（上接B21版）

公司网址：www.fengfd.com

（113）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

（114）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：王婉

联系电话：025-86853969

客服电话：4007-999-999

公司网址：http://jr.tuniu.com

（115）上海万得基金销售有限公司

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：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11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

（116）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：张丽琼

联系电话：0571-85262700

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86915761

公司网址：www.cd121.com

（117）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

（118）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/

（119）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：袁爱萍

联系电话：021-80248888

传真：021-80234898

客服电话：4006991888

公司网址：www.998fund.com

（120）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：徐英

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

（121）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-63136184

客服电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

（122）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号

法定代表人：陶捷

联系人：陆铮

客户服务电话：4000279899

公司网址：www.buyfunds.cn

（123）和耕传承基金销售有限公司

住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

法定代表人：李淑慧

联系人：罗毅

客户服务电话：0371-85518396

公司网址：www.hgcpb.com

（124）徽商期货有限责任公司

住所：安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层、6号楼1、2层

办公地址：安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层、6号楼1、2层

法定代表人：吴国华

联系人：申倩倩

客户服务电话：4008878707

公司网址：www.hsqh.net

（125）北京微动利投资管理有限公司

住所：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341

办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341

法定代表人：梁洪军

联系人：李长军

客户服务电话：400-819-6665

公司网址：www.buyforyou.com.cn

（126）成都华羿恒信基金销售有限公司

住所：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区菊锦路88号1号楼32楼2号

办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区菊锦路88号1号楼32楼2号

法定代表人：赵壁

联系人：徐莉

客户服务电话：400-8010-009

公司网址：http://www.huayihengxin.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：021-68419328

联系人：周琳

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

法定代表人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、黎明

（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：徐艳

经办会计师：徐艳、朱昀

四、基金的名称

中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

在全球环境状况不断恶化、气候逐渐变暖以及我国节能减排压力日益突出的背景下，以环保为投资主题，重点关注具有环保责任和环保意识，并同时具有成长潜力的环保产业和新能源产业以及具有环保竞争优势的行业和企业，充分分享国内环保业和新能源产业发展带来的投资机会，并精选个股，结合积极地权重配置，谋求基金资产的长期稳定增值。

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：股票资产占基金资产的30%—80%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）占基金资产的20%—70%，权证投资占基金资产净值的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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他产品（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。

八、基金的投资理念

基于我国节能减排政策以及其他环保相关政策的推进发展，考虑环保产业在我国的发展前景，综合比较不同行业和公司在环保政策下面临的竞争环境和机遇，挖掘在兼具环保责任和环保意识的基础上具有成长潜力的上市公司及新能源领域的具有成长潜力的上市公司，进行主动的投资管理。

本基金对所有的A股上市公司进行行业分类，首先分成环保行业类与非环保行业类；再将非环保行业按行业的节能减排情况分为环保优势行业与环保劣势行业；最后根据环保劣势行业的环境数据综合评价，将环保劣势行业分为环保改善行业和环保潜力行业。

本基金认可的环保与新能源主题类股票包括：

（1）环保行业，包括环保设备、环保服务和资源利用等相关行业。

（2）新能源行业，包括风电、核电、光伏、智能电网、新能源汽车等相关行业。

（3）环保优势行业、环保优势行业主要集中在第三产业如金融地产、公用事业、商业旅游、信息服务、食品饮料、消费等行业。

当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级，从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述环保新能源主题的识别及认定。

九、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，本基金主要考虑如下因素：

宏观经济，包括国际经济和国内经济等，判断经济周期是否处于衰退、复苏、过热和滞胀阶段，通过投资时钟，确定阶段性较优资产。历史表明，复苏期股票最优，过热期商品最优，滞胀期现金最优，衰退期债券最优。

政策层面，包括宏观政策（货币和财政政策）松紧、区域经济扶持政策力度、资本市场相关政策和行业政策扶持等，不同政策发布会对不同资产类别产生不同程度影响。

市场估值，包括市场的资金供求状况、估值水平、不同类资产的预期收益率水平和相对吸引力等。

市场情绪，包括市场成交量、股票账户新增开户数、持仓账户数及其他反映投资者情绪的技术指标。

本基金将深入分析上述四方面的情况，对每一方面的情况进行打分。每一大类因素设置不同的权重，并且根据市场的变化，对各因素的权重进行相应调整。通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。

2、行业/久期配置

行业配置：本基金以环保行业配置和新能源行业配置为主，其中环保行业配置采取以行业环保水平为主要配置原则的倒金字塔环保行业配置。即环保行业作为行业配置的重点，其次是非环保行业中的环保优势行业，再次是环保劣势行业中的环保改善行业，最后则是环保潜力行业。本基金重点关注环保行业、新能源行业以及非环保行业中的环保优势行业，以突出本基金的环境主题特征。

具体由行业研究小组完成行业前景分析报告；金融工程研究小组基于行业研究小组的研究成果，并综合流通市值、成交金额等多项指标对关注的行业进行综合评分和筛选；基金经理综合动态调整不同行业间的权重配置。

久期配置：债券组合的久期配置采用自上而下的方法。通过数量模型对宏观经济周期趋势性变化进行分析预测，并结合货币政策和财政政策，分析预测债券市场收益率变化趋势。利用债券回报分析模型进行情景分析，判断不同期限债券在市场收益率变化条件下的风险收益关系，确定投资组合的久期配置。

3、股票投资

本基金80%以上的股票资产投资于环保与新能源主题类股票。

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略：

（1）以行业的环保水平、行业的环境竞争优势以及是否属于新能源领域对行业进行分类，并将环保产业、环保优势行业、环保改善行业、环保潜力行业与新能源行业的股票作为备选构建初选股票池；

（2）依据公司所属行业的环境优势评级赋予公司环境优势因子，通过中海财务评价体系和MMVA估值评价体系为评估基础，对公司的财务优势、估值优势综合评估进行量化选股，构建优选股票池；

（3）通过环境战略矩阵模型分析优选股票池中公司的环境战略，并采用中海上市公司环境评价体系对公司的环境优势进行综合评估；在此基础上，选取基本面较优，既具备环保优势，又有成长优势，能够在环保基础上实现可持续发展的上市公司来构建核心股票池；

（4）基金经理通过对核心股票池中的股票价值分析和市场环境的判断，相机选择具有估值优势的公司构建投资组合，并根据市场变化自主选择投资时机和权重，长期持有并结合适度波段操作，争取获得较高收益。

4、债券投资

本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

本基金通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择遵循以下原则：

（1）相对价值原则

属性相近的单个债券，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。

5、权证投资策略

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证。在权证投资中，本基金将对权证标的证券的基本面进行研究，利用Black-Scholes-Merton模型、二叉树模型及其它权证定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，权证投资策略主要从价值投资的角度出发，采用如下策略进行权证投资：

（1）套利投资策略

在权证和标的股票之间出现套利机会时，对权证进行套利投资。

（2）风险锁定策略

根据认沽权证和标的股票之间的价差，在投资标的股票的时候，同时投资认沽权证，锁定投资风险。

（3）股票替代策略

在价值投资的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，寻找溢价率低（甚至折价）的权证，利用权证替代股票，以期降低风险或提高潜在收益。

由于权证市场的高波动性，本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险，寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。

（4）杠杆投资策略

对以根据量化模型所选品种为标的股票的权证进行模型定价研究，利用权证的杠杆效应，以期获得超额收益。

十、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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（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、中国证监会及《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禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可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：

a、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%；

b、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%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

c、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%；

d、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%，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%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定。

e、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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

f、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

g、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

h、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

i、本基金投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

j、本基金财产参与股票发行申购，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；

k、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

l、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

m、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

n、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除上述第e、i、k、l项外，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。

十一、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%。

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。

中国债券总指数由中央债券登记结算中心于2003年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间记账式国债（固定、浮动利率）、金融债、中央国债登记结算有限公司将中国债券总指数情况于中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）上公开发布。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持30%-80%的股票资产，20%-70%的债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）。从长期看，本基金股票资产平均配置比例为60%，债券资产的投资比例为40%，因此本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为60%和40%。因此，“沪深300指数涨跌幅×60%+中国债券总指数涨跌幅×40%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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。

十二、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，高于债券型基金和货币市场基金。

十三、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2018年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至2018年3月31日，中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金资产净值为217,406,031.96元，基金份额净值为0.994元，累计基金份额净值为0.994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	143,427,405.35	61.32
	其中：股票	143,427,405.35	61.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,123,904.20	19.29
	其中：债券	45,123,904.20	19.29
	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	31,601,017.60	13.51
8	其他资产	13,762,648.11	5.88
9	合计	233,914,975.26	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	95,806,795.30	44.07
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	4,342,878.00	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,626,534.85	12.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,293,124.38	4.73
L	租赁和商务服务业	4,254,069.82	1.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	282,240.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	821,763.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	143,427,405.35	65.97

3、报告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	603019	中科曙光	173,700	9,503,127.00	4.37
2	002311	海大集团	317,700	7,681,986.00	3.53
3	300558	贝达药业	113,300	7,545,780.00	3.47
4	002371	北方华创	164,400	7,541,028.00	3.47
5	601155	新城控股	202,491	7,123,633.38	3.28
6	600845	宝信软件	255,800	7,083,102.00	3.26
7	300377	赢时胜	383,800	6,839,316.00	3.15
8	600038	中直股份	139,700	6,754,495.00	3.11
9	000977	浪潮信息	272,000	6,699,360.00	3.08
10	601877	正泰电器	251,000	6,608,830.00	3.04

4、报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	16,359,271.20	7.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,764,633.00	13.23
	其中：政策性金融债	28,764,633.00	13.23
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	45,123,904.20	20.76

5、报告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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开1302	281,730	28,764,633.00	13.23
2	019563	17国债09	163,560	16,359,271.20	7.52

6、报告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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（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。

10、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）截至2018年3月31日，本基金的其他资产项目构成如下：

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	349,212.96
2	应收证券清算款	12,481,228.72
3	应收股利	-
4	应收利息	895,723.52
5	应收申购款	36,482.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,762,648.11

（4）报告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债。

（5）报告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。

（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。

十四、基金的业绩

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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截至2018年3月31日）：

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
2010.12.09-2010.12.31	-1.00%	0.43%	-0.69%	0.92%	-0.31%	-0.49%
2011.01.01-2011.12.31	-23.03%	0.85%	-13.53%	0.78%	-9.50%	0.07%
2012.01.01-2012.12.31	7.48%	1.11%	6.02%	0.76%	1.46%	0.35%
2013.01.01-2013.12.31	-0.49%	1.36%	-4.94%	0.84%	4.45%	0.52%
2014.01.01-2014.12.31	29.82%	1.30%	34.56%	0.73%	-4.74%	0.57%
2015.01.01-2015.12.31	9.45%	2.29%	8.54%	1.49%	0.91%	0.80%
2016.01.01-2016.12.31	-27.81%	1.72%	-5.90%	0.84%	-21.91%	0.88%
2017.01.01-2017.12.31	18.78%	0.90%	12.15%	0.38%	6.63%	0.52%
2018.01.01-2018.03.31	0.10%	1.40%	-1.04%	0.70%	1.14%	0.70%
自基金合同生效起至今	-0.60%	1.43%	32.00%	0.88%	-32.60%	0.55%

注：本基金合同生效日为2010年12月9日，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十五、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、律师费和诉讼费。

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、按照法律法规有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷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

基金管理费每日计提，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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷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

基金托管费每日计提，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。

上述一、基金费用的种类中第3—7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。

（三）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。

（四）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、基金销售费率等相关费率。

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。

基金管理人必须于新的费率实施前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）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。

十六、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”部分，对相关内容进行补充。

（二）在“绪言”部分，对相关法律法规的名称进行了补充。

（三）在“释义”部分，对相关释义进行了补充

（四）在“基金管理人”部分，对“主要人员情况”进行了更新。

（五）对“基金托管人”部分进行了更新。

（六）对“相关服务机构”部分进行了更新。

（七）在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的数额限制”、“申购费用和赎回费用”、“拒绝或暂停申购的情形及处理方式”、“暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”和“巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容进行了更新。

（八）在“基金的投资”部分，对“投资范围”和“投资限制”的相关内容进行了更新，并对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。

（九）对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。

（十）在“基金资产的估值”部分，对“估值方法”和“暂停估值的情形”的相关内容进行了更新。

（十一）在“基金的信息披露”部分，对“信息披露的种类、披露时间和披露形式”的相关内容进行了更新。

（十二）在“风险揭示”部分，对“基金管理风险”的相关内容进行了更新。

（十三）对“基金托管协议的内容摘要”部分按最新《中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》进行了更新。

（十四）在“其他应披露的事项”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

二〇一八年七月二十三日

前海开源基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧为代销机构并开通定投业务和参与其费率优惠活动的公告

根据前海开源基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与上海大智慧基金销售有限公司（以下简称“上海大智慧”）签署的基金销售服务代理协议，自2018年7月23日起，上海大智慧将代理销售本公司旗下基金。现将有关事项公告如下：

一、适用基金及业务范围

基金名称	基金代码	是否开通定投业务	每期定投最低金额
前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金A	000423	是	100元
前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金C	001865	是	100元
前海开源可转债债券型发起式证券投资基金	000536	是	100元
前海开源中证军工指数型证券投资基金A	000596	是	100元
前海开源中证军工指数型证券投资基金C	002199	是	100元
前海开源沪深300指数型证券投资基金	000656	是	100元
前海开源大海洋战略经济灵活配置混合型证券投资基金	000690	是	100元
前海开源新经济灵活配置混合型证券投资基金	000689	是	100元
前海开源中国成长灵活配置混合型证券投资基金	000788	是	100元
前海开源股息率100强等权重股票型证券投资基金	000916	是	100元
前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金A	000932	是	100元
前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金C	000933	是	100元
前海开源大安全核心精选灵活配置混合型证券投资基金	000969	是	100元
前海开源中证大农业指数增强型证券投资基金	001027	是	100元
前海开源高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金	001060	是	100元
前海开源工业革命4.0灵活配置混合型证券投资基金	001103	是	100元
前海开源中航军工指数分级证券投资基金	164402	是	100元
前海开源中证健康产业指数分级证券投资基金	164401	是	100元
前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金A	001162	是	100元
前海开源优势蓝筹股票型证券投资基金C	001638	是	100元
前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金A	001209	是	100元
前海开源一带一路主题精选灵活配置混合型证券投资基金C	002080	是	100元
前海开源国家比较优势灵活配置混合型证券投资基金	001102	是	100元
前海开源再融资主题精选股票型证券投资基金	001178	是	100元
前海开源沪港深农业主题精选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)	164403	是	100元
前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金A	001278	是	100元
前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金C	002360	是	100元
前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金A	001302	是	100元
前海开源金银珠宝主题精选灵活配置混合型证券投资基金C	002207	是	100元
前海开源中国稀缺资产灵活配置混合型证券投资基金A	001679	是	100元
前海开源中国稀缺资产灵活配置混合型证券投资基金C	002079	是	100元
前海开源现金增利货币市场基金A	001870	是	100元
前海开源现金增利货币市场基金B	001871	否	-
前海开源现金增利货币市场基金E	004210	是	100元
前海开源沪港深蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金	001837	是	100元
前海开源强势共识100强等权重股票型证券投资基金	001849	是	100元
前海开源沪港深智慧生活优选灵活配置混合型证券投资基金	001972	是	100元
前海开源恒远灵活配置混合型证券投资基金	002407	是	100元
前海开源沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金	001875	是	100元
前海开源人工智能主题灵活配置混合型证券投资基金	001986	是	100元
前海开源沪港深汇鑫灵活配置混合型证券投资基金A	001942	是	100元
前海开源沪港深汇鑫灵活配置混合型证券投资基金C	001943	是	100元
前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金A	002666	是	100元
前海开源沪港深创新成长灵活配置混合型证券投资基金C	002667	是	100元
前海开源恒泽保本混合型证券投资基金A	002690	是	100元
前海开源恒泽保本混合型证券投资基金C	002691	是	100元
前海开源沪港深龙头精选灵活配置混合型证券投资基金	002443	是	100元
前海开源沪港深新机遇灵活配置混合型证券投资基金	002860	是	100元
前海开源鼎安债券型证券投资基金A	002971	是	100元
前海开源鼎安债券型证券投资基金C	002972	是	100元
前海开源