

# 中海可转换债券债券型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）根据本基金合同规定，于 2017 年 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	中海可转债债券	
基金主代码	000003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 20 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	65,984,812.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
下属分级基金的交易代码:	000003	000004
报告期末下属分级基金的份额总额	33,960,556.18 份	32,024,256.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以可转换债券为主要投资目标，在严格控制投资组合风险的基础上，充分把握可转换债券兼具股性和债性的风险收益特征，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、整体资产配置策略 在严格风控基础上，通过对国内外宏观经济形势、证券市场估值水平、财政及货币政策以及信用风险情况等因素的综合研判，预测各大类资产（可转债、股票、债券等）在不同经济周期阶段内的风险收益特征，进而在各大类资产之间进行整体动态配置，力争为基金资产获取持续稳健回报。</p> <p>2、可转换债券投资策略</p> <p>（1）一级市场 将积极参与公司基本面优秀、发行条款较好、申购预期收益较高的可转债一级市场申购，上市后根据个券即时市场价格等因素做出持有或卖出的决策。</p> <p>（2）二级市场 将结合历史估值情景，综合运用基本面分析、理论定价分析、相对价值分析等方法，在严格控制风险的前提下，把握可转换债券的价值走向，精选个券，力争实现更高的投资收益。同时，由于可转债一般还设置提前赎回权、向下修正权、提前回售权等条款，因此，还需要详细分析各条款本身的潜在价值，力争抓住每一次条款博弈投资机会。另外，由于可转债和标的股票之间可能存在风险相对较小的套利机会，因此，还需要密切关注相应投资机会。</p> <p>3、普通债券投资策略 将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值目标。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略</p>

	<p>对中小企业私募债的投资主要以信用品种投资策略为基础，重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析。</p> <p><b>5、股票投资策略</b></p> <p>(1) 一级市场</p> <p>作为固定收益类产品，将充分依靠公司研究平台和股票估值体系，深入研究首次发行(IPO)股票的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。</p> <p>(2) 二级市场</p> <p>本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方法，优先选择具有相对比较优势的同时估值水平相对较低的优质上市公司进行投资。定性分析主要包括：公司治理结构、自主知识产权、品牌影响力、市场定价能力、成本控制能力等。定量分析主要包括：估值水平指标、资产质量指标、各种财务指标等。</p>
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×20%+上证红利指数×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险、中低预期收益品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王莉	林葛
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	wangl@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9788 021-38789788	95599
传真		021-68419525	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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		
基金级别	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
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)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-3, 288, 537. 25	-3, 396, 071. 37
本期利润	-626, 867. 53	-736, 724. 16
加权平均基金份额本期利润	-0. 0180	-0. 0210
本期基金份额净值增长率	-2. 22%	-2. 33%
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. 2081	-0. 2042
期末基金资产净值	26, 894, 096. 92	25, 484, 146. 91
期末基金份额净值	0. 792	0. 796

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

中海可转债债券 A						
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	3. 39%	0. 38%	3. 75%	0. 39%	-0. 36%	-0. 01%
过去三个 月	-0. 63%	0. 58%	1. 77%	0. 35%	-2. 40%	0. 23%
过去六个 月	-2. 22%	0. 44%	2. 50%	0. 30%	-4. 72%	0. 14%
过去一年	-7. 37%	0. 50%	3. 78%	0. 36%	-11. 15%	0. 14%
过去三年	-0. 73%	1. 78%	14. 08%	1. 51%	-14. 81%	0. 27%
自基金合 同生效起 至今	-6. 88%	1. 54%	11. 79%	1. 29%	-18. 67%	0. 25%

## 中海可转债债券 C

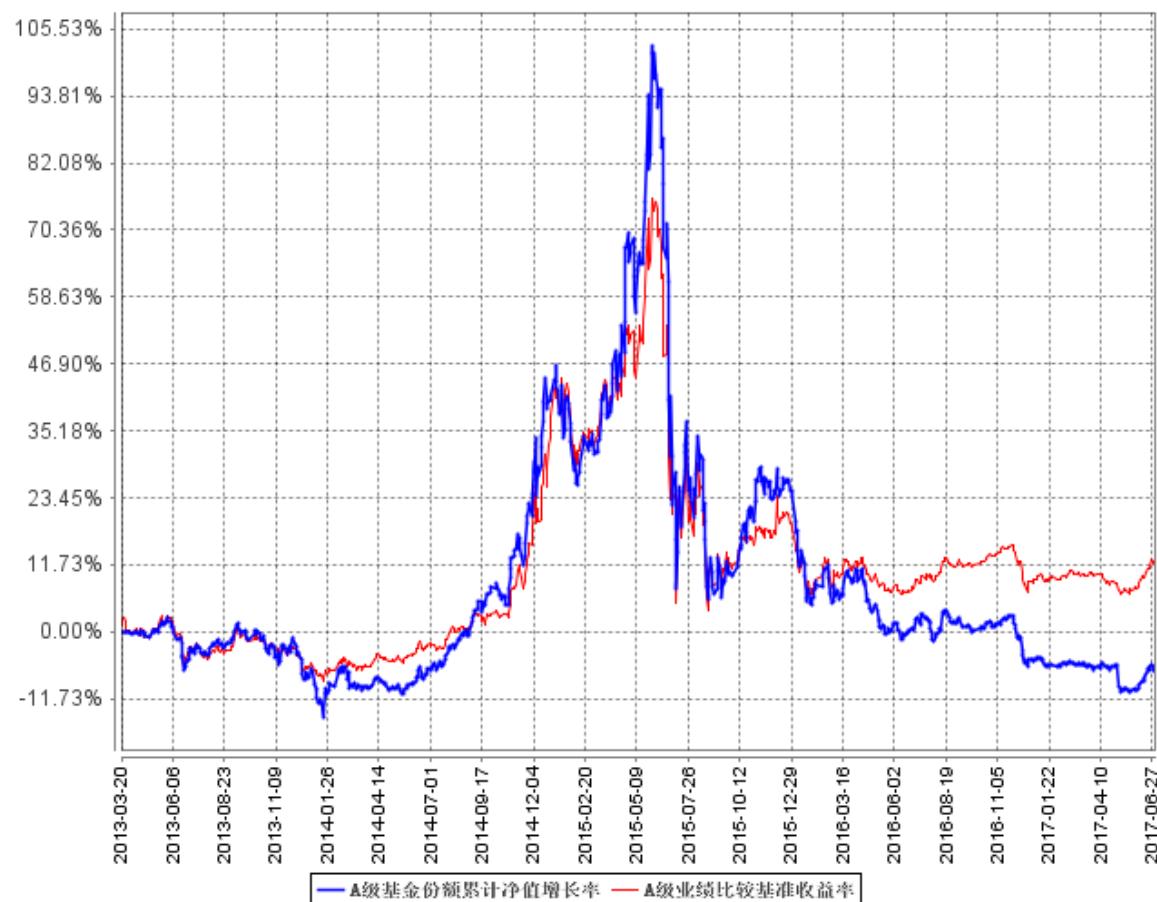
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率为标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.38%	0.37%	3.75%	0.39%	-0.37%	-0.02%
过去三个月	-0.62%	0.59%	1.77%	0.35%	-2.39%	0.24%
过去六个月	-2.33%	0.45%	2.50%	0.30%	-4.83%	0.15%
过去一年	-7.66%	0.50%	3.78%	0.36%	-11.44%	0.14%
过去三年	0.20%	1.78%	14.08%	1.51%	-13.88%	0.27%
自基金合同生效起至今	-6.41%	1.54%	11.79%	1.29%	-18.20%	0.25%

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2013 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日。

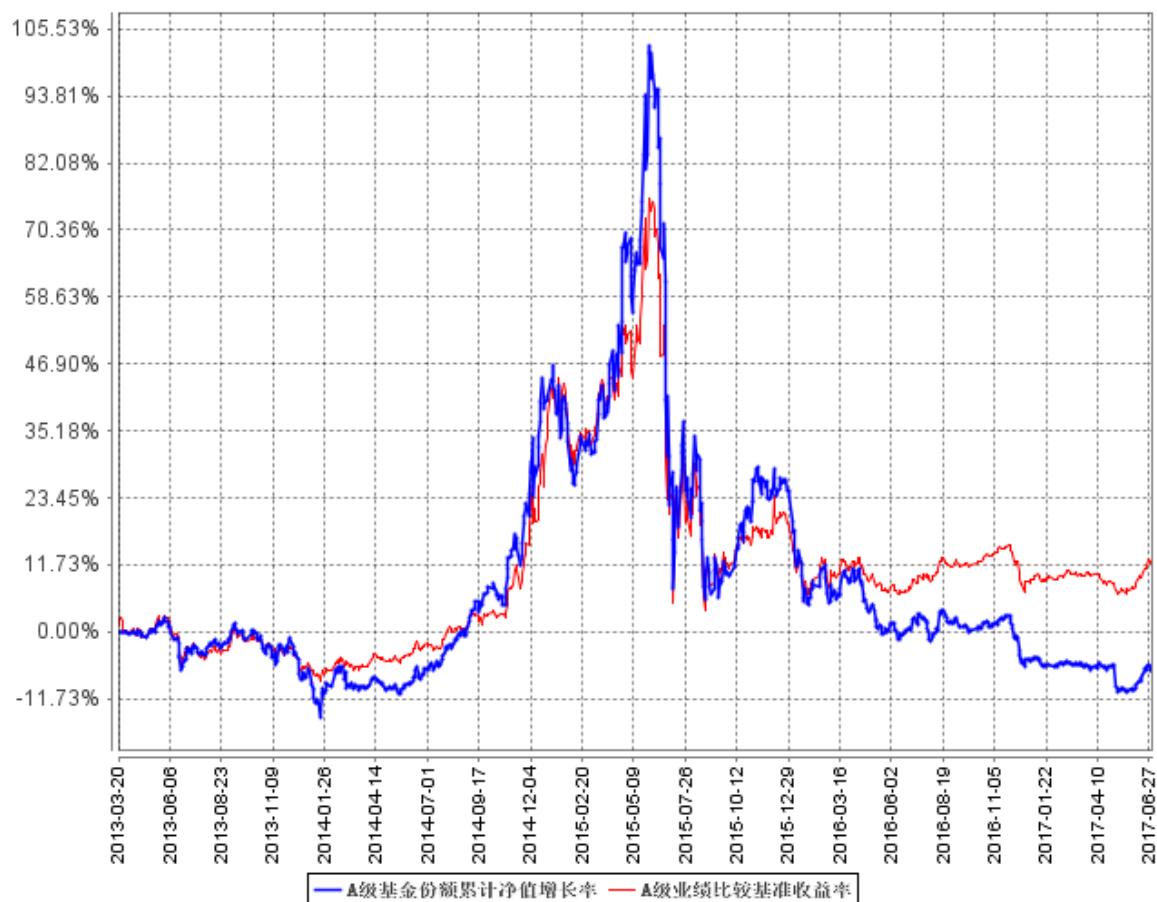
注 2：本基金的业绩比较基准为：中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×20%+上证红利指数×10%，由于本基金为可转债基金且股票投资优先选择盈利增长稳定、过去两年连续分红且股息收益率排名居前的红利股票，我们选取市场认同度很高的中信标普可转债指数、中证综合债券指数和上证红利指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。在一般市场状况下，本基金可转债投资比例会控制在 70%左右，其他固定收益品种投资比例控制在 20%左右，股票投资比例控制在 10%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 70%、20%和 10%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

### A 级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



### A 级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 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		
江小震	投资副总监，本	2014 年 3 月 21 日	-	19 年	江小震先生，复旦大学金融学专业硕士。历任长江证券

	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 惠裕纯 债债券 型发起 式证券 投资基 金(LOF) 基金经 理、中海 惠祥分 级债券 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 海货币 市场证 券投资 基金基 金经理、 中海纯 债债券 型证券 投资基金 基金经理、中 海惠利 纯债分 级债券 型证券			股份有限公司投资经理、中 维资产管理有限责任公司 部门经理、天安人寿保险股 份有限公司(原名恒康天安 保险有限责任公司)投资部 经理、太平洋资产管理有限 责任公司高级经理。2009 年11月进入本公司工作， 历任固定收益小组负责人、 固定收益部副总监、固定收 益部总经理，现任投研中心 投资副总监。2010年7月至 2012年10月任中海货币市 场证券投资基金管理人基金 经理，2011年3月至今任中海增 强收益债券型证券投资基 金基金经理，2013年1月至 今任中海惠裕纯债债券型 发起式证券投资基金(LOF) 基金经理，2014年3月至今 任中海可转换债券债券型 证券投资基金管理人基金 经理，2014年8月至今任中海惠 祥分级债券型证券投资基 金基金经理，2016年2月至 今任中海中鑫灵活配置混 合型证券投资基金管理人基 金经理，2016年4月至今任中海 货币市场证券投资基金管理人 基金经理，2016年4月至今任 中海纯债债券型证券投资基 金基金经理，2016年4月至今任 中海惠利纯债分 级债券型证券投资基 金基金经理，2016年4月至今任 中海惠丰纯债分级债券型 证券投资基金管理人基 金经理，2016年7月至今任中海稳 健收益债券型证券投资基 金基金经理，2016年8月至 今任中海合嘉增强收益债 券型证券投资基金管理人基 金经理。
--	---	--	--	--

	投资基金基金经理、中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理、中海稳健收益债券型证券投资基金管理基金经理、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金管理基金经理			
--	--	--	--	--

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，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 年上半年，全球经济短期出现好转迹象，中国经济增长稳中有升，货币政策保持稳健中性的格局。一季度以来金融监管与金融防风险成为市场主线，债券市场收益率经历幅度不小的调整，股票市场维持震荡，但结构出现分化。

基本面方面，上半年经济增长好于预期，GDP 增速连续两个季度维持 6.9%，服务业和消费保持对经济的高贡献，基建保持 20%以上的较高增速，房地产投资增速仍维持在 6%左右，成为经济增长的主要推动因素。

货币政策方面，2017 年以来央行实施稳健中性的货币政策，通过综合运用不同类型的货币市场工具，以削峰填谷的方式维持流动性总体稳定。同时央行监管逐步加强，金融体系主动调整业务降低内部杠杆，回归实体经济，6 月末 M2 增速放缓至 9.2%。

债券市场方面，在金融防风险的基调下，上半年债市收益率延续去年底的调整态势，二季度银监会金融监管政策密集出台，债券市场再次经历深度调整，信用利差走阔，利率债收益率快速上行，至 6 月初稍得喘息时机，债市小幅反弹。

上半年内本基金整体操作平稳，适当参与新发转债申购。

#### 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 A 类份额净值 0.792 元（累计净值 1.002 元）。报告期内本基金净值增长率为 -2.22%，低于业绩比较基准 4.72 个百分点。本基金 C 类份额净值 0.796 元（累计净值 1.006 元）。报告期内本基金净值增长率为 -2.33%，低于业绩比较基准 4.83 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

上半年经济运行体现出较强的稳定性，供给侧改革效果已经显现，加之积极的财政政策托底经济，未来经济将会延续稳增长的态势。今年以来，美联储如期加息以及缩表计划的开启，以及欧元区经济复苏、调整货币政策等偏鹰派的言论，从客观上对国内货币政策造成影响，货币政策难言宽松，依旧保持稳健中性。债券市场方面，金融去杠杆仍在继续，监管细则尚未落地，加之民企债券风波不断，市场不确定性较多，未来的运作将继续坚持稳健原则，谨慎操作。

### 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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中海基金管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中海可转换债券债券型证券投资基金  
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		4,778,078.21	1,264,246.15
结算备付金		128,758.09	254,713.80
存出保证金		9,978.31	11,532.77
交易性金融资产		48,087,411.57	58,840,752.36
其中：股票投资		5,414,448.87	4,768,700.00
基金投资		—	—
债券投资		42,672,962.70	54,072,052.36
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		—	566,591.44
应收利息		165,238.88	145,128.39
应收股利		—	—
应收申购款		14,281.94	26,914.31
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		53,183,747.00	61,109,879.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	1,300,000.00
应付证券清算款		621,300.62	—
应付赎回款		64,794.11	2,618.74
应付管理人报酬		32,028.73	38,781.09
应付托管费		8,540.99	10,341.62
应付销售服务费		8,391.95	10,603.34
应付交易费用		12,897.98	3,541.67
应交税费		—	—
应付利息		—	811.27
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		57,548.79	258,017.93
负债合计		805,503.17	1,624,715.66
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		65,984,812.36	73,201,020.79
未分配利润		-13,606,568.53	-13,715,857.23
所有者权益合计		52,378,243.83	59,485,163.56
负债和所有者权益总计		53,183,747.00	61,109,879.22

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中海可转债债券 A 基金份额净值 0.792 元，基金份额总额

33,960,556.18 份；中海可转债债券 C 基金份额净值 0.796 元，基金份额总额 32,024,256.18 份。  
中海可转债债券份额总额合计为 65,984,812.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海可转换债券债券型证券投资基金  
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
<b>一、收入</b>		-871,251.08	-17,075,784.46
1.利息收入		239,095.38	315,992.14
其中：存款利息收入		13,413.32	24,460.57
债券利息收入		201,647.85	291,531.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,034.21	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,433,994.62	-3,235,150.63
其中：股票投资收益		-1,706,401.68	-1,881,355.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-4,727,392.94	-1,372,295.39
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		-200.00	18,500.00
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）		5,321,016.93	-14,171,252.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填 列）		2,631.23	14,626.74
<b>减：二、费用</b>		492,340.61	1,138,235.57
1. 管理人报酬		207,106.94	306,081.21
2. 托管费		55,228.48	81,621.68
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	55,680.73	74,095.06
4. 交易费用		44,551.38	79,941.43
5. 利息支出		52,760.43	427,416.98
其中：卖出回购金融资产支出		52,760.43	427,416.98
6. 其他费用		77,012.65	169,079.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		-1,363,591.69	-18,214,020.03

减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-1,363,591.69	-18,214,020.03

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中海可转换债券债券型证券投资基金  
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)	73,201,020.79	-13,715,857.23	59,485,163.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,363,591.69	-1,363,591.69
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)	-7,216,208.43	1,472,880.39	-5,743,328.04
其中：1.基金申购款	5,377,668.35	-1,103,347.06	4,274,321.29
2.基金赎回款	-12,593,876.78	2,576,227.45	-10,017,649.33
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)	65,984,812.36	-13,606,568.53	52,378,243.83
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)	92,851,370.29	5,375,543.00	98,226,913.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-18,214,020.03	-18,214,020.03
三、本期基金份额交易	-5,221,799.62	423,625.71	-4,798,173.91

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	14,274,403.13	-1,208,091.06	13,066,312.07
2.基金赎回款	-19,496,202.75	1,631,716.77	-17,864,485.98
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)	87,629,570.67	-12,414,851.32	75,214,719.35

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

中海可转换债券债券型证券投资基金(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[2013]16 号《关于核准中海可转换债券债券型证券投资基金募集的批复》核准，于 2013 年 2 月 25 日至 2013 年 3 月 15 日向社会公开募集。募集期结束并经江苏公证天业会计师事务所有限公司验资，首次发行募集的实收基金为人民币 1,005,282,828.05 元，有效认购金额产生的利息为人民币 134,997.66 元，共计人民币 1,005,417,825.71 元。

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，基金托管人为中国农业银行；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 2013 年 3 月 20 日生效，该日的基金份额总额为 1,005,417,825.71 份，其中 A 类基金份额总额 562,618,227.16 份，C 类基金份额总额 442,799,598.55 份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2013]B019 号验资报告予以验证。

本基金根据认购、申购费用及销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类

别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金主要投资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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资的固定收益类资产包括国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、中小企业私募债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券等。本基金投资组合的资产配置比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，对可转换债券(含可分离交易可转换债券)的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%，对中小企业私募债券的投资比例不高于基金固定收益类资产的 20%；非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的 20%。其中现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金业绩比较基准为：中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债券指数收益率×20%+上证红利指数×10%。

#### 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《证券投资基金管理信息披露 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》、《中海可转换债券债券型证券投资基金 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有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。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 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管理税收政策的通知》、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) 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

#### 6.4.7 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

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	83,426.33	0.25%	9,050,869.78	16.19%

###### 6.4.7.1.2 债券交易

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	7,585,525.50	22.45%	23,745,530.91	36.65%

###### 6.4.7.1.3 债券回购交易

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	7,000,000.00	6.24%	139,400,000.00	16.84%

###### 6.4.7.1.4 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。

###### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

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	77.69	0.31%	77.69	0.60%
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			
国联证券	8,429.04	17.38%	5,303.16	20.86%

- 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	207,106.94	306,081.21
其中：支付销售机构的客户维护费	110,050.56	149,129.67

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提，计算方法如下：

$H=E \times 0.75\% / \text{当年天数}$  ( $H$  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 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托管费	55,228.48	81,621.68

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.2\% / \text{当年天数}$  ( $H$  为每日应计提的基金托管费， $E$  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。

##### 6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C	合计
中海基金	0.00	1,490.60	1,490.60
中国农业银行	0.00	4,851.99	4,851.99
合计	0.00	6,342.59	6,342.59

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C	合计
中海基金	0.00	2,015.39	2,015.39
中国农业银行	0.00	5,712.76	5,712.76
合计	0.00	7,728.15	7,728.15

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times 0.4\% / \text{当年天数}$  ( $H$  为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费， $E$  为 C 类基金份额前一日的基金资产净值)

基金销售服务费每日计算，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：本基金报告期内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	期末余额	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	当期利息收入
中国农业银行股份 有限公司	4,778,078.21	12,270.47	1,219,307.00	16,824.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

#### 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 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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.8.2 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。

##### 6.4.8.3 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。

## § 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	5,414,448.87	10.18
	其中：股票	5,414,448.87	10.18
2	固定收益投资	42,672,962.70	80.24
	其中：债券	42,672,962.70	80.24

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,906,836.30	9.23
7	其他各项资产	189,499.13	0.36
8	合计	53,183,747.00	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,293,448.87	8.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,121,000.00	2.14
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	5,414,448.87	10.34

## 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	600884	杉杉股份	99,921	1,645,698.87	3.14
2	000651	格力电器	30,000	1,235,100.00	2.36
3	601009	南京银行	100,000	1,121,000.00	2.14
4	000423	东阿阿胶	10,000	718,900.00	1.37
5	002460	赣锋锂业	15,000	693,750.00	1.32

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	000423	东阿阿胶	2,756,053.00	4.63
2	000651	格力电器	2,248,332.98	3.78
3	600884	杉杉股份	1,599,497.66	2.69
4	002262	恩华药业	1,231,777.00	2.07
5	600062	华润双鹤	1,208,587.00	2.03
6	002051	中工国际	1,178,995.57	1.98
7	002008	大族激光	1,170,320.00	1.97
8	002585	双星新材	1,169,083.00	1.97
9	601009	南京银行	1,104,500.00	1.86
10	603006	联明股份	902,180.00	1.52
11	300007	汉威科技	732,324.00	1.23
12	002460	赣锋锂业	641,250.00	1.08
13	300456	耐威科技	322,975.00	0.54

14	600079	人福医药	82,087.00	0.14
----	--------	------	-----------	------

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	000423	东阿阿胶	2,317,569.78	3.90
2	300299	富春股份	1,649,478.82	2.77
3	601198	东兴证券	1,524,360.00	2.56
4	002051	中工国际	1,371,450.60	2.31
5	000651	格力电器	1,349,116.00	2.27
6	002008	大族激光	1,337,593.80	2.25
7	002585	双星新材	1,219,216.01	2.05
8	002262	恩华药业	1,186,770.00	2.00
9	600062	华润双鹤	1,162,700.00	1.95
10	002395	双象股份	869,288.00	1.46
11	603006	联明股份	850,407.00	1.43
12	300007	汉威科技	728,131.66	1.22
13	300031	宝通科技	398,033.00	0.67
14	300456	耐威科技	327,130.00	0.55
15	600079	人福医药	83,426.33	0.14

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	16,347,962.21
卖出股票收入（成交）总额	16,374,671.00

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	3,477,540.00	6.64
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）	39,195,422.70	74.83
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	42,672,962.70	81.47

## 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	113008	电气转债	155,440	16,143,998.40	30.82
2	113009	广汽转债	66,600	8,235,090.00	15.72
3	110031	航信转债	46,080	4,766,515.20	9.10
4	110030	格力转债	32,000	3,634,240.00	6.94
5	019546	16 国债 18	26,000	2,597,140.00	4.96

## 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。

## 7.11 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	9,978.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165,238.88
5	应收申购款	14,281.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	189,499.13

#### 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	113008	电气转债	16,143,998.40	30.82
2	113009	广汽转债	8,235,090.00	15.72
3	110031	航信转债	4,766,515.20	9.10
4	110030	格力转债	3,634,240.00	6.94
5	110032	三一转债	698,544.00	1.33
6	128013	洪涛转债	178,288.00	0.34
7	113010	江南转债	149,263.40	0.29

#### 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

份额 级别	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
中海 可转 债债券 A	3,069	11,065.67	556,871.98	1.64%	33,403,684.20	98.36%
中海 可转 债债券 C	2,271	14,101.39	0.00	0.00%	32,024,256.18	100.00%
合计	5,340	12,356.71	556,871.98	0.84%	65,427,940.38	99.16%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中海可转 债债券 A	24.52	0.0000%
	中海可转 债债券 C	-	-
	合计	24.52	0.0000%

### 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	份额级别	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	中海可转债债券 A	0
	中海可转债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	中海可转债债券 A	0
	中海可转债债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
基金合同生效日(2013 年 3 月 20 日)基金份 额总额	562,618,227.16	442,799,598.55
本报告期期初基金份额总额	35,735,528.69	37,465,492.10
本报告期基金总申购份额	3,987,178.64	1,390,489.71
减: 本报告期基金总赎回份额	5,762,151.15	6,831,725.63
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-” 填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	33,960,556.18	32,024,256.18

## § 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，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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
西南证券	1	8,733,878.48	26.69%	6,387.02	25.31%	-
第一创业证券	1	5,966,162.46	18.23%	4,363.13	17.29%	-
川财证券	1	3,355,554.00	10.25%	2,453.93	9.72%	-
民生证券	2	2,909,782.98	8.89%	2,709.86	10.74%	-
渤海证券	1	2,838,175.00	8.67%	2,075.58	8.22%	-
东北证券	1	2,410,772.57	7.37%	1,762.99	6.98%	-
华创证券	1	1,890,004.52	5.78%	1,760.25	6.97%	-
长江证券	1	1,664,400.14	5.09%	1,550.00	6.14%	-
方正证券	1	1,524,360.00	4.66%	1,114.82	4.42%	-
华西证券	1	1,346,116.73	4.11%	984.45	3.90%	-
国联证券	1	83,426.33	0.25%	77.69	0.31%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	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：本报告期内新增了中金公司的上海和深圳交易单元。

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：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
西南证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	1,184,800.80	3.51%	33,100,000.00	29.50%	-	-
民生证券	130.90	0.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	4,787,809.32	14.17%	46,700,000.00	41.62%	-	-
长江证券	1,618,208.90	4.79%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	7,585,525.50	22.45%	7,000,000.00	6.24%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	5,200,000.00	4.63%	-	-

中泰证券	6,331,266.70	18.74%	5,500,000.00	4.90%	-	-
银河证券	215,407.80	0.64%	200,000.00	0.18%	-	-
中信建投	-	-	9,200,000.00	8.20%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	12,069,449.13	35.72%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	5,300,000.00	4.72%	-	-

中海基金管理有限公司  
2017 年 8 月 29 日