（上接B46版）

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
(115)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
(116)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：陆锋
客户服务电话：4000279899
公司网址：www.buyfunds.cn
(117)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：罗聪
客户服务电话：0371-85518396
公司网址：www.hgccpb.com
(118)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
(119)北京微动利基金销售有限公司
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：季长军
客户服务电话：400-819-6665
公司网址：www.buyforyou.com.cn
(120)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蜀锦路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蜀锦路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
(121)上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
联系人：李娟
联系电话：021-50810687
客服电话：021-50810673
公司网址：www.wacaijjjin.com
(122)上海大智慧基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人：申健
联系人：宋楠
联系电话：021-20219988
客服电话：021-20292031
网址：https://www.wg.com.cn/
(123)北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法定代表人：徐福星
联系人：李美
电话：010-68292940
传真：010-68292964
客户服务电话：400-600-0030
网址：www.bfunds.com
(124)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层
法定代表人：蒋舰
联系人：刘聪慧/徐晓荣
电话：010-58170905/010-58170876
传真：010-58100800
客户服务电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com.cn
(125)北京格上富信基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人：李悦章
联系人：曹庆展
客户服务电话：400-066-8586
公司网址：www.igesafe.com
(126)北京电盈基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人：程刚
联系人：赵立芳
客户服务电话：400-100-3391
公司网址：http://www.dianyingfund.com/
(127)万家财富基金销售（天津）有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层
法定代表人：李修辞
联系人：邵玉磊
客户服务电话：010-59013825
公司网址：http://www.wanjiawealth.com/
(128)深圳前海财厚基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室
法定代表人：杨艳平
联系人：胡闻智
客户服务电话：400-128-6800
公司网址：www.caiho.cn

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、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、蔺育化

**四、基金的名称**

中海量化策略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**

根据量化模型，精选个股，积极配置权重，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：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%，本基金保持的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

**八、基金的投资理念**

以量化模型作为资产配置与构建投资组合的基础，以理性的积极投资管理获取长期的稳健收益。

**九、基金的投资策略**

本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上，通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置，动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。同时，本基金运用现代金融工程技术，对各类宏观经济指标与股票市场的领先滞后关系与相关性进行分析，筛选出一组针对股票市场的宏观经济领先指标。此外，本基金将采用我公司的市场泡沫度模型（SMBMM，Stock Market Bubble Measure Model）定期计算股票市场的泡沫度，以度量市场情绪状态。这些宏观经济领先指标和市场泡沫度模型将用于辅助大类资产配置。

1、股票投资

本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略，施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。

首先，选取代表性盈强的反映公司盈利能力的指标，主要包括过去三年平均EPS、ROE、毛利率三项指标，对所有A股上市公司进行筛选从而得到一级股票库。

其次，在一级股票库初选的基础之上，本基金选取相应的盈利性指标、估值指标以及一致预期指标，基于熵值法确定各个指标权重，对一级库股票进行打分排名，从而筛选出二级股票库。其中，盈利性指标包括过去三年平均毛利率、EPS及ROE；估值指标包括PE、PB、PS、PCF及PEG等指标；一致预期指标包括EG、RC、RA及EY等指标。

在选股指标权重的确定上，以往对于选股指标权重的确定主要采用主观评定法或是简单等权法。“熵值法”动态赋权的特点在于可根据市场情况的变化而动态量化赋权，即若所有股票的某项选股指标差异度高，则该指标的权重就会相对较高；相反，若所有股票的某项指标差异度低，则该指标的权重就会相对较低。

最后，在行业权重配置方面，我们采用Black-Litterman模型（以下简称BL模型），结合市场均衡状态和一致预期数据计算出最优行业配置权重。结合BL模型给出的行业配置权重，我们确定股票组合每只股票的配置比例。

2、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，投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。

本基金债券投资组合资产配置采用自上而下的方法，个券选择采用自下而上的方法，具体债券资产配置、个券选择及投资流程如下：

（1）债券资产配置方法：自上而下。

1）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。

利用中海宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据一定的收益率模型为各种固定收益投资品种进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置和风险管理方案。

2）期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析，选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3）依据信用利差分析，对债券类到进行自上而下资产配置

本基金根据国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

（2）个券选择方法：自下而上。

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。个券选择基于相对价值和流动性进行。

普通债券上，本基金认为普通债券，包括国债、金融债、企业债和公司债的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并帮助投出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择投资于定价低估的债券品种。

企业债券类证券（包括企业债、公司债、可分离债的债券部分）是获得较高投资收益不可忽视的一部分，也是本基金在力争在低风险下获取较高收益时将采取的主要投资策略。本基金结合对宏观经济态势的判断与企业的盈利性、成长性评估债券的信用风险，本基金将在该风险评估基础上，依据对企业所处行业的研究以及企业自身发展与偿还能力的分析选择选择符合目标久期和资产配置需要的企业债券类证券以期获得高于基准的收益。

可转债品种上，本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资，着重对可转债的发行条款、以基础股票进行分析与研究，重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行投资。

（3）债券投资流程

具体流程上，本基金债券投资组合管理分为三个主要阶段：投资规划、投资实施、投资反馈调整阶段。按照以下步骤进行：

第一阶段：投资规划

1）分析研究

研究发展部、固定收益部根据宏观经济数据，并跟踪中国人民银行及各部委的各项政策，研究各种政策的力度和影响，分析判断宏观经济变化趋势，确定市场利率变化方向，定期或不定期地出具债券市场研究报告。

2）投资计划

在上述研究的基础上，由基金经理结合市场情况，拟定投资计划，供投资决策委员会讨论。

3）资产配置策略

投资决策委员会定期召开会议，依据研究发展部、固定收益部、基金经理的研究分析报告，确定债券组合的久期等配置。

第二阶段：投资实施

4）投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的资产配置策略，结合债券研究报告，确定券种的具体选择，并负责日常的维护和调整。

5）投资决策交易执行

交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行交易计划。在各种交易平台完成交易，并将交易结果反馈基金经理。

第三阶段：投资反馈调整

6）投资组合动态调整

基金经理负责对投资组合进行动态调整。金融工程研究小组分析当前收益率曲线的形态，以及各市场之间的差异，发掘其中可能的套利机会，供基金经理参考，适时调整组合。

3、资产支持证券投资

本基金将在严格遵守相关法律法规和基金合同的前提下，深入分析影响资产支持证券定价的多种因素，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等，秉持稳健投资原则，综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。基于稳健投资规避信用风险，本基金只投资于信用评级为AAA的资产支持证券品种。

4、权证投资

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、本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）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%；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%。

（3）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%。

（4）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。

（5）现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（6）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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用登记下降、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。

（7）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%。

（8）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，不得超过基金资产净值的10%。

（9）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%。

（10）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。

（11）一只基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的百分之二；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的百分之十；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整。

（12）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；

（13）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；

（14）本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定。

（15）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。

除上述第(5)、(6)、(12)、(13)项另有规定外，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、监管部门另有规定的从其规定。

2、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）向他人贷款或者提供担保。

（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基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券。

（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、操纵证券交易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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

**十一、基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准：沢深300指数涨跌幅×80%＋中国债券总指数涨跌幅×20%。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。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沢深300指数；本基金债券组合的业绩基准采用中国债券总指数。

沢深300指数于2005年4月正式发布，是反映沢深两个市场整体走势的“晴雨表”。沢深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。沢深300指数成份股为A股市场中市代表性好、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、银行间市场记账式国债（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（www.chinabond.com.cn）上公开发布。

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**

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，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9月30日报告期末的第三季度报告数据，其中所列财务数据未经审计。

1、 基金资产组合情况

截至2018年9月30日，中海量化策略混合型证券投资基金资产净值为167,560,887.45元，基金份额净值为0.814元，累计基金份额净值为1.351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 | 153,880,024.55 | 90.74 |
| | 其中：股票 | 153,880,024.55 | 90.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,145,762.00 | 1.85 |
| | 其中：债券 | 3,145,762.00 | 1.85 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,621,597.68 | 3.31 |
| 8 | 其他资产 | 6,937,578.25 | 4.09 |
| 9 | 合计 | 169,584,962.48 | 100.00 |

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 75,586,304.65 | 45.11 |
| 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 | 78,293,719.90 | 46.73 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 153,880,024.55 | 91.84 |

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

| 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 | 300253 | 卫宁健康 | 662,065 | 9,546,977.30 | 5.70 |
| 2 | 600588 |用友网络 | 336,970 | 9,374,505.40 | 5.59 |
| 3 | 300451 | 创业软件 | 527,400 | 9,255,870.00 | 5.52 |
| 4 | 300036 | 超图软件 | 387,700 | 8,587,555.00 | 5.13 |
| 5 | 600271 | 航天信息 | 303,000 | 8,432,490.00 | 5.03 |
| 6 | 002153 | 石基信息 | 245,900 | 8,301,584.00 | 4.95 |
| 7 | 600845 | 宝信软件 | 337,400 | 8,269,674.00 | 4.94 |
| 8 | 300567 | 精测电子 | 121,039 | 8,248,807.85 | 4.92 |
| 9 | 002371 | 北方华创 | 172,100 | 8,099,026.00 | 4.83 |
| 10 | 603019 | 中科曙光 | 171,000 | 8,016,480.00 | 4.78 |

4、 报告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 | 3,145,762.00 | 1.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 3,145,762.00 | 1.88 |
| 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 | 3,145,762.00 | 1.88 |

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

| 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 | 018005 | 国开1701 | 31,270 | 3,145,762.00 | 1.88 |

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、 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。

9、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。

10、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。

11、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9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 | 54,474.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 58,841.82 |
| 5 | 应收申购款 | 6,824,261.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,937,578.25 |

（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**

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2018年9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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2009.06.24-2009.12.31 | 4.10% | 1.81% | 13.08% | 1.68% | -8.98% | 0.13% |
| 2010.01.01-2010.12.31 | 6.38% | 1.34% | -9.35% | 1.27% | 15.73% | 0.07% |
| 2011.01.01-2011.12.31 | -20.27% | 1.19% | -19.41% | 1.04% | -0.86% | 0.15% |
| 2012.01.01-2012.12.31 | 7.27% | 1.19% | 6.87% | 1.02% | 0.40% | 0.17% |
| 2013.01.01-2013.12.31 | -6.01% | 1.25% | -6.22% | 1.12% | 0.21% | 0.13% |
| 2014.01.01-2014.12.31 | 18.37% | 0.91% | 42.96% | 0.97% | -24.59% | -0.06% |
| 2015.01.01-2015.12.31 | 31.76% | 2.62% | 7.38% | 1.99% | 24.38% | 0.63% |
| 2016.01.01-2016.12.31 | -1.84% | 1.69% | -8.54% | 1.12% | 6.70% | 0.57% |
| 2017.01.01-2017.12.31 | -2.65% | 1.13% | 16.89% | 0.51% | -19.54% | 0.62% |
| 2018.01.01-2018.09.30 | -7.81% | 2.36% | -10.69% | 0.98% | 2.88% | 1.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.32% | 1.61% | 21.35% | 1.21% | 0.97% | 0.40% |

**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。

本基金合同终止、基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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。

上述一、基金费用的种类中第3－8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。

（四）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。

（五）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、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告并报中国证监会备案。

（六）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《中海量化策略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
二〇一九年二月二日

---

证券代码：600681　证券简称：百川能源　公告编号：2019-011

# 百川能源股份有限公司关于为全资子公司提供担保的公告

**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。**

重要内容提示：

●被担保人名称：百川燃气有限公司

●本次担保金额及已实际为其提供的担保余额：本次担保金额为10,000万元，截至本公告日，公司为百川燃气有限公司提供担保额度为146,500万元（含本次）

●本次担保是否有反担保：否

●对外担保逾期的累计数量：公司不存在逾期担保事项

一、担保情况概述

2019年1月31日，百川能源股份有限公司（以下简称“公司”）与中国民生银行股份有限公司石家庄分行（以下简称“民生银行石家庄分行”）签署《综合授信合同》，向民生银行石家庄分行申请额度为人民币10,000万元的综合授信，该额度用于公司全资子公司百川燃气有限公司（以下简称“百川燃气”）向民生银行石家庄分行申请流动资金借款。

同日，公司与民生银行石家庄分行签署《最高额保证合同》，公司为百川燃气借款提供连带责任保证，担保金额为人民币10,000万元。

上述担保事项已经公司第九届董事会第二十二次会议审议通过，并经公司2017年年度股东大会审议通过。

二、被担保人基本情况

1、企业名称：百川燃气有限公司

2、成立日期：2003年06月25日

3、注册资本：36,000万元

4、经营范围：管道燃气（天然气）、瓶装燃气（液化石油气）、燃气汽车加气站（天然气）；天然气用具的销售、安装及维修、维护。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

5、法定代表：王国风

6、住所：河北省廊坊市永清县武隆南路160号

7、财务状况（合并口径）：

单位：万元

| 项目 | 2018年9月30日 | 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 总资产 | 527,035.98 | 600,279.22 |
| 总负债 | 367,217.79 | 509,141.91 |
| 其中：银行贷款总额 | 67,250.00 | 29,625.00 |
| 流动负债总额 | 294,688.89 | 457,961.98 |
| 归属于母公司所有者权益 | 158,989.95 | 90,432.88 |
| 项目 | 2018年1-9月 | 2017年1-12月 |
| 营业收入 | 270,076.54 | 292,792.06 |
| 归属于母公司所有者净利润 | 67,828.01 | 90,268.42 |

三、担保协议主要内容

1、担保方式：连带责任保证

2、担保金额：10,000万元

3、担保范围：最高主债权本金及其他应付款项，包括利息、罚息、复利、违约金、损害赔偿金、实现债权和担保权利的费用（包括但不限于诉讼费、律师费、差旅费等）和所有其他应付合理费用。

4、担保期限：主合同项下任何一笔债务的履行期限届满日早于或同于被担保债权的确定日时，保证期间为被担保债权的确定日起两年；否则为该笔债务的履行期限届满日起两年。

四、董事会意见

公司董事会认为：公司为全资子公司提供担保，不会损害公司利益，也不存在损害公司及股东利益的情形，符合公司整体利益。百川燃气经营稳定，资信状况良好，各方面运作正常，担保风险总体可控。公司将持续关注企业经营状况，及时采取措施防范风险，有效控制担保风险。

五、累计对外担保数量及逾期担保的数量

截至本公告日，公司及控股子公司无对外担保；公司对控股子公司担保总额为179,