

# 中海环保新能源主题灵活配置混合型证券 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)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	中海环保新能源混合
基金主代码	398051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 9 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67, 416, 426. 02 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在全球环境状况不断恶化、气候逐渐变暖以及我国节能减排压力日益突出的背景下，以环保为投资主题，重点关注具有环保责任和环保意识、并同时具有成长潜力的环保产业和新能源产业以及具有环保竞争优势的行业和企业，充分分享国内环保业和新能源产业发展带来的投资机会，并精选个股，结合积极地权重配置，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、一级资产配置</p> <p>一级资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，主要考虑宏观经济周期状况，宏观政策情况，市场估值，市场情绪等四方面因素。通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。</p> <p>2、行业/久期配置</p> <p>行业配置：本基金以环保行业配置和新能源行业配置为主，其中环保行业配置采取以行业环保水平为主要配置原则的倒金字塔环保行业配置。</p> <p>久期配置：债券组合的久期配置采用自上而下的方法。</p> <p>3、股票投资</p> <p>本基金 80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略。</p> <p>4、债券投资</p> <p>本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时</p>

	<p>兼顾资本利得，谋取超额收益。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，利用 Black-Scholes-Merton 模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，权证投资策略主要从价值投资的角度出发。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数涨跌幅 $\times$ 60% + 中国债券总指数涨跌幅 $\times$ 40%
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。</p> <p>本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军
	联系电话	021-38429808
	电子邮箱	huangle jun@zhfund. com
客户服务电话	400-888-9788、 021-38789788	95588
传真	021-68419525	010-66105798

### 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(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	8,168,977.75
本期利润	11,269,390.89
加权平均基金份额本期利润	0.1307
本期基金份额净值增长率	9.99%
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	-0.1412
期末基金资产净值	57,898,825.53
期末基金份额净值	0.859

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	0.00%	0.85%	3.50%	0.56%	-3.50%	0.29%
过去三个月	-5.81%	1.16%	-0.39%	0.74%	-5.42%	0.42%
过去六个月	9.99%	1.31%	16.57%	0.82%	-6.58%	0.49%
过去一年	-3.81%	1.29%	8.56%	0.86%	-12.37%	0.43%
过去三年	-3.27%	1.18%	17.92%	0.65%	-21.19%	0.53%
自基金合同生效起至今	-14.10%	1.41%	36.16%	0.87%	-50.26%	0.54%

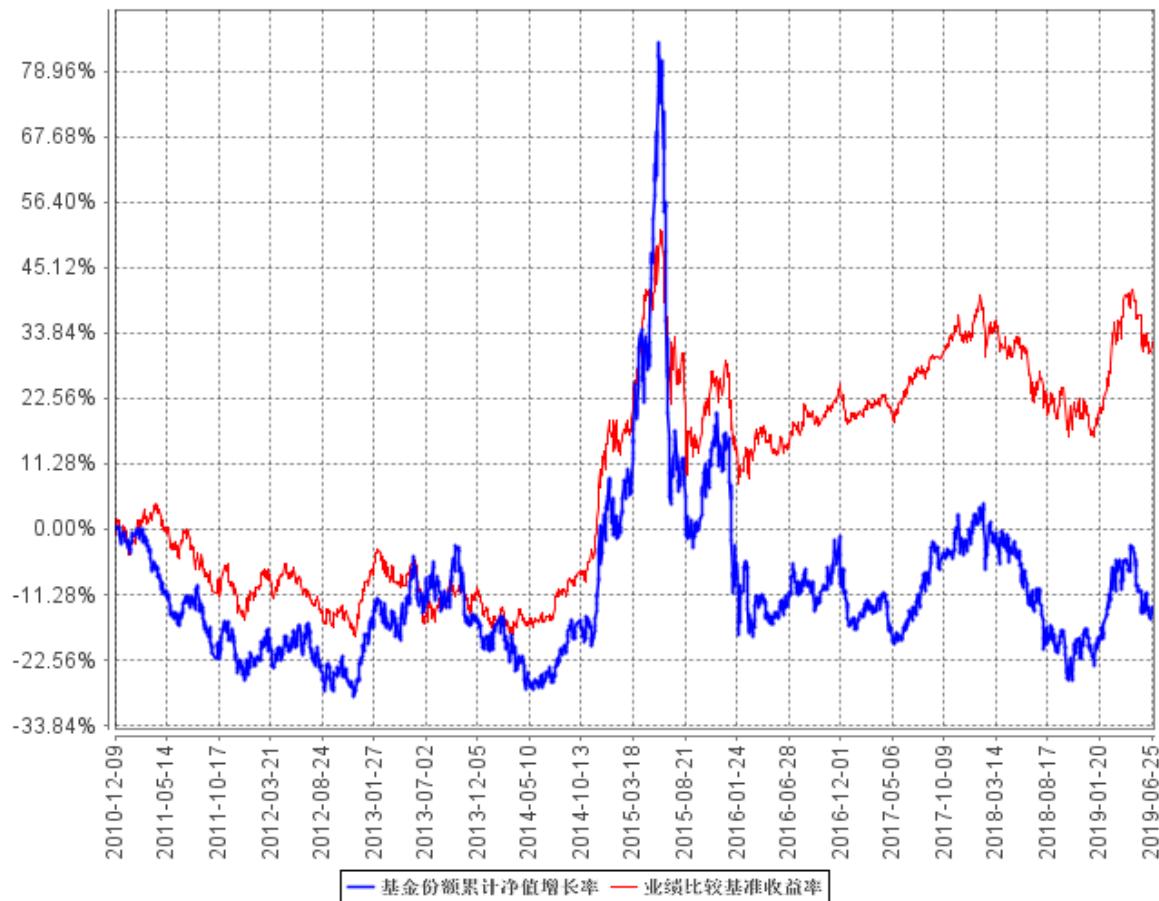
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2010 年 12 月 9 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数涨跌幅  $\times$  60% + 中国债券总指数涨跌幅  $\times$  40%，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、中国债券总指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金股票资产占基金资产的比例为 30%—80%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 60% 左右，债券投资比例控制在 40% 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 60%、40%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



## § 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		
刘俊	本基金基金经理、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海信息产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海添顺定期开放混合型	2018 年 6 月 2 日	-	16 年	刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007 年 3 月进入本公司工作，曾任产品开发总监。2010 年 3 月至 2015 年 8 月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2017 年 6 月任中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金基金经理，2012 年 6 月至 2019 年 4 月任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至今任中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 12 月至今任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理。

证券投资基金基金经理、中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理				理, 2018 年 1 月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 6 月至今任中海环保新能源主题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遵规守信情况的说明

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

上半年经济数据整体平稳。二季度经济增长比首季度较弱。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。5 月 CPI 同比上涨 2.7%，创 15 个月新高。对通胀的担忧对市场产生影响。

年初时习近平主席提出了金融供给侧改革理念，强调要深化对国际国内金融形势的认识，正确把握金融本质，深化金融供给侧结构性改革，平衡好稳增长和防风险的关系，精准有效处置重点领域风险，深化金融改革开放，增强金融服务实体经济能力，坚决打好防范化解包括金融风险在内的重大风险攻坚战，推动我国金融业健康发展。

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。二季度内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》，科创板正式宣布开板。

国际环境方面，中美贸易谈判跌宕起伏，中美关系蜜月期已经一去不复返。中美如何“竞合”将是彼此需要长期探求的问题。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。

行业方面，上半年内新能源汽车产业财政年度补贴政策正式明确，国补总量较去年退坡 50%以上。国家电网提出泛在电力物联网建设的概念并在未来加强投资建设。4 月国家能源局网站发布《关于 2019 年风电、光伏发电建设管理有关要求的通知（征求意见稿）》，正式对风光补贴政策进行征求意见。5 月国家发展改革委办公厅、国家能源局综合司发布关于公布 2019 年第一批风电、光伏发电平价上网项目的通知。

A 股市场上半年呈现冲高回落的走势。年初在中美贸易谈判改善、经济企稳复苏的预期下，市场整体反弹明显。五一之后，伴随预期的落空，上证指数重新回到了 3000 点下方。在此过程中，以消费、医药和部分制造龙头企业为代表的核心资产板块，因其稳定增长的业绩以及外资的持续配置成为资金首选、表现突出。光伏和新能源汽车行业板块因为政策原因表现欠佳。

上半年内整体操作平稳，季度内股票资产配置光伏、风电、新能源汽车网等子行业龙头上市公司，债券资产主要配置国债和新能源行业可转债。

#### 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 0.859 元(累计净值 0.859 元)。报告期内本基金净值增长率为 9.99%，低于业绩比较基准 6.58 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

经济数据与政策指向的变化是证券市场最重要的影响因素。下半年内经济数据能否继续平稳增长，物价数据能否如期回落，监管政策如何变化，这些宏观问题将是市场持续关注的焦点。下半年中美贸易谈判进展和全球各央行的货币政策调整措施也会对金融市场产生持续影响。新能源汽车销量和光伏风电的装机量将直接影响相关上市公司的业绩和股价走势。

对上述各种因素我们保持实时跟踪，将根据宏观背景变化调整权益资产配置比例，继续以光伏、风电和新能源汽车行业龙头品种为主要配置方向。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：中海环保新能源主题灵活配置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	5, 125, 663. 77	2, 849, 351. 66
结算备付金		199, 355. 25	215, 106. 80
存出保证金		43, 776. 27	120, 194. 68
交易性金融资产	6.4.7.2	52, 469, 315. 77	83, 889, 166. 87
其中：股票投资		40, 559, 595. 27	62, 629, 073. 77
基金投资		—	—
债券投资		11, 909, 720. 50	21, 260, 093. 10
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		280, 889. 86	2, 757, 837. 55
应收利息	6.4.7.5	89, 570. 68	1, 161, 240. 21
应收股利		—	—
应收申购款		24, 497. 36	24, 710. 02
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		58, 233, 068. 96	91, 017, 607. 79
<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		52, 228. 38	36, 392. 62
应付管理人报酬		70, 754. 83	120, 011. 39
应付托管费		11, 792. 47	20, 001. 90
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	75, 993. 02	118, 164. 24
应交税费		62. 27	—

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	123,412.46	156,990.93
负债合计		334,243.43	451,561.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	67,416,426.02	116,018,928.22
未分配利润	6.4.7.10	-9,517,600.49	-25,452,881.51
所有者权益合计		57,898,825.53	90,566,046.71
负债和所有者权益总计		58,233,068.96	91,017,607.79

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.859 元，基金份额总额 67,416,426.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海环保新能源主题灵活配置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>		12,336,104.70	-12,678,863.32
1.利息收入		186,055.15	1,052,584.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,264.51	90,214.47
债券利息收入		159,659.13	962,370.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,131.51	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,982,561.52	-9,706,824.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,836,538.80	-10,522,073.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,920.50	-21,034.34
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	129,102.22	836,283.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,100,413.14	-4,107,920.17
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	67,074.89	83,296.48
<b>减：二、费用</b>		1,066,713.81	6,819,304.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	560,772.73	1,456,095.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	93,462.19	242,682.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	341, 590. 68	5, 043, 979. 74
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		48. 65	—
7. 其他费用	6.4.7.20	70, 839. 56	76, 547. 47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11, 269, 390. 89	-19, 498, 168. 07
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11, 269, 390. 89	-19, 498, 168. 07

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海环保新能源主题灵活配置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)	116, 018, 928. 22	-25, 452, 881. 51	90, 566, 046. 71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	11, 269, 390. 89	11, 269, 390. 89
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)	-48, 602, 502. 20	4, 665, 890. 13	-43, 936, 612. 07
其中：1.基金申购款	19, 417, 012. 71	-1, 932, 813. 76	17, 484, 198. 95
2.基金赎回款	-68, 019, 514. 91	6, 598, 703. 89	-61, 420, 811. 02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	67, 416, 426. 02	-9, 517, 600. 49	57, 898, 825. 53
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)	190,441,752.13	-1,402,870.91	189,038,881.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,498,168.07	-19,498,168.07
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)	-29,934,740.69	3,662,345.51	-26,272,395.18
其中：1.基金申购款	67,002,266.29	-594,780.16	66,407,486.13
2.基金赎回款	-96,937,006.98	4,257,125.67	-92,679,881.31
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)	160,507,011.44	-17,238,693.47	143,268,317.97

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

中海环保新能源主题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[2010]1205 号《关于核准中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准募集。

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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司；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 2010 年 12 月 9 日生效，该日的基金份额总额为 946,086,141.06 份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2010]B133 号验资报告予以验证。

根据《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资范

局限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%。

#### 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未发生重大会计差错。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

## 6.4.8 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	3,317,766.84	1.41%	103,910,833.17	3.02%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国联证券	607,385.90	1.17%	20,082,725.60	29.98%

#### 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	3,089.83	1.66%	-	-
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日				
关联方名称	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	96,771.86	3.22%	24,311.92	2.35%

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	560,772.73	1,456,095.01
其中：支付销售机构的客户维护费	193,473.79	208,115.16

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	93,462.19	242,682.53

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

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。

#### 6.4.8.4.2 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	期末余额	2018年1月1日至2018年6月30日	当期利息收入
工商银行	5,125,663.77	20,102.19	18,971,556.44	59,189.99

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 1,654.79 元(2018 年半年度：人民币 25,223.64 元)，2019 年 6 月末结算备付金余额为人民币 199,355.25 元(2018 年 6 月末：人民币 2,056,306.58 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。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 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	-

##### 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购金融资产款余额。

#### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖  
出回购金融资产款余额。

## § 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	40,559,595.27	69.65
	其中：股票	40,559,595.27	69.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	11,909,720.50	20.45
	其中：债券	11,909,720.50	20.45
	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	5,325,019.02	9.14
8	其他各项资产	438,734.17	0.75
9	合计	58,233,068.96	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	35,859,566.13	61.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,826,196.00	3.15
E	建筑业	367,994.00	0.64
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	2,471,969.20	4.27
J	金融业	33,869.94	0.06
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	40,559,595.27	70.05

### 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	601012	隆基股份	175,358	4,052,523.38	7.00
2	300450	先导智能	79,700	2,677,920.00	4.63
3	600406	国电南瑞	131,200	2,445,568.00	4.22
4	300750	宁德时代	34,200	2,355,696.00	4.07
5	002594	比亚迪	40,500	2,054,160.00	3.55
6	002202	金风科技	137,700	1,711,611.00	2.96
7	600438	通威股份	116,719	1,641,069.14	2.83
8	300316	晶盛机电	124,600	1,581,174.00	2.73
9	600089	特变电工	203,100	1,472,475.00	2.54
10	002129	中环股份	150,400	1,467,904.00	2.54

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	002249	大洋电机	9,337,430.00	10.31
2	300001	特锐德	4,360,683.00	4.81
3	002639	雪人股份	4,237,950.00	4.68
4	600438	通威股份	4,096,705.00	4.52
5	002158	汉钟精机	3,867,775.00	4.27
6	002812	恩捷股份	3,516,157.46	3.88
7	300316	晶盛机电	3,429,941.89	3.79
8	002594	比亚迪	3,294,500.00	3.64
9	002341	新纶科技	3,215,769.00	3.55
10	300750	宁德时代	3,071,424.00	3.39

11	002129	中环股份	3,056,955.00	3.38
12	300073	当升科技	3,003,768.00	3.32
13	002733	雄韬股份	2,838,473.00	3.13
14	300450	先导智能	2,730,841.00	3.02
15	600273	嘉化能源	2,646,753.00	2.92
16	300274	阳光电源	2,482,791.00	2.74
17	600549	厦门钨业	2,183,425.70	2.41
18	002407	多氟多	2,006,617.00	2.22
19	300365	恒华科技	1,935,743.30	2.14
20	601012	隆基股份	1,866,399.50	2.06
21	300129	泰胜风能	1,865,801.76	2.06
22	300751	迈为股份	1,859,638.00	2.05

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	002249	大洋电机	8,654,323.00	9.56
2	600438	通威股份	8,220,400.69	9.08
3	002594	比亚迪	6,692,445.69	7.39
4	300750	宁德时代	5,480,108.20	6.05
5	300316	晶盛机电	5,177,454.56	5.72
6	300274	阳光电源	5,040,759.00	5.57
7	002050	三花智控	4,767,718.40	5.26
8	300073	当升科技	4,684,860.40	5.17
9	300001	特锐德	4,346,047.00	4.80
10	002639	雪人股份	4,276,516.00	4.72
11	600406	国电南瑞	4,111,965.34	4.54
12	002129	中环股份	4,100,368.00	4.53
13	601012	隆基股份	3,946,378.00	4.36
14	300124	汇川技术	3,816,182.50	4.21
15	002158	汉钟精机	3,604,367.00	3.98
16	002202	金风科技	3,542,276.90	3.91
17	600089	特变电工	3,474,986.73	3.84
18	601877	正泰电器	3,447,090.48	3.81

19	002460	赣锋锂业	3,331,942.60	3.68
20	002812	恩捷股份	3,317,948.50	3.66
21	002341	新纶科技	3,212,372.00	3.55
22	600884	杉杉股份	3,078,020.00	3.40
23	002733	雄韬股份	3,035,678.00	3.35
24	601222	林洋能源	2,973,952.84	3.28
25	002466	天齐锂业	2,475,441.50	2.73
26	600273	嘉化能源	2,025,061.00	2.24
27	601985	中国核电	2,019,226.04	2.23
28	300129	泰胜风能	1,943,284.59	2.15
29	601727	上海电气	1,883,287.00	2.08
30	300751	迈为股份	1,870,800.00	2.07

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	101,338,601.99
卖出股票收入（成交）总额	134,768,944.77

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	7,188,293.60	12.42
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）	4,721,426.90	8.15
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	11,909,720.50	20.57

#### 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	019611	19 国债 01	49,080	4,904,073.60	8.47
2	020292	19 贴债 15	14,000	1,384,040.00	2.39
3	113015	隆基转债	10,000	1,277,400.00	2.21
4	113008	电气转债	10,570	1,195,678.40	2.07
5	110054	通威转债	9,350	1,148,273.50	1.98

## 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 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	43,776.27
2	应收证券清算款	280,889.86
3	应收股利	—
4	应收利息	89,570.68
5	应收申购款	24,497.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	438,734.17

### 7.12.4 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 (%)
1	113015	隆基转债	1,277,400.00	2.21
2	113008	电气转债	1,195,678.40	2.07
3	123017	寒锐转债	681,800.00	1.18
4	113016	小康转债	418,275.00	0.72

### 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
8,700	7,749.01	2,055,693.18	3.05%	65,360,732.84	96.95%

### 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	85.55	0.0001%

### 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（2010 年 12 月 9 日）基金份额总额	946, 086, 141. 06
本报告期期初基金份额总额	116, 018, 928. 22
本报告期基金总申购份额	19, 417, 012. 71
减: 本报告期基金总赎回份额	68, 019, 514. 91
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	67, 416, 426. 02

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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行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	
天风证券	2	56,223,020.96	23.97%	41,116.31	22.13%	-
西藏东方财富 证券	2	42,416,456.44	18.08%	31,019.18	16.70%	-
国泰君安	2	30,849,991.37	13.15%	28,730.55	15.46%	-
方正证券	1	27,436,321.44	11.70%	20,064.10	10.80%	-
长江证券	1	26,142,847.48	11.15%	24,346.85	13.10%	-
川财证券	1	25,358,842.64	10.81%	18,544.94	9.98%	-
海通证券	2	7,598,349.00	3.24%	5,556.48	2.99%	-
广发证券	1	4,847,766.00	2.07%	4,514.72	2.43%	-
华金证券	1	4,244,118.08	1.81%	3,103.71	1.67%	-

申万宏源	1	3,493,019.43	1.49%	3,253.16	1.75%	-
国联证券	1	3,317,766.84	1.41%	3,089.83	1.66%	-
中金公司	1	2,079,293.00	0.89%	1,936.53	1.04%	-
光大证券	1	555,001.00	0.24%	516.88	0.28%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	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；退租了国海证券的上海交易单元。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承

担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：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
天风证券	26,599,331.08	51.20%	—	—	—	—
西藏东方财富证券	1,478,478.00	2.85%	—	—	—	—
国泰君安	7,941,087.50	15.28%	—	—	—	—
方正证券	1,476,890.30	2.84%	—	—	—	—
长江证券	10,691,971.00	20.58%	5,800,000.00	100.00%	—	—
川财证券	110,397.52	0.21%	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	330,003.54	0.64%	—	—	—	—
华金证券	201,442.00	0.39%	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
国联证券	607,385.90	1.17%	—	—	—	—
中金公司	1,342,679.50	2.58%	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
高华证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
万联证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—

华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,173,988.60	2.26%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-1-1 至 2019-3-13	29,555,665.02	0.00	29,555,665.02	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

中海基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日