

# 中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 28 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 2019 年 3 月 20 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 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       | 中海蓝筹混合           |
| 基金主代码      | 398031           |
| 前端交易代码     | 398031           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2008 年 12 月 3 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 | 111,176,481.60 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 通过研究股票市场和债券市场的估值水平和价格波动，调整股票、固定收益资产的投资比例，优先投资于沪深 300 指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高、价值相对低估的上市公司以及收益率相对较高的固定收益类品种，适当配置部分具备核心优势和高成长性的中小企业，兼顾资本利得和当期利息收益，谋求基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资策略   | <p>一级资产配置：根据股票和债券估值的相对吸引力模型(ASSVM, A Share Stocks Valuation Model)，动态调整一级资产的权重配置。</p> <p>股票投资：采取核心—卫星投资策略(Core-Satellite Strategy)，核心组合以沪深 300 指数的成份股和备选成份股中权重较大、基本面较好、流动性较高的上市公司为标的，利用“中海综合估值模型”，精选其中价值相对被低估的优质上市公司；卫星组合关注 A 股市场中具备核心优势和高成长性的中小企业，自下而上、精选个股，获取超越市场平均水平的收益。</p> <p>债券投资：从宏观经济入手，采用自上而下的分析方式，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期的选择。在久期确定的基础上，重点选择流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种，采取积极主动的投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×60%+中债国债指数×40%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 风险收益特征 | <p>本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险品种。</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、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<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 | 2018 年         | 2017 年        | 2016 年         |
|---------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益       | -13,139,320.45 | 11,416,878.84 | -39,989,817.38 |
| 本期利润          | -20,677,743.25 | 21,372,656.83 | -71,268,628.28 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1860        | 0.1586        | -0.3628        |
| 本期基金份额净值增长率   | -23.11%        | 23.94%        | -35.20%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末        | 2017 年末       | 2016 年末        |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3710        | -0.1819       | -0.3399        |
| 期末基金资产净值      | 69,929,304.88  | 96,758,324.63 | 99,893,982.38  |
| 期末基金份额净值      | 0.6290         | 0.8181        | 0.6601         |

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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -8.87%   | 1.71%       | -6.09%     | 0.97%         | -2.78%  | 0.74% |
| 过去六个月      | -11.12%  | 1.70%       | -7.04%     | 0.89%         | -4.08%  | 0.81% |
| 过去一年       | -23.11%  | 1.56%       | -12.67%    | 0.80%         | -10.44% | 0.76% |
| 过去三年       | -38.26%  | 1.47%       | -7.75%     | 0.71%         | -30.51% | 0.76% |
| 过去五年       | 6.02%    | 1.72%       | 34.68%     | 0.92%         | -28.66% | 0.80% |
| 自基金合同生效起至今 | 73.35%   | 1.45%       | 65.25%     | 0.93%         | 8.10%   | 0.52% |

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2008 年 12 月 3 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×60%+中债国债指数×40%，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、中债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%-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。

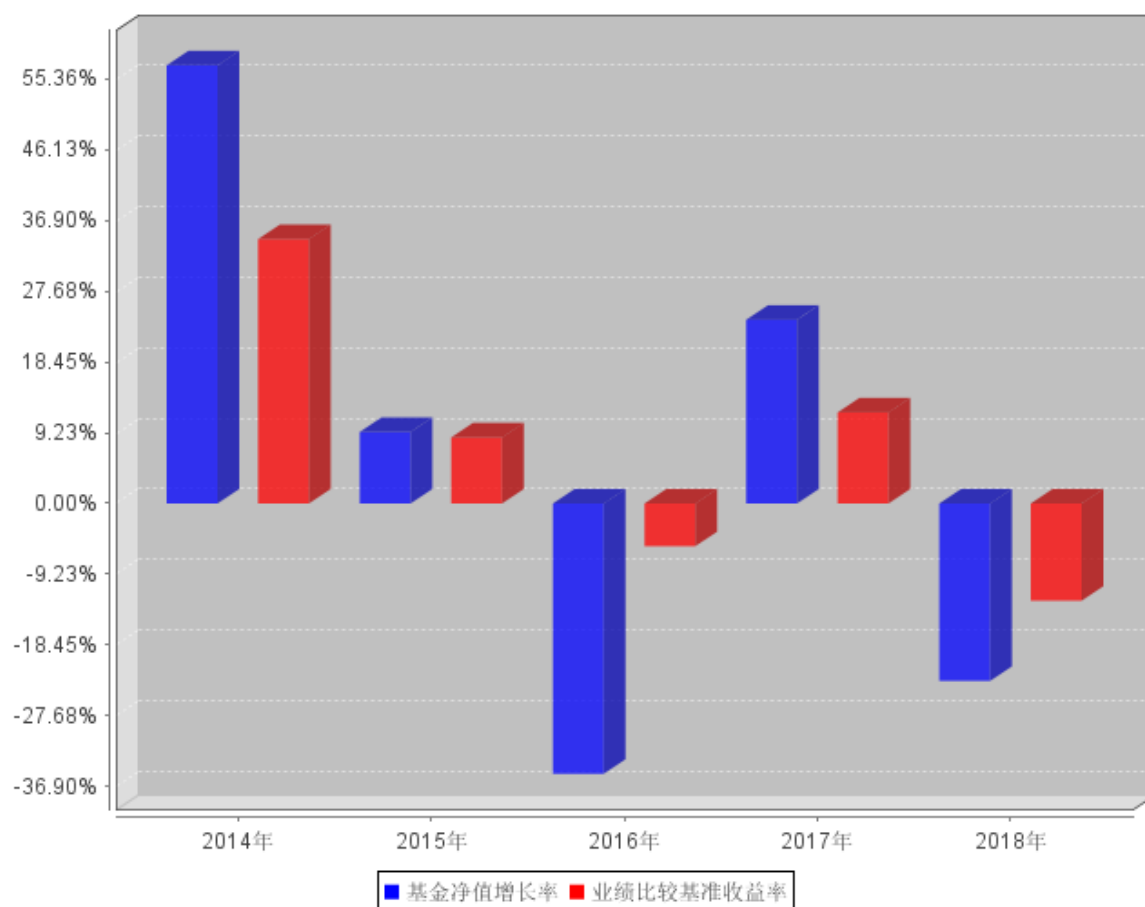
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度   | 每10份基金份额<br>分红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注  |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|-----|
| 2018 | -               | -             | -             | -             | 注：- |
| 2017 | -               | -             | -             | -             | 注：- |
| 2016 | 0.7000          | 10,197,275.20 | 4,092,497.87  | 14,289,773.07 | 注：- |
| 合计   | 0.7000          | 10,197,275.20 | 4,092,497.87  | 14,289,773.07 | 注：- |

## § 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 2018 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 邱红丽 | 研究部副总经理、本基金基金经理、中海分红增利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 3 月 20 日 | -    | 8 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，现任研究部副总经理。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》，公司制定了《中海基金管理有限公司公平交易管理制度》，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，并由公司对询价收益率偏离、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，由公司暂时关闭投资风控系统的特定阈值。完成该交易后，公司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）公司对所有组合本报告期内日内、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

本报告期内，公司遵循《中海基金管理有限公司公平交易管理制度》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，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

2018 年初由于市场对全球经济复苏以及国内经济增长情况预期偏于乐观，加之对国内金融去杠杆力度估计不足，再叠加对中美贸易冲突预计和认知的不足，导致市场在年初的反弹以后，出现大幅度的下跌，之后市场到年底一直整体出现下跌的走势，期间几度市场出现恐慌情绪。在此期间政府出台了一系列的稳定经济增长和稳定市场的政策。监管层政策导向逐步变化，更多关注稳增长而不是去杠杆。美联储连续加息后，央行释放流动性以做应对，资产管理新规也暂缓实施。政府决策层推出系列政策，包括全民减税和对民营经济支持政策等。习近平同志在北京人民大会堂主持召开民营企业座谈会并发表重要讲话，提出正确认识当前民营经济发展遇到的困难和问题，要大力支持民营企业发展壮大。习近平同志还在首届中国国际进口博览会开幕式的主旨

演讲中提出要加大经济开放力度，另外将在上海证券交易所设立科创板并试点注册制。另一方面中美贸易冲突在不断扩大和升级后在年底前出现缓和的迹象。

本基金在 18 年一直坚持蓝筹+成长配置的投资策略，全年配置了能够保持持续增长的蓝筹股和成长股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值 0.6290 元（累计净值 1.8340 元）。报告期内本基金净值增长率为-23.11%，低于业绩比较基准 10.44 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，经济预计继续在底部徘徊。物价水平将有所回升。政策方面，将继续关注财政政策稳增长和央行货币政策推动金融市场去杠杆的节奏和力度。另外经济结构调整与转型仍然是社会关注的主题。海外经济体特别是美国的经济增长情况，以及中美贸易摩擦的发展和变化情况将会对国内以及全球经济格局产生持续重要的影响。

对于 2019 年市场总体的判断是：不悲观。目前市场的位置不论是对经济增长情况、金融去杠杆情况还是对中美贸易摩擦情况的预期总体上已有所体现。虽然以上情况还存在一定的不确定性，但如果总体情况没有大的恶化，或者有新的超预期的不利于市场的情况发生，市场总体大幅下跌的可能性不大。而另一方面，货币政策持续相对宽松、政府对市场的呵护和资产配置荒的大背景下，以及政府的一系列稳经济的政策出台和落实的情况下，我们对 2019 年市场整体的表现不必悲观。

我们预计 2019 年经济结构转型仍然是贯穿全年的投资方向。2019 年预计市场投资机会较大的行业还是在国家一直倡导和扶持的新兴产业中，和国家战略发展的规划布局中（如新经济、新能源、新消费、5G 等等）。

#### 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合规守信情况声明

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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合规守信、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     | 安永华明（2019）审字第 61372718_B06 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         | 中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 审计意见            | <p>我们审计了后附的中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。</p>                                           |
| 形成审计意见的基础       | <p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                         |
| 其他信息            | <p>中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中海蓝筹灵活配置混合型证券</p>                                                                                                                                                         |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能</p> |

|           |                                                                                                                                                                |     |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>导致中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                             |     |
| 注册会计师的姓名  | 徐艳                                                                                                                                                             | 蔺育化 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室                                                                                                                            |     |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 26 日                                                                                                                                                |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 289,676.78                      | 1,088,826.26                     |
| 结算备付金           |            | 99,081.33                       | 440,773.65                       |
| 存出保证金           |            | 29,987.47                       | 68,737.62                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 68,903,865.60                   | 94,580,037.74                    |
| 其中：股票投资         |            | 54,580,414.50                   | 74,896,731.14                    |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 14,323,451.10                   | 19,683,306.60                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 85,661.42                       | 288,287.03                       |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 806,380.09                      | 722,159.99                       |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 32,140.49                       | 19,747.06                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 70,246,793.18                   | 97,208,569.35                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 81,132.05                       | 70,712.39                        |
| 应付管理人报酬         |            | 90,845.75                       | 122,973.40                       |
| 应付托管费           |            | 15,140.93                       | 20,495.58                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 79,821.03                       | 185,408.40                       |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 50,548.54      | 50,654.95      |
| 负债合计          |          | 317,488.30     | 450,244.72     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 111,176,481.60 | 118,274,205.55 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -41,247,176.72 | -21,515,880.92 |
| 所有者权益合计       |          | 69,929,304.88  | 96,758,324.63  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 70,246,793.18  | 97,208,569.35  |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6290 元，基金份额总额 111,176,481.60 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | -18,143,245.30                            | 24,254,640.03                                  |
| 1. 利息收入                |            | 886,492.28                                | 634,791.00                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 15,150.18                                 | 26,566.34                                      |
| 债券利息收入                 |            | 871,342.10                                | 608,224.66                                     |
| 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）      |            | -11,506,272.16                            | 13,631,831.80                                  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -11,797,309.80                            | 13,050,673.36                                  |
| 基金投资收益                 |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -119,079.44                               | -41,001.71                                     |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -                                         | -                                              |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 410,117.08                                | 622,160.15                                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -7,538,422.80                             | 9,955,777.99                                   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 14,957.38                                 | 32,239.24                                      |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 2,534,497.95                              | 2,881,983.20                                   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,226,387.74                              | 1,483,017.40                                   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 204,397.91                                | 247,169.53                                     |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -                                         | -                                              |

|                     |          |                |               |
|---------------------|----------|----------------|---------------|
| 4. 交易费用             | 7.4.7.19 | 836,109.04     | 883,653.14    |
| 5. 利息支出             |          | -              | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -              | -             |
| 6. 税金及附加            |          | 1.77           | -             |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.20 | 267,601.49     | 268,143.13    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -20,677,743.25 | 21,372,656.83 |
| 减：所得税费用             |          | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -20,677,743.25 | 21,372,656.83 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                   | 118,274,205.55                              | -21,515,880.92 | 96,758,324.63  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                           | -20,677,743.25 | -20,677,743.25 |
| 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） | -7,097,723.95                               | 946,447.45     | -6,151,276.50  |
| 其中：1. 基金申购款                       | 17,789,518.27                               | -4,624,969.89  | 13,164,548.38  |
| 2. 基金赎回款                          | -24,887,242.22                              | 5,571,417.34   | -19,315,824.88 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                   | 111,176,481.60                              | -41,247,176.72 | 69,929,304.88  |
| 项目                                | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                   | 151,339,501.02                              | -51,445,518.64 | 99,893,982.38  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利            | -                                           | 21,372,656.83  | 21,372,656.83  |

|                                       |                |                |                |
|---------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 润)                                    |                |                |                |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列) | -33,065,295.47 | 8,556,980.89   | -24,508,314.58 |
| 其中：1. 基金申购款                           | 25,025,394.79  | -6,680,042.70  | 18,345,352.09  |
| 2. 基金赎回款                              | -58,090,690.26 | 15,237,023.59  | -42,853,666.67 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                       | 118,274,205.55 | -21,515,880.92 | 96,758,324.63  |

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：

|              |             |             |
|--------------|-------------|-------------|
| _____<br>杨皓鹏 | _____<br>宋宇 | _____<br>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     |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中海蓝筹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【2008】816 号《关于核准中海蓝筹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 2008 年 12 月 3 日生效，该日的基金份额总额为 746,402,589.05 份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2008]B156 号验资报告予以验证。

本基金投资范围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\*60%+中债国债指数\*40%。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 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

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 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。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 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。

#### 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、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    |
| 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、代销机构 |
| 法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”） | 基金管理人的股东      |
| 中海恒信资产管理（上海）有限公司（“中海恒信”）     | 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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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  | 39,417,515.22                          | 6.82%                | 24,759,345.12                               | 4.03%                |

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                        | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 国联证券  | 541,426.70                             | 1.51%                | 202,009.50                                  | 0.80%                |

#### 7.4.8.1.3 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。

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 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>2018 年 1 月 1 日至 2018 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  | 36,709.38                                   | 7.42%          | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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  | 23,058.21                                   | 4.49%          | -        | -                |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,226,387.74                           | 1,483,017.40                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 314,828.88                             | 388,271.90                                  |

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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 204,397.91                             | 247,169.53                                  |

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。

#### 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

**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。

**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。

**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>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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 | 289,676.78                             | 10,002.87 | 1,088,826.26                                | 20,790.58 |

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，2018 年度获得的利息收入为人民币 4,171.99 元(2017 年度：人民币 4,549.22 元)，2018 年末结算备付金余额为人民币 99,081.33 元(2017 年末：人民币 440,773.65 元)。

**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：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2018 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：本基金在本报告期末没有因认购新发/增发而持有流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 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人民币 54,580,414.50 元,属于第二层次的余额为人民币 14,323,451.10 元,无属于第三层次的余额(于 2017 年 12 月 31 日,属于第一层次的余额为人民币 74,896,731.14 元,属于第二层次的余额为人民币 19,683,306.60 元,无属于第三层次的余额)。

##### 7.4.14.1.2.2 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可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | 54,580,414.50 | 77.70         |
|    | 其中：股票             | 54,580,414.50 | 77.70         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 14,323,451.10 | 20.39         |
|    | 其中：债券             | 14,323,451.10 | 20.39         |
|    | 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      | 388,758.11    | 0.55          |
| 8  | 其他各项资产            | 954,169.47    | 1.36          |
| 9  | 合计                | 70,246,793.18 | 100.00        |

### 8.2 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 21,003,701.00 | 30.04         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -             |
| E  | 建筑业              | 992,431.00    | 1.42          |
| F  | 批发和零售业           | 1,113,605.00  | 1.59          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,060,884.00  | 1.52          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,512,542.00  | 13.60         |
| J  | 金融业              | -             | -             |
| K  | 房地产业             | 6,868,910.00  | 9.82          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,656,369.00  | 10.95         |
| 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   | 4,630,660.50  | 6.62  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,741,312.00  | 2.49  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 54,580,414.50 | 78.05 |

### 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  | 300012 | 华测检测 | 872,900 | 5,717,495.00 | 8.18         |
| 2  | 600498 | 烽火通信 | 184,300 | 5,247,021.00 | 7.50         |
| 3  | 000063 | 中兴通讯 | 238,900 | 4,680,051.00 | 6.69         |
| 4  | 600570 | 恒生电子 | 62,600  | 3,253,948.00 | 4.65         |
| 5  | 002841 | 视源股份 | 46,260  | 2,632,194.00 | 3.76         |
| 6  | 300451 | 创业软件 | 127,600 | 2,443,540.00 | 3.49         |
| 7  | 000002 | 万科A  | 99,200  | 2,362,944.00 | 3.38         |
| 8  | 002044 | 美年健康 | 155,400 | 2,323,230.00 | 3.32         |
| 9  | 300015 | 爱尔眼科 | 87,735  | 2,307,430.50 | 3.30         |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 191,500 | 2,257,785.00 | 3.23         |

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。

### 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  | 000002 | 万科A  | 8,256,157.00 | 8.53           |
| 2  | 600048 | 保利地产 | 7,687,156.00 | 7.94           |
| 3  | 002368 | 太极股份 | 7,558,111.00 | 7.81           |
| 4  | 000977 | 浪潮信息 | 7,195,699.00 | 7.44           |
| 5  | 600845 | 宝信软件 | 7,147,784.00 | 7.39           |
| 6  | 600498 | 烽火通信 | 6,713,977.00 | 6.94           |
| 7  | 601155 | 新城控股 | 6,617,194.03 | 6.84           |
| 8  | 300012 | 华测检测 | 6,558,271.00 | 6.78           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 6,436,248.00 | 6.65 |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 5,798,989.58 | 5.99 |
| 11 | 600515 | 海航基础 | 5,208,096.00 | 5.38 |
| 12 | 601939 | 建设银行 | 5,122,730.30 | 5.29 |
| 13 | 603019 | 中科曙光 | 4,963,710.86 | 5.13 |
| 14 | 002024 | 苏宁易购 | 4,958,346.48 | 5.12 |
| 15 | 002153 | 石基信息 | 4,600,191.00 | 4.75 |
| 16 | 300253 | 卫宁健康 | 4,530,753.72 | 4.68 |
| 17 | 002044 | 美年健康 | 4,042,550.20 | 4.18 |
| 18 | 002624 | 完美世界 | 4,035,341.45 | 4.17 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 4,016,255.00 | 4.15 |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 3,922,161.90 | 4.05 |
| 21 | 002065 | 东华软件 | 3,604,581.00 | 3.73 |
| 22 | 002146 | 荣盛发展 | 3,562,962.00 | 3.68 |
| 23 | 600588 | 用友网络 | 3,318,204.00 | 3.43 |
| 24 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,305,436.70 | 3.42 |
| 25 | 300003 | 乐普医疗 | 3,256,516.00 | 3.37 |
| 26 | 601877 | 正泰电器 | 3,154,542.94 | 3.26 |
| 27 | 601012 | 隆基股份 | 3,092,981.80 | 3.20 |
| 28 | 002371 | 北方华创 | 3,018,384.00 | 3.12 |
| 29 | 300124 | 汇川技术 | 2,978,299.00 | 3.08 |
| 30 | 600740 | 山西焦化 | 2,957,075.96 | 3.06 |
| 31 | 603160 | 汇顶科技 | 2,785,917.00 | 2.88 |
| 32 | 600487 | 亨通光电 | 2,763,188.95 | 2.86 |
| 33 | 601360 | 三六零  | 2,734,132.00 | 2.83 |
| 34 | 600050 | 中国联通 | 2,706,907.00 | 2.80 |
| 35 | 000938 | 紫光股份 | 2,702,551.00 | 2.79 |
| 36 | 002841 | 视源股份 | 2,636,783.00 | 2.73 |
| 37 | 002202 | 金风科技 | 2,608,279.00 | 2.70 |
| 38 | 600271 | 航天信息 | 2,595,250.00 | 2.68 |
| 39 | 601933 | 永辉超市 | 2,579,872.00 | 2.67 |
| 40 | 601233 | 桐昆股份 | 2,555,380.00 | 2.64 |
| 41 | 601601 | 中国太保 | 2,513,379.00 | 2.60 |
| 42 | 600340 | 华夏幸福 | 2,465,420.00 | 2.55 |
| 43 | 002596 | 海南瑞泽 | 2,462,621.00 | 2.55 |
| 44 | 600029 | 南方航空 | 2,441,844.00 | 2.52 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 45 | 601111 | 中国国航 | 2,435,895.62 | 2.52 |
| 46 | 600115 | 东方航空 | 2,432,676.00 | 2.51 |
| 47 | 603799 | 华友钴业 | 2,377,956.00 | 2.46 |
| 48 | 300365 | 恒华科技 | 2,362,703.00 | 2.44 |
| 49 | 300451 | 创业软件 | 2,342,238.00 | 2.42 |
| 50 | 002925 | 盈趣科技 | 2,337,370.88 | 2.42 |
| 51 | 002050 | 三花智控 | 2,284,590.00 | 2.36 |
| 52 | 600398 | 海澜之家 | 2,280,388.00 | 2.36 |
| 53 | 300373 | 扬杰科技 | 2,275,440.00 | 2.35 |
| 54 | 002465 | 海格通信 | 2,217,777.00 | 2.29 |
| 55 | 000066 | 中国长城 | 2,213,968.00 | 2.29 |
| 56 | 603259 | 药明康德 | 2,205,089.00 | 2.28 |
| 57 | 300687 | 赛意信息 | 2,190,604.88 | 2.26 |
| 58 | 600030 | 中信证券 | 2,186,840.30 | 2.26 |
| 59 | 002696 | 百洋股份 | 2,182,665.00 | 2.26 |
| 60 | 002376 | 新北洋  | 2,179,718.00 | 2.25 |
| 61 | 600038 | 中直股份 | 2,158,951.97 | 2.23 |
| 62 | 002027 | 分众传媒 | 2,151,450.00 | 2.22 |
| 63 | 002195 | 二三四五 | 2,144,939.00 | 2.22 |
| 64 | 300017 | 网宿科技 | 2,122,700.00 | 2.19 |
| 65 | 601318 | 中国平安 | 1,999,834.00 | 2.07 |
| 66 | 002320 | 海峡股份 | 1,974,352.00 | 2.04 |

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  | 601939 | 建设银行 | 8,568,390.00 | 8.86           |
| 2  | 002368 | 太极股份 | 6,902,708.00 | 7.13           |
| 3  | 000977 | 浪潮信息 | 6,839,548.52 | 7.07           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 6,659,503.00 | 6.88           |
| 5  | 600845 | 宝信软件 | 6,283,143.00 | 6.49           |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 5,546,663.00 | 5.73           |
| 7  | 000002 | 万科A  | 5,438,046.11 | 5.62           |
| 8  | 002024 | 苏宁易购 | 4,754,882.14 | 4.91           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 000537 | 广宇发展 | 4,751,771.00 | 4.91 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 4,710,626.45 | 4.87 |
| 11 | 603019 | 中科曙光 | 4,533,228.98 | 4.69 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 4,445,037.34 | 4.59 |
| 13 | 002153 | 石基信息 | 4,423,181.60 | 4.57 |
| 14 | 300253 | 卫宁健康 | 4,229,463.00 | 4.37 |
| 15 | 601888 | 中国国旅 | 4,068,154.80 | 4.20 |
| 16 | 002456 | 欧菲科技 | 4,064,466.10 | 4.20 |
| 17 | 600515 | 海航基础 | 3,854,801.39 | 3.98 |
| 18 | 002027 | 分众传媒 | 3,823,874.76 | 3.95 |
| 19 | 601100 | 恒立液压 | 3,799,326.00 | 3.93 |
| 20 | 601155 | 新城控股 | 3,779,485.78 | 3.91 |
| 21 | 002304 | 洋河股份 | 3,694,507.50 | 3.82 |
| 22 | 600703 | 三安光电 | 3,618,930.00 | 3.74 |
| 23 | 000063 | 中兴通讯 | 3,608,437.68 | 3.73 |
| 24 | 002714 | 牧原股份 | 3,555,244.60 | 3.67 |
| 25 | 600036 | 招商银行 | 3,510,859.00 | 3.63 |
| 26 | 600763 | 通策医疗 | 3,503,138.00 | 3.62 |
| 27 | 300059 | 东方财富 | 3,492,221.60 | 3.61 |
| 28 | 000333 | 美的集团 | 3,484,892.00 | 3.60 |
| 29 | 600887 | 伊利股份 | 3,427,260.94 | 3.54 |
| 30 | 000703 | 恒逸石化 | 3,411,217.26 | 3.53 |
| 31 | 002142 | 宁波银行 | 3,409,357.00 | 3.52 |
| 32 | 002146 | 荣盛发展 | 3,368,406.00 | 3.48 |
| 33 | 601233 | 桐昆股份 | 3,305,453.42 | 3.42 |
| 34 | 600740 | 山西焦化 | 3,276,165.56 | 3.39 |
| 35 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,166,800.51 | 3.27 |
| 36 | 300003 | 乐普医疗 | 3,074,852.00 | 3.18 |
| 37 | 000963 | 华东医药 | 2,971,145.00 | 3.07 |
| 38 | 601336 | 新华保险 | 2,957,028.68 | 3.06 |
| 39 | 601877 | 正泰电器 | 2,805,375.81 | 2.90 |
| 40 | 002065 | 东华软件 | 2,622,756.00 | 2.71 |
| 41 | 600570 | 恒生电子 | 2,533,762.85 | 2.62 |
| 42 | 600050 | 中国联通 | 2,474,140.00 | 2.56 |
| 43 | 300365 | 恒华科技 | 2,468,146.00 | 2.55 |
| 44 | 002371 | 北方华创 | 2,428,007.20 | 2.51 |
| 45 | 601360 | 三六零  | 2,403,455.00 | 2.48 |
| 46 | 600346 | 恒力股份 | 2,365,337.00 | 2.44 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 47 | 601601 | 中国太保 | 2,360,706.79 | 2.44 |
| 48 | 002596 | 海南瑞泽 | 2,343,845.00 | 2.42 |
| 49 | 002202 | 金风科技 | 2,329,502.00 | 2.41 |
| 50 | 603799 | 华友钴业 | 2,326,368.00 | 2.40 |
| 51 | 601111 | 中国国航 | 2,311,421.00 | 2.39 |
| 52 | 600029 | 南方航空 | 2,262,531.00 | 2.34 |
| 53 | 000938 | 紫光股份 | 2,241,096.00 | 2.32 |
| 54 | 600398 | 海澜之家 | 2,231,221.41 | 2.31 |
| 55 | 002624 | 完美世界 | 2,210,711.00 | 2.28 |
| 56 | 600487 | 亨通光电 | 2,195,254.97 | 2.27 |
| 57 | 600340 | 华夏幸福 | 2,177,159.00 | 2.25 |
| 58 | 002925 | 盈趣科技 | 2,174,964.00 | 2.25 |
| 59 | 002696 | 百洋股份 | 2,160,152.44 | 2.23 |
| 60 | 603160 | 汇顶科技 | 2,158,870.00 | 2.23 |
| 61 | 600115 | 东方航空 | 2,150,734.00 | 2.22 |
| 62 | 002050 | 三花智控 | 2,138,249.00 | 2.21 |
| 63 | 002320 | 海峡股份 | 2,128,116.00 | 2.20 |
| 64 | 300012 | 华测检测 | 2,105,249.00 | 2.18 |
| 65 | 002493 | 荣盛石化 | 2,059,499.00 | 2.13 |
| 66 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,058,367.60 | 2.13 |
| 67 | 300124 | 汇川技术 | 2,036,716.00 | 2.10 |
| 68 | 002415 | 海康威视 | 1,996,512.64 | 2.06 |
| 69 | 002376 | 新北洋  | 1,977,029.06 | 2.04 |

注：本报告期内，累计卖出股票收入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。

#### 8.4.3 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 | 288,718,641.86 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 289,860,296.00 |

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

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 | 14,323,451.10 | 20.48        |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债 | 14,323,451.10 | 20.48 |
| 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） | -             | -     |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 14,323,451.10 | 20.48 |

## 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

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  | 018002 | 国开 1302 | 137,350 | 13,741,867.50 | 19.65        |
| 2  | 018007 | 国开 1801 | 5,780   | 581,583.60    | 0.83         |

## 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 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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   | 29,987.47  |
| 2  | 应收证券清算款 | 85,661.42  |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 806,380.09 |
| 5  | 应收申购款   | 32,140.49  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 954,169.47 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 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 |
| 10,590       | 10,498.25     | 10,130,311.32 | 9.11%      | 101,046,170.28 | 90.89%     |

### 9.2 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 | 62,412.50 | 0.0561%  |

### 9.3 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                 |

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2008 年 12 月 3 日 ）基金份额总额 | 746,402,589.05 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 118,274,205.55 |
| 本报告期期间基金总申购份额                    | 17,789,518.27  |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额                  | 24,887,242.22  |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 111,176,481.60 |

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。

## § 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，免去杨皓鹏先生代理督察长职务，聘任黄乐军先生担任督察长职务。

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 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

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。本报告期内已预提审计费 45,000.00 元，截至 2018 年 12 月 31 日暂未支付，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 2 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 华创证券 | 2          | 126,994,918.63 | 21.96%               | 118,270.48 | 23.91%         | —  |
| 渤海证券 | 1          | 104,709,210.76 | 18.11%               | 76,573.81  | 15.48%         | —  |
| 长江证券 | 1          | 68,353,995.44  | 11.82%               | 63,658.19  | 12.87%         | —  |
| 银河证券 | 2          | 51,273,746.02  | 8.87%                | 47,751.07  | 9.65%          | —  |

|            |   |               |       |           |       |   |
|------------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 中金公司       | 2 | 48,050,890.00 | 8.31% | 35,139.65 | 7.10% | — |
| 国联证券       | 1 | 39,417,515.22 | 6.82% | 36,709.38 | 7.42% | — |
| 西南证券       | 1 | 38,605,800.52 | 6.68% | 28,232.38 | 5.71% | — |
| 国信证券       | 1 | 30,749,911.32 | 5.32% | 28,637.48 | 5.79% | — |
| 东北证券       | 1 | 19,545,536.14 | 3.38% | 14,293.46 | 2.89% | — |
| 兴业证券       | 2 | 15,519,976.45 | 2.68% | 12,845.94 | 2.60% | — |
| 招商证券       | 1 | 14,400,882.11 | 2.49% | 13,411.52 | 2.71% | — |
| 中泰证券       | 1 | 9,561,548.97  | 1.65% | 8,904.75  | 1.80% | — |
| 东兴证券       | 1 | 6,465,347.40  | 1.12% | 6,021.22  | 1.22% | — |
| 安信证券       | 1 | 3,873,929.00  | 0.67% | 3,607.77  | 0.73% | — |
| 民生证券       | 2 | 482,865.00    | 0.08% | 449.68    | 0.09% | — |
| 国泰君安       | 1 | 207,314.00    | 0.04% | 193.03    | 0.04% | — |
| 光大证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 中信建投       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 华宝证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 宏源证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 华西证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 国盛证券       | 2 | —             | —     | —         | —     | — |
| 新时代证券      | 2 | —             | —     | —         | —     | — |
| 海通证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 第一创业证<br>券 | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 浙商证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 方正证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 中信证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 平安证券       | 1 | —             | —     | —         | —     | — |
| 川财证券       | 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，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；报风险管理部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内新增了国盛证券的上海和深圳交易单元。退租了长城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 |
| 华创证券 | 24,614,522.90 | 68.83%       | -      | -              | -    | -            |
| 渤海证券 | 5,645,112.91  | 15.79%       | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | 2,924,837.20  | 8.18%        | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券 | 377,518.20    | 1.06%        | -      | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国联证券 | 541,426.70    | 1.51%        | -      | -              | -    | -            |
| 西南证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | 902,213.70    | 2.52%        | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中泰证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | 478,365.30    | 1.34%        | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -             | -            | -      | -              | -    | -            |

|            |            |       |   |   |   |   |
|------------|------------|-------|---|---|---|---|
| 国泰君安       | 276,082.80 | 0.77% | - | - | - | - |
| 光大证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 中信建投       | -          | -     | - | - | - | - |
| 华宝证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 宏源证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 华西证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 国盛证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 新时代证券      | -          | -     | - | - | - | - |
| 海通证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 第一创业证<br>券 | -          | -     | - | - | - | - |
| 浙商证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 方正证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 中信证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 平安证券       | -          | -     | - | - | - | - |
| 川财证券       | -          | -     | - | - | - | - |

中海基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日