 2010 年 7 月进入本公司工作，历任助理分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理。 2015 年 4 月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至今任中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至今任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至今任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理， 2016 年 3 月至今任中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至今任中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理。
----	--	-----------------	---	-----	---

注 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司风控稽核部对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段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

2017 年初的策略是看好经济的韧性、看好制造业投资复苏。在此指导下，一季度重仓周期

股，并表现较好。但在两会后地产调控升级，市场弥漫着对二季度经济增长的担忧，这对周期股的情绪产生很大影响，持续下跌了 3 个月，二季度业绩因此受到很大影响，但是在二季度末市场逐渐从悲观预期中复苏出来。事实证明经济并没有下台阶，多数周期股的利润甚至在二季度环比上升，市场随之展开对周期股的修复。在二季度本基金顺应市场风格，减配了周期，增配了漂亮 50 类股票，降低了净值的波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.4212 元（累计净值 3.2552 元）。报告期内本基金净值增长率为 6.44%，低于业绩比较基准 1.68 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

今年上半年全球经济回暖，全球股市不论发达国家或者新兴市场都在不断的创出新高。中国作为世界经济发展的重要引擎，本不应该例外。但是中国股市有自身的结构性问题，一方面大盘蓝筹长期低估，比如家电的龙头公司，长期低于 8 倍市盈率；一线白酒估值严重低于全球主要食品饮料公司；保险、银行更是长期折价；另一方面，代表新经济的小股票严重高估；这种割裂从 12 年至 16 年持续长达 4 年多。17 年是回归正常的一年，虽然这其中管理层导向的问题，有宏观去杠杆去泡沫的原因，但是本身应当有内在的逻辑使得这种割裂的弥合在今年发生。

本人认为既然这种撕裂的行情本身有其内在原因，并且目前尚未结束，因为漂亮 50 并未产生泡沫，龙头公司的估值水平在国际上仍然低估，比如茅台仍在高增长的情况下，估值低于连续下滑的可口可乐，上汽自主高增的情况下，估值与丰田和福特也没有明显的高估，格力美的估值一直低于二线的惠而浦等等，那么本人认为应当拥抱这种趋势，而不是一直等待风格切换。我们认为国内股票市场的总体趋势还是反映了全球股票市场的大趋势，中国核心资产也是在不断创出新高，只不过由于流动性急剧下降，使得核心资产并没有扩散，后面随着监管高峰过去，流动性快速收缩的阶段结束，行情应当会扩散到各个行业的细分龙头上去，由漂亮 50 扩散到漂亮 100，所以接下来，本人准备在配置仍然具有空间的漂亮 50 之外，寻找估值低、空间大、治理好（历史证明）的二线蓝筹和中小盘股票布局。

本基金在报告期内重点配置了中游产业和新能源汽车，因为本人认为在过去一年半时间内企业盈利大幅好转，应当可以促发制造业投资不断改善；新能源汽车的产业大趋势越来越明晰，相关公司的估值也日趋合理。2017 年三季度的操作将会更加关注二线蓝筹的机会。

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

2017 年上半年度，基金托管人在中海优质成长证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，中海基金管理有限公司在中海优质成长证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年上半年度，由中海基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中海优质成长证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：中海优质成长证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		86,049,579.35	396,923.46
结算备付金		5,583,232.27	146,761,746.35
存出保证金		977,081.93	1,096,230.80
交易性金融资产		1,307,867,478.94	1,317,075,941.11
其中：股票投资		1,307,572,775.44	1,186,951,891.11
基金投资		-	-
债券投资		294,703.50	130,124,050.00
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		89,056,364.53	-
应收证券清算款		5,776,563.74	10,439,937.83
应收利息		40,902.77	2,751,897.35
应收股利		-	-
应收申购款		170,214.16	422,064.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,495,521,417.69	1,478,944,741.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,136,823.63	390,195.05
应付管理人报酬		1,753,937.20	1,940,102.96
应付托管费		292,322.88	323,350.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,470,859.92	5,078,896.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		976,495.25	1,125,940.02
负债合计		7,630,438.88	8,858,485.12
所有者权益：			
实收基金		1,419,178,795.50	1,492,801,799.29
未分配利润		68,712,183.31	-22,715,542.87
所有者权益合计		1,487,890,978.81	1,470,086,256.42
负债和所有者权益总计		1,495,521,417.69	1,478,944,741.54

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4212 元，基金份额总额

3,532,339,886.54 份

6.2 利润表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		119,289,131.44	-276,464,372.17
1.利息收入		2,084,027.04	2,451,214.60
其中：存款利息收入		581,108.78	1,313,265.62
债券利息收入		1,440,703.52	1,110,095.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		62,214.74	27,853.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-15,599,286.95	-93,474,424.93
其中：股票投资收益		-22,914,823.02	-95,458,897.74

基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,477,154.89	-551,500.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		8,792,690.96	2,535,972.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		132,688,639.14	-185,679,354.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		115,752.21	238,192.65
减：二、费用		26,500,925.24	23,642,339.57
1. 管理人报酬		10,919,131.93	11,676,563.58
2. 托管费		1,819,855.34	1,946,093.93
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		13,480,667.25	9,802,082.90
5. 利息支出		62,669.02	-
其中：卖出回购金融资产支出		62,669.02	-
6. 其他费用		218,601.70	217,599.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		92,788,206.20	-300,106,711.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,788,206.20	-300,106,711.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	1,492,801,799.29	-22,715,542.87	1,470,086,256.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	92,788,206.20	92,788,206.20
三、本期基金份额交易	-73,623,003.79	-1,360,480.02	-74,983,483.81

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	53,511,176.17	-124,575.78	53,386,600.39
2.基金赎回款	-127,134,179.96	-1,235,904.24	-128,370,084.20
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)	1,419,178,795.50	68,712,183.31	1,487,890,978.81
项目	上年度可比期间 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)	1,175,187,630.40	949,466,925.96	2,124,654,556.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-300,106,711.74	-300,106,711.74
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)	371,579,551.54	183,412.57	371,762,964.11
其中: 1.基金申购款	565,430,851.14	10,872,175.96	576,303,027.10
2.基金赎回款	-193,851,299.60	-10,688,763.39	-204,540,062.99
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)	-	-535,415,465.91	-535,415,465.91
五、期末所有者权益(基金净值)	1,546,767,181.94	114,128,160.88	1,660,895,342.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

黄鹏

宋宇

周琳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中海优质成长证券投资基金(以下简称“本基金”)原名国联优质成长证券投资基金,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[2004]92号《关于同意国联优质成长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“国联优质成长证券投资基金”更名为“中海优质成长证券投资基金”。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司;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2004年9月28日生效,该日的基金份额总额为1,017,619,728.79份,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2004]B152号验资报告予以验证。

本基金于2007年10月19日(拆分日)进行了基金份额拆分。当日,本基金拆分前基金份额净值为2.4891元,精确到小数点后第9位为2.489131393元,基金份额总额为1,480,631,490.88份,本基金管理人按照1:2.489131393的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。实施拆分后,拆分日基金份额净值调整为1.0000元,拆分后基金份额总额为3,685,486,326.68份,基金份额计算结果保留到小数点后2位,小数点2位后的部分截去,截去部分所代表的资产归基金资产所有。

本基金投资的标的物为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资的重点是中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长类公司。本基金投资组合的资产配置比例为:投资于股票的比例为30%-95%;债券和现金的比例为5%-70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为:沪深300指数*75%+上证国债指数*25%。

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》、《中海优质成长证券投资基金 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相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, 真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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[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。

(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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
交通银行股份有限公司	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

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	1,074,674,714.64	11.95%	390,788,492.61	6.05%

6.4.7.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国联证券	75,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.7.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	1,000,845.78	12.22%	200,997.20	5.79%
关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	363,942.55	6.24%	236,974.14	5.16%

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,919,131.93	11,676,563.58
其中：支付销售机构的客户维护费	3,297,109.59	3,548,948.96

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,819,855.34	1,946,093.93

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。

6.4.7.3 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

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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
交通银行股份有限公司	86,049,579.35	413,384.80	119,976,237.23	424,859.87

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与认购关联方承销证券。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.10.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	—
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	—
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	—
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	—
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	—
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	—
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	—
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	—
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	—

6.4.8.2 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
300087	荃银高科	2017 年 5 月 12 日	重大事项停牌	14.14	2017 年 8 月 10 日	9.80	995,718	12,474,702.83	14,079,452.52	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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。

6.4.8.3.2 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。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-

§ 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	1,307,572,775.44	87.43
	其中：股票	1,307,572,775.44	87.43
2	固定收益投资	294,703.50	0.02
	其中：债券	294,703.50	0.02
	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	89,056,364.53	5.95
	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	91,632,811.62	6.13
7	其他各项资产	6,964,762.60	0.47
8	合计	1,495,521,417.69	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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,079,452.52	0.95
B	采矿业	22,286,696.60	1.50
C	制造业	1,165,990,766.91	78.37
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	22,289,510.88	1.50
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	53,180,192.53	3.57
J	金融业	29,746,156.00	2.00
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	1,307,572,775.44	87.88

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	002450	康得新	4,035,947	90,889,526.44	6.11
2	300450	先导智能	1,429,497	74,005,059.69	4.97
3	002583	海能达	3,876,381	62,370,970.29	4.19
4	002460	赣锋锂业	1,221,600	56,499,000.00	3.80
5	002466	天齐锂业	993,581	54,001,127.35	3.63
6	300124	汇川技术	2,108,205	53,843,555.70	3.62
7	002456	欧菲光	2,936,877	53,363,055.09	3.59
8	300166	东方国信	3,959,237	53,172,552.91	3.57
9	600803	新奥股份	3,843,845	52,814,430.30	3.55
10	600031	三一重工	6,220,108	50,569,478.04	3.40

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	002450	康得新	108,120,205.59	7.35
2	600803	新奥股份	104,328,393.77	7.10
3	002074	国轩高科	98,459,161.81	6.70
4	600019	宝钢股份	89,523,818.96	6.09
5	300124	汇川技术	88,313,301.37	6.01
6	000799	酒鬼酒	82,749,881.19	5.63
7	000651	格力电器	81,215,137.71	5.52
8	600031	三一重工	79,226,231.04	5.39
9	600340	华夏幸福	75,496,279.92	5.14
10	600110	诺德股份	73,829,651.40	5.02
11	300450	先导智能	71,807,173.95	4.88
12	600066	宇通客车	65,940,071.63	4.49
13	601117	中国化学	65,048,504.98	4.42
14	600219	南山铝业	63,605,467.00	4.33
15	600104	上汽集团	60,959,992.51	4.15
16	002583	海能达	60,279,363.29	4.10
17	600519	贵州茅台	59,292,162.54	4.03
18	600428	中远海特	58,156,842.02	3.96

19	601919	中远海控	55,528,863.06	3.78
20	002430	杭氧股份	55,301,593.59	3.76
21	002466	天齐锂业	53,892,548.07	3.67
22	600779	水井坊	53,169,602.83	3.62
23	002460	赣锋锂业	52,941,456.80	3.60
24	002456	欧菲光	52,078,510.95	3.54
25	601766	中国中车	51,652,940.19	3.51
26	300166	东方国信	51,248,888.23	3.49
27	000568	泸州老窖	48,005,536.76	3.27
28	600399	抚顺特钢	47,611,675.65	3.24
29	603338	浙江鼎力	47,242,539.90	3.21
30	000811	烟台冰轮	46,886,894.16	3.19
31	600426	华鲁恒升	45,992,990.54	3.13
32	600309	万华化学	45,744,996.08	3.11
33	000063	中兴通讯	44,854,926.10	3.05
34	601186	中国铁建	44,690,717.02	3.04
35	002636	金安国纪	44,459,262.44	3.02
36	000625	长安汽车	44,314,773.86	3.01
37	300164	通源石油	43,754,446.73	2.98
38	600029	南方航空	43,746,465.00	2.98
39	300316	晶盛机电	43,654,815.89	2.97
40	002142	宁波银行	42,912,692.05	2.92
41	600887	伊利股份	42,648,325.00	2.90
42	601689	拓普集团	42,155,061.96	2.87
43	300087	荃银高科	41,894,306.12	2.85
44	002081	金螳螂	41,739,058.59	2.84
45	601989	中国重工	41,559,582.00	2.83
46	002041	登海种业	41,382,015.75	2.81
47	000983	西山煤电	39,641,932.04	2.70
48	601933	永辉超市	39,309,590.00	2.67
49	000898	鞍钢股份	38,790,424.47	2.64
50	000725	京东方A	38,492,926.00	2.62
51	600028	中国石化	38,219,640.00	2.60
52	601800	中国交建	37,661,764.44	2.56
53	600015	华夏银行	36,951,276.99	2.51
54	601168	西部矿业	36,596,958.65	2.49

55	600307	酒钢宏兴	36,261,052.98	2.47
56	600511	国药股份	34,730,293.14	2.36
57	002391	长青股份	34,691,964.00	2.36
58	601225	陕西煤业	33,578,618.70	2.28
59	000930	中粮生化	33,168,401.22	2.26
60	002332	仙琚制药	32,866,514.50	2.24
61	000970	中科三环	32,559,788.07	2.21
62	600486	扬农化工	31,407,902.60	2.14
63	601633	长城汽车	31,378,295.50	2.13
64	601233	桐昆股份	30,955,991.75	2.11
65	601336	新华保险	30,550,306.09	2.08
66	600977	中国电影	30,417,726.00	2.07
67	603993	洛阳钼业	30,129,670.00	2.05
68	600585	海螺水泥	29,522,108.19	2.01

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	002074	国轩高科	104,055,725.36	7.08
2	600340	华夏幸福	103,788,861.01	7.06
3	600110	诺德股份	99,813,081.26	6.79
4	000799	酒鬼酒	78,440,458.44	5.34
5	000983	西山煤电	77,426,293.48	5.27
6	002142	宁波银行	74,740,064.61	5.08
7	002391	长青股份	71,078,612.56	4.83
8	600028	中国石化	69,811,284.21	4.75
9	000630	铜陵有色	69,483,714.34	4.73
10	600066	宇通客车	66,649,801.74	4.53
11	600019	宝钢股份	64,807,893.19	4.41
12	601117	中国化学	63,557,127.31	4.32
13	600426	华鲁恒升	63,347,471.21	4.31
14	600428	中远海特	62,579,904.83	4.26
15	000651	格力电器	62,031,049.65	4.22
16	300011	鼎汉技术	60,938,816.74	4.15

17	300164	通源石油	60,682,134.08	4.13
18	601919	中远海控	58,172,310.11	3.96
19	601336	新华保险	58,137,801.38	3.95
20	601009	南京银行	57,088,327.44	3.88
21	601699	潞安环能	55,887,995.76	3.80
22	600486	扬农化工	53,862,725.02	3.66
23	600803	新奥股份	53,547,213.51	3.64
24	600104	上汽集团	52,091,743.49	3.54
25	601766	中国中车	50,331,256.71	3.42
26	600779	水井坊	50,234,588.34	3.42
27	000338	潍柴动力	49,515,136.67	3.37
28	600731	湖南海利	49,483,183.69	3.37
29	601600	中国铝业	48,113,443.60	3.27
30	600029	南方航空	46,639,167.14	3.17
31	601186	中国铁建	45,327,139.50	3.08
32	002353	杰瑞股份	45,123,000.83	3.07
33	000811	烟台冰轮	44,893,200.70	3.05
34	300124	汇川技术	44,407,294.60	3.02
35	600887	伊利股份	43,200,734.42	2.94
36	601989	中国重工	42,594,843.84	2.90
37	000688	建新矿业	42,581,965.51	2.90
38	000625	长安汽车	42,333,025.66	2.88
39	002636	金安国纪	42,289,583.02	2.88
40	600399	抚顺特钢	41,636,242.57	2.83
41	002081	金螳螂	40,799,113.83	2.78
42	002332	仙琚制药	40,761,144.60	2.77
43	000059	华锦股份	40,747,323.28	2.77
44	002570	贝因美	40,241,123.47	2.74
45	600307	酒钢宏兴	39,815,831.50	2.71
46	000709	河钢股份	38,501,027.98	2.62
47	000937	冀中能源	38,381,389.44	2.61
48	002041	登海种业	38,106,402.69	2.59
49	000060	中金岭南	37,775,184.81	2.57
50	000725	京东方A	37,597,031.42	2.56
51	601800	中国交建	37,425,202.74	2.55
52	600031	三一重工	37,316,415.31	2.54
53	600015	华夏银行	36,675,990.59	2.49
54	600497	驰宏锌锗	36,079,391.69	2.45

55	601233	桐昆股份	35,687,558.81	2.43
56	600511	国药股份	34,637,844.18	2.36
57	300121	阳谷华泰	33,462,395.81	2.28
58	601225	陕西煤业	32,839,215.03	2.23
59	002450	康得新	32,063,137.40	2.18
60	002258	利尔化学	31,810,304.78	2.16
61	000930	中粮生化	31,630,185.80	2.15
62	300087	荃银高科	31,607,904.53	2.15
63	601633	长城汽车	31,606,773.94	2.15
64	300203	聚光科技	31,548,303.21	2.15
65	601997	贵阳银行	31,132,962.98	2.12
66	600141	兴发集团	30,958,736.12	2.11
67	000970	中科三环	29,534,878.61	2.01

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	4,502,936,952.54
卖出股票收入（成交）总额	4,492,311,851.38

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	294,703.50	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127004	模塑转债	2,550	294,703.50	0.02

7.7 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性证券。

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	977,081.93
2	应收证券清算款	5,776,563.74
3	应收股利	—
4	应收利息	40,902.77
5	应收申购款	170,214.16
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,964,762.60

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
116,790	30,245.23	6,343,888.57	0.18%	3,525,995,997.97	99.82%

8.3 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	24,962.34	0.0007%

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

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（2004年9月28日）基金份额总额	1,017,619,728.79
本报告期期初基金份额总额	3,715,591,529.48
本报告期基金总申购份额	133,190,749.14

减:本报告期基金总赎回份额	316,442,392.08
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	3,532,339,886.54

§ 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。

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

本基金管理人改聘了为基金进行审计的会计师事务所，为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

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。

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	
银河证券	1	2,463,619,410.42	27.40%	2,294,366.52	28.02%	-
申万宏源	2	1,514,285,085.09	16.84%	1,410,253.38	17.22%	-
国联证券	2	1,074,674,714.64	11.95%	1,000,845.78	12.22%	-
海通证券	2	1,003,806,435.29	11.16%	934,847.78	11.42%	-
光大证券	1	523,985,299.90	5.83%	487,987.41	5.96%	-
国泰君安	1	505,663,588.14	5.62%	369,792.95	4.52%	-
中信建投	2	500,448,433.43	5.57%	466,067.17	5.69%	-
长江证券	1	435,270,203.87	4.84%	405,368.38	4.95%	-
东方证券	1	288,608,753.45	3.21%	268,782.09	3.28%	-
华泰证券	1	205,816,275.97	2.29%	191,677.74	2.34%	-
西南证券	1	181,259,665.10	2.02%	132,553.37	1.62%	-
兴业证券	1	136,754,769.55	1.52%	100,007.92	1.22%	-
民生证券	1	102,079,073.84	1.14%	74,650.71	0.91%	-
中信证券	1	31,177,619.29	0.35%	29,036.43	0.35%	-
中金公司	2	24,695,459.98	0.27%	22,999.06	0.28%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	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：本报告期内退租了中投证券的上海和深圳交易单元；新增了西南证券、上海证券、太平洋证券的上海交易单元，以及海通证券、太平洋证券的深圳交易单元；因华泰联合证券合并入华泰证券，原华泰联合证券下交易单元全部转入华泰证券；因申银万国证券与宏源证券合并，更名为申万宏源证券，但交易单元暂时不合并，仍分开使用。

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
银河证券	8,211,916.90	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	75,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

中海基金管理有限公司
2017 年 8 月 29 日