益丰大药房连锁股份有限公司

2017 第三季度报告

公司代码:603939 公司简称:益丰药房

一、重要提示

1.1 公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人高毅、主管会计工作负责人罗迎辉及会计机构负责人(会计主管人员)管长福保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第三季度报告未经审计。

二、公司主要财务数据和股东变化

2.1 主要财务数据

单位:元 币种:人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	4,523,483,438.50	4,221,246,244.90	7.16
归属于上市公司股东的净资产	3,073,885,213.13	2,962,508,018.24	3.76
	年初至报告期末(1-9月)	上年初至上年报告期末(1-9月)	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	244,778,989.66	180,010,158.99	35.98
	年初至报告期末(1-9月)	上年初至上年报告期末(1-9月)	比上年同期增减(%)
营业收入	3,418,989,164.04	2,672,472,317.58	27.93
归属于上市公司股东的净利润	220,185,592.29	159,365,693.16	38.16
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	216,762,727.11	156,561,538.89	38.45
加权平均净资产收益率(%)	7.28	8.92	减少 1.64 个百分点
基本每股收益(元/股)	0.607	0.484	25.41
稀释每股收益(元/股)	0.607	0.484	25.41

非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期金额(7-9月)	年初至报告期末金额(1-9月)	说明
非流动资产处置损益	-117,030.72	-672,011.55	
越权审批,或无正式批准文件,或偶发性的税收返还、减免			
计入当期损益的政府补助,但与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	1,198,736.09	5,866,350.27	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费			
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益			
非货币性资产交换损益			
委托他人投资或管理资产的损益			
因不可抗力因素,如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备			
债务重组损益			
企业重组费用,如安置职工的支出、整合费用等			
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益			
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益			
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益			
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益			
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回			
对外委托贷款取得的损益			
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益			
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响			
受托经营取得的托管费收入			
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-2,048,105.12	-300,968.94	
其他符合非经常性损益定义的损益项目			
少数股东权益影响额(税后)	-40,765.92	-247,162.14	
所得税影响额	241,599.94	-1,223,342.45	
合计	-765,565.73	3,422,865.19	

2.2 截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东(或无限售条件股东)持股情况表

单位:股

股东总数(户)						9,569
前十名股东持股情况						
股东名称(全称)	期末持股数量	比例(%)	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况		股东性质
				股份状态	数量	
湖南益丰医药投资管理有限公司	106,152,000	29.27	106,152,000	无		境内非国有法人
高毅	46,272,000	12.76	46,272,000	质押	6,200,000	境内自然人
CAPITAL TODAY INVESTMENT XV (HK) LIMITED	38,112,000	10.51	0	未知		境外法人
CAPITALTODAY INVESTMENT XIV (HK) LIMITED	37,896,000	10.45	0	未知		境外法人
香港中央结算有限公司	15,980,477	4.41	0	未知		境外法人
招商银行股份有限公司-汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金	10,100,077	2.78	0	未知		未知
湖南益之丰医药咨询管理有限公司	7,900,000	2.18	7,900,000	无		境内非国有法人
申万宏源证券有限公司	5,357,705	1.48		未知		境内非国有法人
华融期货有限责任公司-宁波华融盈科投资合伙企业(有限合伙)	5,042,546	1.39		未知		其他
国联安基金-浦发银行-北京信托-北京信托·丰收理财 018 号集合资金信托计划	4,190,126	1.16		未知		其他

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
CAPITAL?TODAY INVESTMENT XV (HK) LIMITED	38,112,000	人民币普通股	38,112,000
CAPITALTODAY INVESTMENT XIV (HK) LIMITED	37,896,000	人民币普通股	37,896,000
香港中央结算有限公司	15,980,477	人民币普通股	15,980,477
招商银行股份有限公司-汇添富医疗服务灵活配置混合型证券投资基金	10,100,077	人民币普通股	10,100,077
申万宏源证券有限公司	5,357,705	人民币普通股	5,357,705
华融期货有限责任公司-宁波华融盈科投资合伙企业(有限合伙)	5,042,546	人民币普通股	5,042,546
国联安基金-浦发银行-北京信托-北京信托·丰收理财 018 号集合资金信托计划	4,190,126	人民币普通股	4,190,126
中国工商银行股份有限公司-汇添富医药保健混合型证券投资基金	3,176,708	人民币普通股	3,176,708
博时基金-招商银行-博时基金-中船岳升 3 号资产管理计划	2,694,300	人民币普通股	2,694,300
通用技术集团投资管理有限公司	2,613,968	人民币普通股	2,613,968
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中,湖南益丰医药投资管理有限公司、湖南益之丰医药咨询管理有限公司是公司实际控制人高毅先生控制的企业,高毅、湖南益丰医药投资管理有限公司、湖南益之丰医药咨询管理有限公司之间存在关联关系;CAPITAL TODAY INVESTMENT XV (HK) LIMITED 与 CAPITAL TODAY INVESTMENT XIV (HK) LIMITED 均受 CTCG Fund (Cayman)所控制,TODAY INVESTMENT XV (HK) LIMITED 与 CAPITAL TODAY INVESTMENT XIV (HK) LIMITED 存在关联关系。未知其它股东是否存在关联关系或一致行动。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

2.3 截止报告期末的优先股股东总数、前十名优先股股东、前十名优先股无限售条件股东持股情况表

□适用 √不适用

三、重要事项

3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

√适用 □不适用

科 目	期末余额	期初余额	变动幅度	说明
应收票据	1,827,791.82	1,381,451.40	32.31%	主要是增加应收票据结算所致
预付款项	224,848,175.67	98,027,682.29	129.37%	主要是预付部分商品采购货款增加所致
可供出售金融资产	61,650,000.00	450,000.00	13600.00%	主要是对外投资增加所致
开发支出	27,017,691.15	14,788,571.06	82.69%	主要是电商项目投入的增加所致
递延所得税资产	4,878,419.96	1,469,253.31	232.03%	主要是按准则确认递延所得税资产增加所致
其他非流动资产	39,380,767.00	9,203,439.89	327.89%	主要是按协议支付收购定金增加所致
应付账款	358,624,352.55	245,497,797.19	46.08%	主要是规模扩大,采购商品增加所致
其他应付款	44,725,853.40	69,697,532.56	-35.83%	主要是按协议支付往来款所致
科 目	本期金额	上期金额	变动幅度	说明
营业税金及附加	25,832,418.40	17,311,587.71	49.22%	主要是按税法计提地方税增加所致
管理费用	139,110,092.65	106,794,921.52	30.26%	主要是经营规模扩大所致
财务费用	-25,641,109.44	-9,951,987.45	157.65%	主要是利用暂时闲置资金理财增加所致。
资产减值损失	9,767,506.20	6,083,540.60	60.56%	主要是计提存货跌价准备增加所致
投资收益	5,240,132.36	2,407,550.16	117.65%	主要是利用暂时闲置资金理财增加所致
经营活动产生的现金流量净额	244,778,989.66	180,010,158.99	35.98%	主要是增加新开和并购门店以及老店销售同比增长所致
投资活动产生的现金流量净额	-120,805,432.80	-1,414,273,729.92	-91.46%	主要是利用暂时闲置资金理财收回所致
筹资活动产生的现金流量净额	-72,877,399.03	1,344,617,434.28	-105.42%	主要是股利分配所致

3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√适用 □不适用

1、门店新增情况

2017 年 7-9 月,公司净增门店 107 家(其中,新开 81 家,收购 18 家,加盟店 20 家,关闭 12 家),截止至 2017 年 9 月 30 日,公司拥有门店 1,890 家(其中加盟店 70 家),总经营面积为 240,406 平方米(不含加盟店经营面积)。

2、收购项目进展情况

(一)报告期内,公司实施了 2 起新的并购项目,具体情况如下:

(1)2017 年 7 月,公司控股子公司荆州市广生堂医药连锁有限公司签订框架协议收购荆州普康大药房连锁有限公司所属的 42 家零售药店的相关资产和业务,购买重组后目标公司 80%股权,转让价格为(4,188.00 万元 + 实际净资产)*80%,公司重组工作正在进行中;

(2)2017 年 8 月,公司控股子公司上海益丰大药房连锁有限公司签订股权转让协议收购上海布衣大药房有限公司 100%股权(1 家大型零售药店),转让价格为 2,786 万,公司重组工作正在进行中。

(二)报告期内,公司并购项目交割情况:

(1)2017 年 6 月,公司签订资产框架协议以不超过现金 1,350 万元(含存货)受让宿迁市大盛医药连锁有限公司所属的 18 家门店的相关资产和业务,该项目于 2017 年 8 月完成资产交割手续;

(2)2017 年 5 月,公司签订框架协议收购广州康信大药房连锁有限公司所属的 34 家零售药店的相关资产和业务,购买重组后目标公司 100%股权,转让价格为(6,600.00 万元 + 实际净资产 - 转入新公司固定资产的评估价值),该项目目标公司正在进行相关证照办理和资产重组等工作,尚未交割完毕。

3.3 报告期内超期未履行完毕的承诺事项

□适用 √不适用

3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生重大变动的警示及原因说明

□适用 √不适用

公司名称益丰大药房连锁股份有限公司

法定代表人高毅

日期 2017 年 10 月 26 日

证券代码:603939 证券简称:益丰药房 公告编号:2017-037

益丰大药房连锁股份有限公司关于 2017 年第三季度主要经营数据的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

根据上海证券交易所发布的上市公司分行业信息披露指引及《关于做好上市公司 2017 年第三季度报告披露工作的通知》相关要求,现将益丰大药房连锁股份有限公司(以下简称"公司")2017 年第三季度主要经营数据披露如下:

一、报告期末主要经营数据

1、主要会计数据

单位:元 币种:人民币

主要会计数据	本报告期(1-9月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)
营业收入	3,418,989,164.04	2,672,472,317.58	27.93
归属于上市公司股东的净利润	220,185,592.29	159,365,693.16	38.16
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	216,762,727.11	156,561,538.89	38.45
经营活动产生的现金流量净额	244,778,989.66	180,010,158.99	35.98
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
归属于上市公司股东的净资产	3,073,885,213.13	2,962,508,018.24	3.76
总资产	4,523,483,438.50	4,221,246,244.90	7.16

2.主要财务指标

主要财务指标	本报告期(1-9月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)
基本每股收益(元/股)	0.607	0.484	25.41
稀释每股收益(元/股)	0.607	0.484	25.41
扣除非经常性损益后的基本每股收益(元/股)	0.598	0.475	25.78
加权平均净资产收益率(%)	7.28	8.92	减少 1.64 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	7.17	8.77	减少 1.60 个百分点

二、报告期门店变动情况

2017 年 7-9 月,公司净增门店 107 家(其中,新开 81 家,收购 18 家,加盟店 20 家,关闭 12 家),截止至 2017 年 9 月 30 日,公司拥有门店 1,890 家(其中加盟店 70 家),总经营面积为 240,406 平方米(不含加盟店经营面积)。

地区	2017年7-9月			
	期初(家)	新增(家)	关闭(家)	期末(家)
中南地区	958	56	5	1,009
华东地区	825	63	7	881
合计	1,783	119	12	1,890

注:上述 12 家门店关闭主要原因系老城区改造、策略性调整等。

特此公告。

益丰大药房连锁股份有限公司董事会

2017 年 10 月 27 日

浙江大丰实业股份有限公司

2017 第三季度报告

公司代码:603081 公司简称:大丰实业

一、重要提示

1.1 公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人丰华、主管会计工作负责人许兆敏及会计机构负责人(会计主管人员)洪军辉保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第三季度报告未经审计。

二、公司基本情况

2.1 主要财务数据

单位:元 币种:人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	2,546,884,134.81	1,906,582,347.86	33.58
归属于上市公司股东的净资产	1,460,643,252.40	875,965,335.13	66.75
	年初至报告期末(1-9月)	上年初至上年报告期末(1-9月)	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	-12,165,367.16	110,309,698.21	-111.03
	年初至报告期末(1-9月)	上年初至上年报告期末(1-9月)	比上年同期增减(%)
营业收入	1,130,930,474.09	1,065,303,392.51	6.16
归属于上市公司股东的净利润	158,269,568.99	131,450,697.56	20.4
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	135,597,569.16	121,095,034.81	11.98
加权平均净资产收益率(%)	13.41	17.12	减少 3.71 个百分点
基本每股收益(元/股)	0.42	0.38	10.53
稀释每股收益(元/股)	0.42	0.38	10.53

非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位:元 币种:人民币

项目	本期金额(7-9月)	年初至报告期末金额(1-9月)	说明
非流动资产处置损益	95,000.08	-66,039.72	
计入当期损益的政府补助,但与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	6,162,090.72	17,724,236.83	
委托他人投资或管理资产的损益	2,784,635.90	2,980,442.66	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益		145,000.00	
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		5,374,200.00	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	533,461.07	255,387.73	
所得税影响额	-1,370,914.90	-3,741,227.67	
合计	8,204,272.87	22,671,999.83	

2.2 截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东(或无限售条件股东)持股情况表

单位:股

股东总数(户)						18,587
前十名股东持股情况						
股东名称(全称)	期末持股数量	比例(%)	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况		股东性质
				股份状态	数量	
丰华	95,884,600	23.86	95,884,600	无		境内自然人
丰岳	55,822,200	13.89	55,822,200	无		境内自然人
宁波上丰盛世投资合伙企业(有限合伙)	22,324,750	5.56	22,324,750	无		境内非国有法人
LOUISA W FENG	20,507,550	5.10	20,507,550	无		境外自然人
上海祥禾泓安股权投资合伙企业(有限合伙)	17,605,700	4.38	17,605,700	无		境内非国有法人
丰其云	14,099,750	3.51	14,099,750	无		境内自然人
傅哲尔	12,474,350	3.10	12,474,350	无		境内自然人
徐吉传	11,749,850	2.92	11,749,850	无		境内自然人
杨吉祥	11,749,850	2.92	11,749,850	无		境内自然人
JAMIN JM FENG	9,243,150	2.30	9,243,150	无		境外自然人

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
中信信托有限责任公司-中信信托鑫涌成泉金融投资集合资金信托计划	2,583,570	人民币普通股	2,583,570
中信信托有限责任公司-中信信托成泉汇涌八期金融投资集合资金信托计划	2,540,556	人民币普通股	2,540,556
彭涛	1,513,915	人民币普通股	1,513,915
华润深国投信托有限公司-华润信托·悦享 1 期集合资金信托计划	1,300,180	人民币普通股	1,300,180
华润深国投信托有限公司-成泉风险缓冲 3 期集合资金信托计划	1,203,697	人民币普通股	1,203,697
王超霞	1,146,207	人民币普通股	1,146,207
北京成泉资本管理有限公司-成泉汇涌一期基金	1,031,409	人民币普通股	1,031,409
李文彬	449,282	人民币普通股	449,282
陈娜婕	352,600	人民币普通股	352,600
李敬多	300,300	人民币普通股	300,300
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中丰岳为丰华之弟,LOUISA W FENG 为丰华之妻,丰其云为丰华之叔,傅哲尔为丰岳之妻,徐吉传和杨吉祥为丰华之姑父,JAMIN JM FENG 为丰华之子,宁波上丰盛世投资合伙企业(有限合伙)由丰华担任执行事务合伙人。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	无		

2.3 截止报告期末的优先股股东总数、前十名优先股股东、前十名优先股无限售条件股东持股情况表

□适用 √不适用

三、重要事项

3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

√适用 □不适用

3.1.1 资产负债表项目变要变动说明:

科目	期末余额	年初余额	变动比例	变动原因
货币资金	? 289,883,015.84	? 216,229,843.08	34.06%	系本期收到募集资金所致
应收票据	?? 33,909,100.00	?? 10,550,000.00	221.41%	系本期收到客户大额票据所致
应收账款	? 798,307,885.94	? 613,533,125.14	30.12%	系本期工程款结算增加但回款较少所致
预付款项	?? 37,953,143.57	?? 26,182,593.18	44.96%	系本期预付材料款增加所致
应收利息	???2,798,273.97		不适用	系本期计提理财产品利息所致
一年内到期的非流动资产	??? 2,544.52	?? 22,828,262.36	-99.99%	系将已经到期长期应收款划归至应收账款所致
其他流动资产	? 329,205,477.96	?? 10,125,959.21	3151.10%	系本期用募集资金购买理财产品所致
长期股权投资	??? 369,728.49	??? 822,892.74	-55.07%	系龙网同传投资损失所致
投资性房地产	?? 4,344,982.06		不适用	系本期将部分房产用于经营出租所致
一年内到期的非流动负债	?? 14,168,901.68	?? 21,290,944.60	-33.45%	系支付融资租赁费用逐月减少所致
其他流动负债	?? 50,459,347.74	?? 37,215,209.88	35.59%	系期末待转销项税额金额较大所致
长期应付款	???6,050,738.88	?? 17,300,579.05	-65.03%	系本期支付融资租赁费用较大所致

3.1.2 损益表项目主要变动说明:

科目	? 本期数?	? 上年同期数?	变动 比例	变动原因
税金及附加	???7,879,222.21	?? -9,429,608.79	不适用	系上期营改增冲销预提营业税及附加影响所致
财务费用	?? -1,305,324.58	???5,140,946.44	-125.39%	系募集资金存银行本期收到较多利息所致
资产减值损失	?? -1,371,311.29	?? 6,348,586.83	-121.60%	系本期应收款项账龄结构改善冲销坏账准备所致
营业外收入	?? 12,635,280.67	???4,915,203.08	157.07%	系本期符合补助确入条件确认政府补助所致
营业外支出	????460,449.83	?? 1,057,243.70	-56.45%	系前期捐赠支出较多所致

3.1.3 现金流量表项目主要变动说明:

科目	? 本期数?	? 上年同期数?	变动 比例	变动原因
收到其他与经营活动有关的现金	???6,424,065.32	?? 3,421,195.97	87.77%	系本期收到较多政府补助所致
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	???8,444,720.83	?? 17,946,010.87	-52.94%	系上期支付较多基建款所致
吸收投资收到的现金	? 542,756,000.00		不适用	系本期收到募集资金所致

3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

□适用 √不适用

3.3 报告期内超期未履行完毕的承诺事项

□适用 √不适用

3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生重大变动的警示及原因说明

□适用 √不适用

公司名称 浙江大丰实业股份有限公司

法定代表人 丰华

日期 2017 年 10 月 26 日

(上接 B82 版)

电话:010-57649619
传真:010-57649620
联系人:朱翔宇
客户服务电话:010-57649619
公司网址:www.lanmao.com
(109)南京苏宁基金销售有限公司
住所:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:钱燕飞
电话:025-66996699-887226
传真:025-66008800-887226
联系人:王锋
客户服务电话:95177
公司网址:www.snjijin.com
(110)一路财富(北京)信息科技有限公司
住所:北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
法定代表人:吴雪秀
电话:+86(10)88312877
传真:+86(10)88312877
联系人:徐越
客户服务电话:400-001-1566
公司网址:http://www.yilucaifu.com/
(111)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人:钟斐斐
电话:010-61840688
传真:010-61840699
联系人:吴季林
客户服务电话:4000618518
公司网址:https://danjuanapp.com
(112)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
法定代表人:王伟刚
电话:010-62680827
传真:010-62680827
联系人:丁向坤
客户服务电话:400-619-9059
公司网址:www.fundzone.cn
(113)上海景谷资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
法定代表人:袁飞
电话:61621602
传真:61621602★819
联系人:袁振荣
客户服务电话:61621602
公司网址:www.g-fund.com.cn
(114)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所:厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼
办公地址:厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼
法定代表人:陈洪生
电话:0592-3122672
传真:0592-3122701
联系人:梁云波
客户服务电话:400-9180808
公司网址:www.xds.com.cn
(115)北京新浪仓石基金销售有限公司
住所:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
法定代表人:李昭琛
电话:010-62676405
传真:8610-62675979
联系人:付文红
客户服务电话:010-62675369
公司网址:www.xincai.com
(116)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼
法定代表人:程刚
电话:010-58160168
传真:010-58160173
联系人:张旭
客户服务电话:400-810-5919
公司网址:www.fengfd.com
(117)上海华信证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼
法定代表人:郭林
电话:021-63898427
传真:021-68776977-8427
联系人:徐璐
客户服务电话:400-820-5999
公司网址:http://shhxzc.hlygcn.com/
(118)天津国美基金销售有限公司
住所:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-1 室
办公地址:北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层
法定代表人:丁东华
电话:010-59287984
传真:010-59287825
联系人:郭宝亮
客服电话:400-111-0889
公司网址:www.gomefund.com
(119)上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址:上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼
法定代表人:戴新装
电话:021-20538888
传真:021-20538999
联系人:江辉
客户服务电话:400-820-1515
公司网址:www.zhengtongfunds.com
(120)南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道 699-1 号
办公地址:南京市玄武区玄武大道 699-1 号
法定代表人:宋时琳
联系人:王旋
联系电话:025-86853969
客服电话:4007-999-999
公司网址:http://jr.tuniu.com
(121)上海万得投资顾问有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
传真:021-50710161
客服电话:400-821-0203
公司网址:www.520fund.com.cn
(122)杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所:杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室
办公地址:杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼
法定代表人:陈刚
联系人:胡璇
联系电话:0571-85267500
传真:0571-85269200
客服电话:0571-86655920
公司网址:www.cd121.com
(123)北京植信基金销售有限公司
住所:北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室 -67
办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号
法定代表人:杨纪锋
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-inv.com
(124)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座
法定代表人:江卉
联系人:赵德赛
电话:4000988511/ 4000888816
传真:010-89188000
客服电话:95118
网址:http://fund.jd.com/
(125)上海朝阳永续基金销售有限公司
住所:浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室
办公地址:上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人:廖冰
联系人:裘爱萍
联系电话:021-802348888
传真:021-80234898
客服电话:4006991888
公司网址:www.998fund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
办公地址:上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
法定代表人:杨皓鹏
总经理:杨皓鹏
成立日期:2004 年 3 月 18 日
电话:021-38429808
传真:021-68419525
联系人:周琳
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
法定代表人:廖海
电话:021-51150298
传真:021-51150398
经办律师:廖海、田卫红
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: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
办公地址: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
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:汤骏
经办会计师:汤骏、朱昀

四、基金的名称

中海能源策略混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在世界能源短缺和中国经济增长模式向节约型转变的背景下,以能源为投资主题,重点关注具备能源竞争优势的行业和企业,精选个股,并结合积极的权重配置,谋求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资范围

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。

本基金投资组合的资产配置:股票资产 30%-95%,债券资产(含短期融资券和资产证券化产品) 0%-65%,权证投资 0%-3%,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品(如股指期货、期权等衍生品),基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金 80%以上的非现金基金资产投资于能源主题类股票、债券、权证等资产。

八、基金的投资理念

基于国家能源战略,综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素,从能源竞争优势的角度评估中国企业的投资价值,进行主动的投资组合管理。

九、基金的投资策略

1、一级资产配置:本基金根据股票和债券估值的相对吸引力模型 (ASSVM, A Share Stocks Valuation Model),依据宏观经济分析和股票债券估值比较进行一级资产配置。ASSVM 模型通过对股票市场和债券市场相对估值判断,决定股票和债券仓位配置。投资决策委员会作为本基金管理人投资的最高决策机构和监督执行机构,决定本基金的一级资产配置。

2、股票投资:本基金围绕能源主题。首先,根据摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业四级分类标准(GICS),对 A 股所有行业进行了重新划分。将 A 股所有行业划分为能源供给型行业和能源消耗型行业;然后,将能源供给型行业细分为能源生产行业和能源设备与服务行业,将能源消耗型行业细分为低耗能行业和高耗能行业(能源下游需求各行业能耗相对高低的界定,主要来源于国家统计局和国家发改委的相关文件)。

本基金股票资产的行业配置主要依据中海能源竞争优势评估体系。本基金依托中海油在能源研究方面的独特优势,收集整理外部能源专家和其他研究机构的研究成果,综合考虑全球地缘政治、军事、经济、气象等多方面因素,结合本公司内部能源研究小组的研究,对未来能源价格的趋势进行预测。在此基础上,行业研究小组根据经济增长和能源约束的动态发展关系,结合未来能源价格趋势的预测,从能源策略的角度,确定能源主题类行业(包括能源供给型行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业和低耗能行业)在组合中的权重。在能源价格趋势向上时,提高能源生产行业、能源设备与服务行业的权重配置。当能源价格趋势向下时,加大高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的权重配置。

同时本基金还将动态调整行业的配置权重,规避能源价格波动引起的风险。

(1)一级股票库构建

本基金主要由金融工程小组采用中海能源竞争优势多因子模型从能源供给型上市公司(包括能源生产行业和能源设备与服务行业)、低耗能行业上市公司以及在高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的上市公司中选取综合得分最高的 300 只左右的股票作为一级股票库。

(2)二级股票库构建

在一级股票库的基础上,由行业研究小组通过分析目标公司的资产分布、盈利结构以及财务状况等指标,综合考察公司的估值、成长性以及在竞争环境中的优势地位等因素精选个股,形成公司的二级股票库。

(3)三级股票库构建

在二级股票库的基础上,由基金经理选择估值合理、公司管理卓越、业务构架清晰、资产分布合理、财务安全、成长性突出且持续的个股,并由投资决策委员会开会审核通过而形成三级股票库。基金经理根据市场变化,自主选择三级股票库中的股票进行投资。

3、债券投资: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。

(1)久期配置:债券组合的久期配置采用自上而下的方法。

1)通过数量分析,预测宏观经济周期趋势性变化,结合货币政策和财政政策,判断市场利率的变化趋势;

2)根据利率变化趋势,确定债券投资组合的久期配置和风险管理方案;

3)根据市场状况,采用有效的投资策略和交易策略构建组合,并通过数量模型优化。

(2)个券选择方法:个券的选择采用自下而上的方法,遵循如下原则。

1)相对价值原则:属性相近的债券,选择收益率较高的券种;在收益率相同的情况下,选择风险(久期)较低的券种。对二者都相近的券种,根据凸性,选择凸性较大的券种。

2)流动性原则:收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种,市场表现有时差别明显。在一般情况下,避免波动性过大的券种,选择流动性较好的券种。

对于信用品种,本基金建立内部信用评估体系,对信用类债券进行二次评级。只有通过评级,基金经理才能进行投资。

4、权证投资

本基金的权证投资将以保值为主要投资策略,以达到控制正股下跌风险、实现保值和锁定收益的目的。同时,发掘潜在的套利机会,以达到增值目的。

本基金持有的权证,可以是因上市公司派送而被动持有的权证,也可以是根据权证投资策略在二级市场上主动购入的权证。

十、基金的投资决策依据和决策程序

(1)投资决策依据

1)国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定;

2)宏观、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础;

3)国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策;

4)证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况;

5)上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势;

6)上市公司的持续盈利能力以及综合价值的评估;

(2)投资决策程序

1)投资决策支持:研究人员、基金经理及相关人员根据独立研究及各咨询机构的研究报告,向投资决策委员会提出宏观经济分析报告和投资策略报告等决策支持。

2)投资原则的制定:投资决策委员会在遵守国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定的前提下,根据研究人员和基金经理的有关报告,决定基金投资的主要原则,对基金投资组合的资产配置比例等提出指导性意见。

3)研究支持:研究分析人员根据投资决策委员会的决议,为基金经理提供各类分析报告和投资建议;也可根据基金经理的要求进行有关的研究。

4)制定投资决策:基金经理按照投资决策委员会决定的投资原则,根据研究分析人员提供的投资建议以及自己的分析判断,做出具体的投资决策。

5)风险管理与绩效评估:风险管理通过建立一系列完整的风险预警、风险识别以及风险控制体系,运用数量化和系统化的方法来识别、测度、监督和控制风险。风险控制委员会定期召开会议,听取投资管理部、基金经理、监察稽核人员对基金投资组合进行的风险评估,并提出风险控制意见。绩效评估通过业绩表现分析、归因分析、绩效检讨报告,对基金投资进行总结,协助基金经理提高投资业绩。

6)组合的调整:组合调整包括组合管理本身所进行的调整、根据风险控制与绩效评估报告的要求所进行的调整以及被动调整是基金应对申购、赎回进行的调整。基金经理可在其权限范围内对组合进行调整,超出其权限需报投资决策委员会审批。

十一、基金的投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但法律法规或国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内主承销的证券;

(7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)当时有效的法律法规、国务院证券监督管理机构及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;

(2)本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;

(3)投资于能源生产行业、低耗能行业、能源设备与服务行业、高耗能行业中单位能耗产出比具有竞争优势的企业的比例不低于股票资产的 80%;

(4)本基金投资短期融资券的比例不超过基金资产净值的 20%;

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

(6)本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%;

(8)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(9)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制;

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩基准为:沪深 300 指数涨跌幅 × 65%+上证国债指数涨跌幅 × 35%

本基金的股票资产占基金资产的 30%-95%。正常情况下,本基金的股票仓位将保持在 65%左右,债券仓位将保持在 35%左右。因此,业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。

本基金股票组合的业绩基准采用沪深 300 指数;本基金债券组合的业绩基准采用上证国债指数。沪深 300 指数于 2005 年 4 月正式发布,是反映沪深两个市场整体走势的"晴雨表"。沪深 300 指数的运行结果显示,该指数走势强于上证综合指数和深证综合指数。沪深 300 指数成份股为 A 股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票,能够反映市场主流投资的收益情况。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十三、基金的风险收益特征

本基金属混合型证券投资基金,为证券投资基金中的中高风险品种。

本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

十四、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于 2017 年 9 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据为截至 2017 年 6 月 30 日报告期末的二季报数据。

1、 基金资产组合情况

截至 2017 年 6 月 30 日,中海能源策略混合型证券投资基金资产净值为 1,383,861,987.15 元,基金份额净值为 0.6845 元,累计基金份额净值为 0.9945 元。其资产组合情况如下:

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,206,811,684.89	86.77
	其中:股票	1,206,811,684.89	86.77
2	基金投资	-	-
	固定收益投资	4,517,000.00	0.32
	其中:债券	4,517,000.00	0.32
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
6	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	164,246,147.02	11.81
8	其他资产	15,307,308.86	1.10
9	合计	1,390,882,140.77	100.00

1、 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	161,372,038.68	11.66
C	制造业	963,710,621.79	69.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,713,924.00	0.99
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,680,560.00	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	41,326,900.80	2.99
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,206,811,684.89	87.21

2、 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	4,037,194	95,842,985.56	6.93
2	002460	赣锋锂业	1,978,300	91,496,375.00	6.61
3	002466	天齐锂业	1,615,034	87,777,097.90	6.34
4	002236	大华股份	3,675,571	83,839,774.51	6.06
5	300450	先导智能	1,271,500	65,825,555.00	4.76
6	000858	五 粮 液	1,165,756	64,885,978.96	4.69
7	600547	山东黄金	1,913,939	55,370,255.27	4.00
8	000975	银泰资源	4,223,733	53,345,747.79	3.85
9	600489	中金黄金	5,249,854	52,656,035.62	3.81
10	002456	欧菲光	2,334,717	42,421,807.89	3.07

3、 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,517,000.00	0.33
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	4,517,000.00	0.33

4、 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139260	16韶关债	50,000	4,517,000.00	0.33

5、 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

9.2 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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

10.3 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。

11、投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 截至 2017 年 6 月 30 日,本基金的其他资产项目构成如下:

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	745,197.72
2	应收证券清算款	14,409,497.64
3	应收股利	-
4	应收利息	134,113.62
5	应收申购款	18,499.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,307,308.86

11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 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。

十五、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2017 年 6 月 30 日。

基金本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
20070313-20071231	70.94%	1.71%	59.28%	1.42%	11.66%	0.29%
20080101-20081231	-49.30%	2.06%	-47.38%	1.97%	-1.92%	0.09%
20090101-20091231	61.42%	1.62%	57.62%	1.33%	3.80%	0.29%
20100101-20101231	0.49%	1.35%	-6.64%	1.03%	7.13%	0.32%
20110101-20111231	-37.38%	1.20%	-15.51%	0.84%	-21.87%	0.36%
20120101-20121231	-2.63%	1.15%	6.54%	0.83%	-9.17%	0.32%
20130101-20131231	4.06%	1.19%	-3.62%	0.91%	7.68%	0.28%
20140101-20141231	10.24%	1.13%	33.64%	0.79%	-23.40%	0.34%
20150101-20151231	21.50%	2.55%	7.61%	1.62%	13.89%	0.93%
20160101-20161231	-18.77%	2.02%	-5.88%	0.91%	-12.89%	1.11%
20170101-20170630	3.54%	0.91%	7.07%	0.37%	-3.53%	0.54%
自基金合同生效起至今	0.47%	1.64%	55.10%	1.20%	-54.63%	0.44%

十六、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times2.5‰\div$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,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(三)与基金销售有关的费用

1、基金认购费

本基金认购采用金额认购、前端收费的模式,份额面值为 1.00 元人民币。认购费率:

购买金额(M)	认购费率
M<100 万	1.20%
100万≤M<500 万	0.80%
500万≤M<1000 万	0.20%
M≥1000 万	每笔 1000 元

认购费用的计算公式:

认购费用 = 认购金额 × 认购费率

本基金的认购费用由基金认购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、基金申购费

本基金申购费用采取前端收费模式,申购费率如下:

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户申购费率见下表:(单位:元)

购买金额(M)	申购费率
M<100 万	0.60%
100万≤M<300 万	0.30%
300万≤M<500 万	0.06%
M≥500 万	按笔收取,1000 元/笔

非养老金客户申购本基金的申购费率见下表:

(单位:元)

购买金额(M)	申购费率
M<100 万	1.50%
100万≤M<300 万	1.00%
300万≤M<500 万	0.60%
M≥500 万	按笔收取,1000 元/笔

申购费用的计算公式:

申购费用 = 申购金额-申购金额 /(1+ 申购费率)

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3、基金赎回费

本基金赎回采取份额赎回的模式,赎回费用按持有人持有该部分基金份额的时间分段设定,赎回费率如下:

持有时间(N)	赎回费率
N<1 年	0.5%
1年≤N<2 年	0.25%
N≥2 年	0

赎回费用的计算公式:

赎回总金额=赎回份数 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额(赎回费率

本基金的赎回费用由基金赎回人承担。赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

4、基金转换费

本基金的转换费用及计算方法等详见基金转换公告。

(四)其他费用

上述(一)基金费用的种类中第 3-6 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(五)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(六)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

(七)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十七、对招募说明书更新部分的说明

(一)在"基金管理人"部分进行了更新。

(二)对"基金托管人"部分进行了更新。

(三)对"相关服务机构"部分进行了更新。

(四)在"基金的投资"部分,对"基金投资组合报告"按最新资料进行了更新。

(五)对"基金业绩"按最新资料进行了更新。

(六)在"其他应披露事项"部分,披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇一七年十月二十七日