
中海优质成长证券投资基金 2007 年半年度报告

报 告 期：2007.01.01-2007.06.30

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2007 年 8 月 29 日

重要提示

本基金管理人的董事会及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。全体董事出席本次董事会，没有董事对半年度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

本基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于二〇〇七年八月十日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告期财务数据未经审计。

目 录

一、基金简介.....	4
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	5
三、基金管理人报告.....	6
四、基金托管人报告.....	9
五、基金财务会计报告（未经审计）.....	10
六、基金投资组合（2006年6月30日）.....	21
七、基金份额持有人户数、持有人结构.....	30
八、开放式基金份额变动.....	30
九、重大事件揭示.....	31
十、备查文件目录.....	33

一、基金简介

- (一) **基金名称：**中海优质成长证券投资基金
基金简称：中海成长
交易代码： 398001, 398002
基金运作方式： 契约型开放式
基金合同生效日： 2004 年 9 月 28 日
报告期末基金份额总额： 511,373,194.23 份
基金合同存续期： 不定期
- (二) **基金投资目标：** 本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
基金投资策略： 品质过滤、成长精选
业绩比较基准： 沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%
风险收益特征： 本基金是一只主动型的股票基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产的中长期稳定增值。
- (三) **基金管理人：** 中海基金管理有限公司
注册地址： 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层
办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层
邮政编码： 200120
法定代表人： 储晓明
信息披露负责人： 夏立峰
电话： 021-68419966
传真： 021-68419525
电子邮箱： xialf@zhfund.com
- (四) **基金托管人：** 交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
注册地址： 上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址： 上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码： 200120
法定代表人： 蒋超良
信息披露负责人： 张咏东
电话： 021-68888917
传真： 021-58408836
电子邮箱： zhangyd@bankcomm.com
- (五) **信息披露报纸名称：** 中国证券报、证券时报
登载半年度报告正文的管理人互联网网址： www.zhfund.com

基金半年度报告置备地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼

(六) 注册登记机构：中海基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 楼

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

基金本期净收益	218,935,239.52
基金份额本期净收益	0.6152
期末可供分配基金收益	328,517,789.04
期末可供分配基金份额收益	0.6424
期末基金资产净值	927,583,075.80
期末基金份额净值	1.8139
基金加权平均净值收益率	39.41%
本期基金份额净值增长率	77.78%
基金份额累计净值增长率	250.32%

注：以上财务指标中“本期”指 2007 年 1 月 1 日始至 2007 年 6 月 30 日止。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二) 基金净值表现

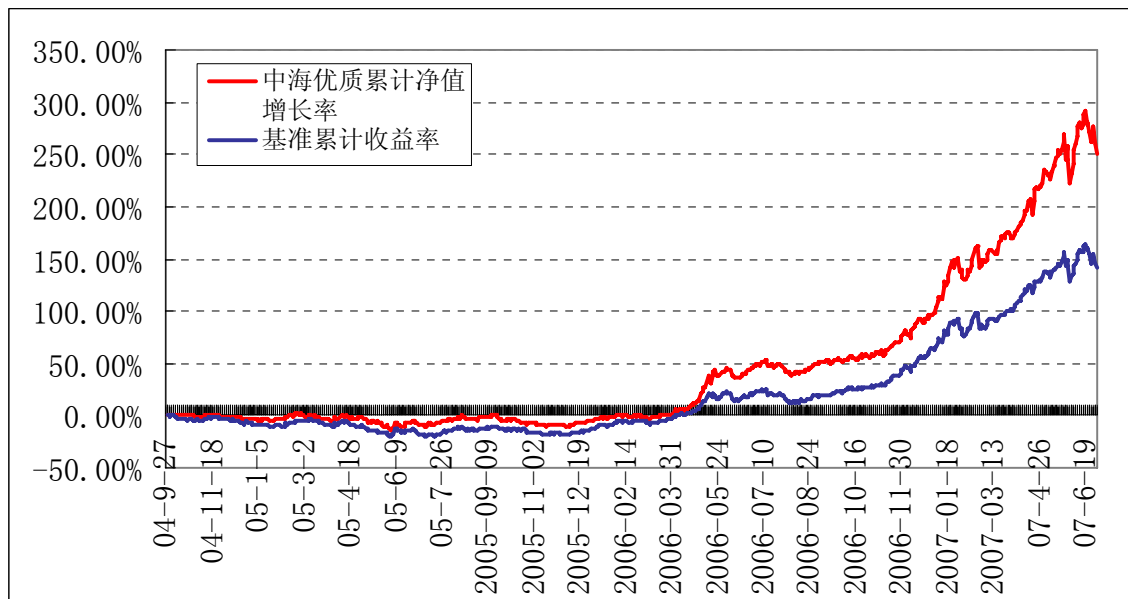
1、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
过去 1 个月	-2.11%	2.88%	-3.19%	2.29%	1.08%	0.59%
过去 3 个月	30.33%	2.38%	19.72%	1.85%	10.61%	0.53%
过去 6 个月	77.78%	2.27%	46.71%	1.85%	31.07%	0.42%
过去 1 年	137.88%	1.79%	96.41%	1.49%	41.47%	0.30%
基金合同 生效起至今	250.32%	1.37%	140.42%	1.22%	109.90%	0.15%

注：基金合同生效起至今指 2004 年 9 月 28 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日。

2、基金合同生效以来本基金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



注：鉴于《新华富时指数使用许可协议》期限届满终止，中海基金管理有限公司作为基金管理人，已于2007年6月1日将中海优质成长证券投资基金业绩比较基准由“新华富时A600成长指数*75%+新华富时中国国债指数*25%”变更为“沪深300指数*75%+上证国债指数*25%”。

(三) 基金合同生效以来每年基金收益分配情况

单位：人民币

年度	每10份基金份额分红数（至少保留三位小数）	备注
自2004年9月28日（基金合同生效日）至2004年12月31日止	0.000	
2005年度	0.000	
2006年度	8.100	
自2007年1月1日至2007年6月30日止	0.800	
合计	8.900	

三、基金管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

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，取得了优异业绩。截至 2007 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 3 只。

基金经理：彭焰宝先生，清华大学学士，经济师。1994 年 4 月至 1999 年 12 月历任国联证券有限责任公司上交所场内交易员、投资经理、投资部副总经理，负责国联证券有限责任公司投资业务。2000 年 1 月至 2003 年 12 月任国联资产管理有限公司投资部总经理，负责海外证券市场投资。现任中海基金管理有限公司投资管理部总经理。

（二）管理人合规情况说明

基金管理人在报告期内严格遵守《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。

（三）基金经理工作报告

07 年上半年在大量流动性的冲击下，A 股市场出现了快速上涨，题材、概念盛行，投机、投资理念各行其道，在不同的投资理念下，市场反复活跃，并推动整体市场不断上行，我们认为，在牛市氛围下，市场的盈利模式是多元化的，不同类型的投资人只能根据自身投资风格选择合适的盈利模式。

从 07 年上市公司的利润变动观察，在 1 季度整体上市公司盈利同比增长大幅度提升的基础上，从统计数据看，1—5 月份规模以上工业实现增长 42%，宏观经济基本面为上市公司业绩增长提供坚实基础，同时在制度性改革完成后，伴随着股权激励、资产注入等行为的发生更有助于上市公司释放业绩，我们判断，07 年中期上市公司盈利增长将再次超出市场预期，A 股市场在跨越 4000 点后，以沪深 300 为代表的蓝筹公司估值仍处于合理的范畴，市场并未出现系统性风险。

尽管目前市场基本面良好，但市场过高的估值仍将成为影响市场进一步上涨的阻力，这需要我们引起一定的注意。我们认为在中报披露阶段，市场仍存在创新高的能力，主要推动力来自于上市公司超预期的增长，相对低估的行业和公司会受到市场的关注；对估值较高的行业或公司投资人仍必须保持一定的警惕，毕竟高估值只有通过公司业绩的高增长才能予以化解。

中海优质成长基金 07 年上半年的投资仍坚持立足于以长期的思路、眼光来选择公司，长线布局仍维持在投资、出口、消费中增长最为显著和持续经营能力更强的行业，如金融、地产、商业、食品饮料、机械设备等；同时，把握相对低估值行业的趋势性投资机会，如钢铁、有色、交运等。

截至 6 月 3 0 日，本基金份额净值 1.8139 元（累计净值 2.7039 元）。报告期内本基金取得了 77.78%的净值增长。

四、基金托管人报告

2007年上半年，托管人在中海优质成长证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

2007年上半年，中海基金管理有限公司在中海优质成长证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

2007年上半年，由中海基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中海优质成长证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

交通银行股份有限公司

2007年8月10日

五、基金财务会计报告（未经审计）

（一）会计报表内容

1、资产负债表

资产负债表

单位：人民币元

资产	2007年6月30日	2006年12月31日	附注	负债与持有人权益	2007年6月30日	2006年12月31日	附注
资产：				负债：			
银行存款	35,490,685.59	40,757,251.34		应付证券清算款	0.00	40,431,020.39	
清算备付金	51,134,289.39	6,300,822.67		应付赎回款	1,798,172.43	69,032.96	
交易保证金	1,179,143.72	359,609.61		应付赎回费	6,819.29	255.37	
应收证券清算款	0.00			应付管理人报酬	1,064,680.91	214,398.19	
应收股利	0.00			应付托管费	177,446.79	35,733.04	
应收利息	43,049.59	83,408.65	1	应付佣金	2,264,763.66	557,412.33	3
应收申购款	1,516,323.23	3,322,092.59		应付利息	0.00		
其他应收款	0.00			应付收益	0.00		
股票投资市值	843,316,552.84	157,062,615.12	2	未交税金	0.00		
其中：股票投资成本	805,592,985.54	146,749,851.68		其他应付款	261,116.97	250,028.80	4
债券投资市值	624,797.20	6,625,752.40		卖出回购证券款	0.00		
其中：债券投资成本	629,692.50	6,626,314.50		短期借款	0.00		
权证投资市值	0.00	4,531,507.00		预提费用	148,765.71	300,000.00	5
其中：权证投资成本	0.00	3,977,733.87		其他费用	0.00		
配股权证	0.00	0.00		负债合计：	5,721,765.76	41,857,881.08	
买入返售证券	0.00	0.00		持有人权益：			
待摊费用	0.00	0.00		实收基金	511,373,194.23	161,068,732.94	6
				未实现利得	87,692,092.53	(2,541,365.19)	7
				未分配收益	328,517,789.04	18,657,810.55	
				持有人权益合计	927,583,075.80	177,185,178.30	
资产合计	933,304,841.56	219,043,059.38		负债及持有人权益总计	933,304,841.56	219,043,059.38	

注：所附附注为本会计报表的组成部分

2、经营业绩表

经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	本报告期	上年同期
一、收入		223,884,948.35	71,463,398.22
1、股票差价收入	8	218,112,567.42	68,630,788.82
2、债券差价收入	9	3,378.00	-124,465.58
3、权证差价收入	10	2,241,513.30	1,392,034.26
4、债券利息收入		60,437.82	166,805.73

5、存款利息收入		409,573.71	186,140.99
6、股利收入		2,287,051.35	827,354.43
7、买入返售证券收入		.00	79,648.00
8、其他收入	11	770,426.75	305,091.57
二、费用		4,949,708.83	1,917,371.77
1、基金管理人报酬		4,072,745.65	1,503,619.71
2、基金托管费		678,790.97	250,603.29
3、卖出回购证券支出		.00	3,104.93
4、利息支出		.00	0.00
5、其他费用	12	198,172.21	160,043.84
其中：上市年费		.00	0.00
信息披露费		139,177.14	99,177.14
审计费用		49,588.57	49,588.57
三、基金净收益		218,935,239.52	69,546,026.45
加：未实现利得		26,852,697.53	3,505,603.85
四、基金经营业绩		245,787,937.05	73,051,630.30

注：所附附注为本会计报表的组成部分

3、基金净值变动表

基金净值变动表

单位：人民币元

项目	本报告期	上年同期
一、期初基金净值	177,185,178.30	305,856,420.62
二、本期经营活动：		
基金净收益	218,935,239.52	69,546,026.45
未实现利得	26,852,697.53	3,505,603.85
经营活动产生的基金净值变动数	245,787,937.05	73,051,630.30
三、本期基金单位交易：		
基金申购款	1,143,538,311.15	89,883,514.64
基金赎回款	625,453,285.90	352,665,521.51
基金单位交易产生的基金净值变动数	518,085,025.21	-262,782,006.87
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	13,475,064.76	6,451,485.72
五、期末基金净值	927,583,075.80	109,674,558.33

注：所附附注为本会计报表的组成部分

4、基金收益分配表

基金收益分配表

单位：人民币元

项目	附注	本报告期	上年同期
本期基金净收益		218,935,239.52	69,546,026.45
加：期初基金净收益		18,657,810.55	-23,516,006.72
加：本期损益平准金		104,399,803.73	-11,406,539.90
可供分配基金净收益		341,992,853.80	34,623,479.83
减：本期已分配基金净收益	13	13,475,064.76	6,451,485.72
期末基金净收益		328,517,789.04	28,171,994.11

注：所附附注为本会计报表的组成部分

（二）会计报表附注

1、基金基本情况

中海优质成长证券投资基金(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基金字【2004】92号《关于同意中海优质成长证券投资基金设立的批复》核准募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为中海基金管理有限公司,基金托管人为交通银行;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2004年9月28日生效,该日的基金份额总额为1,017,619,728.79份。

2、会计政策:

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制,会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《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3号《半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编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有

关税收政策问题的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金本报告期按2%的税率缴纳股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局财税字[2005]11号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)印花税税率的通知》,自2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。自2005年6月13日起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。经国务院批准,财政部决定从2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由现行1%调整为3%。即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按3%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(b) 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不缴纳营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,基金管理人运用基金买卖股票、债券的价差收入暂免缴营业税。

(c) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,本基金自证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的价差收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(d) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金取得的股票的股息、红利收入及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局财税字[2005]102号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,对本基金自2005年6月13日起从上市公司取得的股息红利所得,暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税。

4、本报告期重大会计差错:

无

5、关联方关系及其交易

(1) 关联方关系

企业名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司	基金管理人、直销机构
交通银行	基金托管人、代销机构
中海信托投资有限责任公司	基金管理人股东
国联证券有限责任公司（“国联证券”）	基金管理股东、代销机构
云南烟草兴云投资股份有限公司（“兴云投资”）	基金管理人的股东

(2) 关联交易

a. 截至2007年6月30日基金各关联方投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	分红再投资	期末数	
	持有份数	持有比例				持有份数	持有比例
中海基金管理有限公司	12,695,365.88	7.88%	4,532,595.88	0	1,310,858.80	18,538,820.56	3.63%
中海信托	12,736,237.32	7.91%	0	0	969,087.87	13,705,325.19	2.68%

中海基金管理有限公司及中海信托在2006年上半年末均未持有本基金份额。

中海基金管理有限公司其他主要股东及其实际控制人在2006年上半年末及2007年上半年末均未持有本基金份额。

b. 通过关联方席位进行的交易：国联证券

2007年1月1日—2007年6月30日

单位：人民币元

股票成交金额	占股票总成交额	债券成交金额	占债券总成交额	权证成交金额	占权证总成交额	佣金	占佣金总额
1,697,872,083.06	37.63%	0.00	0.00%	5,416,731.84	15.71%	1,328,600.82	36.54%

2006年1月1日—2006年6月30日

单位：人民币元

股票成交金额	占股票总成交额	债券成交金额	占债券总成交额	权证成交金额	占权证总成交额	佣金	占佣金总额
337,529,042.25	28.30%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	265,719.46	27.68%

注：

上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1%—股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.11%）—股票买（卖）证管费（买卖成交金额*0.04%）—证券结算风险金（股票成交金额*0.03%+国债现货成交全价金额*0.01%+国债回购成交金额*0.01%）

深市交易佣金=股票买（卖）成交金额*1%—股票买（卖）经手费（买卖成交金额*0.1875%）—证券结算风险金（股票成交金额*0.03%+国债现货成交全价金额*0.01%+国债回购成交金额*0.01%）

（3） 基金管理人及托管人报酬

a 基金管理人报酬——基金管理费

- 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；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共4,072,745.65元，其中已支付基金管理人3,008,064.74元，尚余1,064,680.91元未支付。本基金上年同期应支付基金管理人管理费共1,503,619.71元。

b 基金托管人报酬——基金托管费

- 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；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币678,790.97元，其中已支付人民币501,344.18元，尚余人民币177,446.79元未支付。本基金上年同期应支付基金托管人托管费共计人民币250,603.29元。

(4) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金自2007年1月1日起至2007年6月30日止，未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为35,490,685.59元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为164,266.07元。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为7,719,007.19元。2006年1月1日至2006年6月30日期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为33,623.94元。

根据中国证券登记结算有限责任公司要求的证券投资基金结算模式，本基金需通过以基金托管人名义开立的“交通银行基金托管结算资金专用存款帐户”进行证券交易结算。于2007年6月30日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款帐户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额51,134,289.39元计入结算备付金科目。于2006年6月30日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款帐户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额4,930,667.74元计入结算备付金科目。

6、会计报表主要项目注释

(1) 应收利息

单位：人民币元

应收银行存款	11,445.12
应收清算备付金利息	18,626.30
应收权证交收价差保证金利息	41.04
应收债券利息	11,398.63
应收TA认申购款利息	1538.50
合计	43,049.59

(2) 投资估值增值

单位：人民币元

股票估值增值	37,723,567.30
债券估值增值	-4,895.30
合计	37,718,672.00

(3) 应付佣金

单位：人民币元

国联证券	820,333.34
东吴证券	406,746.71
银河证券	1,037,683.61
合计	2,264,763.66

(4) 其他应付款

单位：人民币元

应付中海基金垫付深交所保证金	250,000.00
应付后端申购费	3,916.97
应付上海股票税金	7,200.00
合计	261,116.97

(5) 预提费用

单位：人民币元

审计费	49,588.57
信息披露费	99,177.14
合计	148,765.71

(6) 实收基金

单位：人民币元

期初数	161,068,732.94
本期申购	756,291,732.61
本期赎回	405,987,271.32
期末数	511,373,194.23

(7) 未实现利得

单位：人民币元

期初未实现利得	-2,541,365.19
其中：	
投资估值增值数	10,865,974.47
未实现利得平准金	-13,407,339.66
期间变动数	90,233,457.72
其中：	
估值增值本期净变动数	26,852,697.53
未实现利得平准金本期申购变动数	149,963,706.97
未实现利得平准金本期赎回变动数	-86,582,946.78
期末未实现利得	87,692,092.53
其中：	
投资估值增值数	37,718,672.00
未实现利得平准金	49,973,420.53

(8) 股票差价收入

单位：人民币元

卖出股票成交总额	卖出股票成本总额	卖出股票应付佣金	股票差价收入
2,039,797,864.74	1,819,975,890.80	1,709,406.52	218,112,567.42

(9) 债券差价收入

单位：人民币元

卖出债券成交总额	卖出债券成本总额	应收利息总额	债券差价收入
6,115,440.00	5,996,622.00	115,440.00	3,378.00

(10) 权证差价收入

单位：人民币元

卖出权证成交总额	卖出权证成本总额	权证差价收入
19,293,290.85	17,051,777.55	2,241,513.30

(11) 其他收入

单位：人民币元

赎回及转出基金补偿收入 (a)	770,426.75
-----------------	------------

(a) 根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的25%归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

(12) 其他费用

单位：人民币元

银行费用	406.50
银行间帐户服务费	9,000.00
回购交易费用	0.00
审计费	49,588.57
信息披露费用	139,177.14
合计	198,172.21

(13) 收益分配

除息日	红利发放日	分红率	红利总金额(元)
2007-1-5	2007-1-8	每10份基金份额0.80元	13,475,064.76

7、报告期末流通转让受限制的基金资产

(1) 截至 2007 年 6 月 30 日基金持有的流通转让受限制的基金资产明细如下：

股票代码	股票名称	上市日期	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	流通受限原因
002126	银轮股份	2007-7-18	35,867	300,565.46	647,758.02	新股未上市
600439	瑞贝卡	从 2006 年 12 月 6 日起 12 个月	450,000	3,564,000.00	11,979,000.00	增发未上市
	合计		485,867	3,864,565.46	12,626,758.02	

(2) 估值方法

本基金所持有的流通转让受限制股票，按当日交易所上市的同一股票的市价估值。
本基金所持有的网下申购新股锁定期间按当日交易所上市的同一股票的市价估值；
本基金持有的非公开发行股票估值时分两种情况进行估值：

1、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

2、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times((Dt-Dr)/Dt)$$

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的首次取得成本；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；Dt为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

8、承诺事项

无需要说明的承诺事项。

9、期后事项

无需要说明的期后事项。

10、其他重要事项

无需要说明的其他重要事项。

六、基金投资组合（2007年6月30日）

本基金托管人——交通银行已于2007年8月10日复核了本报告。截至2007年6月30日，中海优质成长证券投资基金资产净值为927,583,075.80元，基金份额净值为1.8139元，累计基金份额净值为2.7039元，基金份额为511,373,194.23份。

1、报告期末基金资产组合情况

资产项目	市值 (人民币元)	占基金资产总值比例(%)
股票	843,316,552.84	90.36
债券	624,797.20	0.07
权证	0.00	0.00
银行存款及清算备付金	86,624,974.98	9.28
其他资产	2,738,516.54	0.29
合计	933,304,841.56	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合：

序号	证券板块名称	市值(人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00
2	B 采掘业	40,349,209.60	4.35
3	C 制造业	485,600,254.03	52.35
	C0 食品、饮料	53,411,820.28	5.76
	C1 纺织、服装、皮毛	11,979,000.00	1.29
	C2 木材、家具	21,804,127.80	2.35
	C3 造纸、印刷	32,060,680.33	3.46
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	103,745,049.10	11.18
	C5 电子	0.00	0.00
	C6 金属、非金属	73,623,718.24	7.94
	C7 机械、设备、仪表	114,644,445.30	12.36
	C8 医药、生物制品	18,023,145.50	1.94
	C9 其他制造业	56,308,267.48	6.07
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
5	E 建筑业	0.00	0.00
6	F 交通运输、仓储业	45,829,500.00	4.94
7	G 信息技术业	21,867,149.56	2.36
8	H 批发和零售贸易	42,543,889.61	4.59
9	I 金融、保险业	103,717,016.80	11.18
10	J 房地产业	83,611,469.24	9.01
11	K 社会服务业	19,798,064.00	2.13
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00
13	M 综合类	0.00	0.00
	合计	843,316,552.84	90.92

3、 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细：

序号	股票代码	股票名称	库存数量 (股)	期末市值 (人民币元)	市值占基金资产 净值比例 (%)
1	600426	华鲁恒升	1,913,180	43,295,263.40	4.67
2	002120	新海股份	1,639,847	34,174,411.48	3.68
3	600031	三一重工	762,102	33,707,771.46	3.63
4	000528	柳 工	1,349,978	33,074,461.00	3.57
5	000792	盐湖钾肥	717,325	31,834,883.50	3.43
6	601166	兴业银行	900,000	31,581,000.00	3.40
7	000039	中集集团	1,029,957	30,198,339.24	3.26
8	600036	招商银行	1,199,960	29,495,016.80	3.18
9	600026	中海发展	1,250,000	28,725,000.00	3.10
10	000878	云南铜业	819,982	28,289,379.00	3.05
11	600348	国阳新能	707,760	26,158,809.60	2.82
12	000006	深振业A	992,497	24,713,175.30	2.66
13	000858	五 粮 液	699,918	22,019,420.28	2.37
14	000836	鑫茂科技	1,112,266	21,867,149.56	2.36
15	600978	宜华木业	699,972	21,804,127.80	2.35
16	601318	中国平安	300,000	21,453,000.00	2.31
17	600030	中信证券	400,000	21,188,000.00	2.28
18	002116	中国海诚	899,912	19,798,064.00	2.13
19	600104	上海汽车	1,100,000	18,997,000.00	2.05
20	600616	第一食品	738,123	18,541,649.76	2.00
21	600308	华泰股份	749,987	18,442,180.33	1.99
22	000002	万 科A	949,912	18,162,317.44	1.96
23	000568	泸州老窖	420,000	17,682,000.00	1.91
24	600206	有研硅股	489,600	17,189,856.00	1.85
25	600383	金地集团	500,000	17,110,000.00	1.84
26	600009	上海机场	450,000	17,104,500.00	1.84
27	000401	冀东水泥	1,100,000	15,136,000.00	1.63
28	600331	宏达股份	307,676	14,906,902.20	1.61
29	600583	海油工程	392,000	14,190,400.00	1.53
30	600887	伊利股份	440,000	13,710,400.00	1.48
31	000609	绵世股份	745,000	13,708,000.00	1.48
32	000910	大亚科技	1,050,000	13,618,500.00	1.47
33	000402	金 融 街	466,900	13,540,100.00	1.46
34	000061	农 产 品	600,000	13,140,000.00	1.42
35	600439	瑞贝卡	450,000	11,979,000.00	1.29
36	600679	金山开发	900,411	11,795,384.10	1.27
37	000623	吉林敖东	231,018	11,493,145.50	1.24
38	000159	国际实业	838,783	10,862,239.85	1.17
39	000024	招商地产	205,415	10,085,876.50	1.09
40	000418	小天鹅A	800,004	8,144,040.72	0.88
41	000625	长安汽车	450,000	7,416,000.00	0.80
42	000423	东阿阿胶	250,000	6,530,000.00	0.70
43	600210	紫江企业	800,000	4,944,000.00	0.53
44	000651	格力电器	24,700	862,030.00	0.09
45	002126	银轮股份	35,867	647,758.02	0.07

4、 报告期内股票投资组合的重大变动

(1) 报告期内累计买入、卖出股票金额占期初基金资产净值比例超出 2% 的股票明细

累计买入金额占期初基金资产净值比例超过 2% 的股票明细				
序号	股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比 (%)
1	600426	华鲁恒升	86,420,384.24	48.77
2	600036	招商银行	80,112,304.91	45.21
3	600000	浦发银行	77,393,423.91	43.68
4	000002	万科 A	63,963,743.84	36.10
5	000612	焦作万方	44,925,758.16	25.36
6	002120	新海股份	44,039,040.94	24.85
7	600978	宜华木业	42,881,444.89	24.20
8	000401	冀东水泥	41,448,638.01	23.39
9	600616	第一食品	41,076,522.89	23.18
10	600348	国阳新能	39,190,832.22	22.12
11	601166	兴业银行	37,819,897.74	21.34
12	002116	中国海诚	36,842,157.26	20.79
13	000528	柳工	35,729,824.55	20.17
14	000039	中集集团	35,687,361.71	20.14
15	600887	伊利股份	34,818,512.12	19.65
16	000402	金融街	33,778,279.39	19.06
17	600230	沧州大化	32,348,287.10	18.26
18	000878	云南铜业	30,994,674.88	17.49
19	600031	三一重工	30,865,229.35	17.42
20	000792	盐湖钾肥	30,062,722.05	16.97
21	000623	吉林敖东	30,006,835.05	16.94
22	600104	上海汽车	29,791,999.20	16.81
23	600026	中海发展	29,575,865.68	16.69
24	600122	宏图高科	29,504,500.75	16.65
25	600690	青岛海尔	28,877,428.14	16.30
26	600331	宏达股份	27,732,493.26	15.65
27	000858	五粮液	26,713,040.11	15.08
28	600361	华联综超	26,661,498.62	15.05
29	000726	鲁泰 A	26,084,080.83	14.72
30	600009	上海机场	25,666,253.83	14.49
31	600263	路桥建设	25,631,469.81	14.47
32	600309	烟台万华	25,452,607.99	14.36
33	000828	东莞控股	25,311,034.36	14.29
34	000006	深振业 A	24,833,615.35	14.02
35	601318	中国平安	24,588,993.06	13.88
36	600825	新华传媒	23,963,238.25	13.52
37	600028	中国石化	23,186,406.08	13.09

38	000501	鄂武商 A	23,040,998.12	13.00
39	600055	万东医疗	22,677,712.45	12.80
40	600383	金地集团	22,027,283.00	12.43
41	000836	鑫茂科技	22,010,881.13	12.42
42	600590	泰豪科技	21,892,787.16	12.36
43	000597	东北制药	21,641,483.23	12.21
44	600638	新黄浦	20,945,709.71	11.82
45	000999	S 三 九	20,698,777.34	11.68
46	601006	大秦铁路	20,363,602.38	11.49
47	000910	大亚科技	19,828,740.87	11.19
48	600011	华能国际	19,740,637.75	11.14
49	000061	农 产 品	19,215,370.24	10.84
50	600635	大众公用	18,467,824.88	10.42
51	600308	华泰股份	17,708,839.06	9.99
52	600343	航天动力	17,614,574.59	9.94
53	000952	广济药业	17,462,770.30	9.86
54	600210	紫江企业	17,331,816.92	9.78
55	000584	舒卡股份	17,059,028.42	9.63
56	600240	华业地产	16,931,362.91	9.56
57	600835	上海机电	16,831,705.58	9.50
58	600266	北京城建	16,424,856.35	9.27
59	000001	深发展 A	16,163,114.52	9.12
60	600555	九龙山	16,068,258.06	9.07
61	600030	中信证券	15,694,265.95	8.86
62	600280	南京中商	15,652,404.28	8.83
63	000598	蓝星清洗	15,296,739.72	8.63
64	600583	海油工程	15,232,451.47	8.60
65	000562	宏源证券	15,159,410.43	8.56
66	600085	同仁堂	14,734,060.35	8.32
67	000831	关铝股份	14,718,864.53	8.31
68	000900	现代投资	14,689,387.50	8.29
69	600363	联创光电	14,550,970.19	8.21
70	002073	青岛软控	14,471,383.82	8.17
71	600378	天科股份	14,350,004.34	8.10
72	000609	绵世股份	13,799,091.67	7.79
73	600216	浙江医药	13,750,273.13	7.76
74	000568	泸州老窖	13,585,043.26	7.67
75	600679	金山开发	13,425,298.56	7.58
76	000755	山西三维	13,289,859.17	7.50
77	601628	中国人寿	13,125,580.48	7.41
78	000422	湖北宜化	12,500,977.48	7.06

79	600832	东方明珠	11,779,713.14	6.65
80	000822	山东海化	11,729,905.65	6.62
81	600517	置信电气	11,641,879.76	6.57
82	000823	超声电子	11,442,684.77	6.46
83	000159	国际实业	11,409,802.11	6.44
84	000651	格力电器	11,061,795.79	6.24
85	600549	厦门钨业	10,895,360.86	6.15
86	600206	有研硅股	10,318,530.56	5.82
87	600362	江西铜业	9,866,194.71	5.57
88	600016	民生银行	9,716,281.05	5.48
89	600050	中国联通	9,660,280.00	5.45
90	600300	维维股份	9,266,722.85	5.23
91	000541	佛山照明	9,102,050.99	5.14
92	000839	中信国安	8,963,033.96	5.06
93	600197	伊力特	8,692,132.67	4.91
94	600627	上电股份	8,657,681.67	4.89
95	000400	许继电气	8,457,284.66	4.77
96	000625	长安汽车	8,323,748.71	4.70
97	600365	通葡股份	8,293,157.43	4.68
98	000418	小天鹅A	8,233,789.91	4.65
99	600177	雅戈尔	8,031,335.46	4.53
100	600798	宁波海运	7,997,532.33	4.51
101	600015	华夏银行	7,927,489.76	4.47
102	600600	青岛啤酒	7,817,201.72	4.41
103	600269	赣粤高速	7,748,998.14	4.37
104	600535	天士力	7,655,807.99	4.32
105	000423	东阿阿胶	7,469,175.41	4.22
106	601699	潞安环能	7,452,163.79	4.21
107	600713	南京医药	7,333,925.64	4.14
108	600511	国药股份	7,295,806.29	4.12
109	600585	海螺水泥	7,270,451.76	4.10
110	600037	歌华有线	7,196,647.42	4.06
111	600858	银座股份	6,723,362.82	3.79
112	000063	中兴通讯	6,490,836.40	3.66
113	000024	招商地产	6,434,318.21	3.63
114	000522	白云山A	6,428,383.52	3.63
115	000717	韶钢松山	5,985,697.25	3.38
116	600823	世茂股份	5,980,423.33	3.38
117	600685	广船国际	5,898,013.96	3.33
118	600066	宇通客车	5,859,093.35	3.31
119	600849	上海医药	5,730,213.45	3.23

120	600162	香江控股	5,712,068.86	3.22
121	002007	华兰生物	5,505,093.27	3.11
122	600578	京能热电	5,501,664.23	3.11
123	002082	栋梁新材	5,322,245.58	3.00
124	600754	锦江股份	5,099,526.23	2.88
125	600519	贵州茅台	4,801,437.66	2.71
126	600418	江淮汽车	4,705,538.77	2.66
127	600785	新华百货	4,549,376.53	2.57
128	600005	武钢股份	4,536,328.30	2.56
129	600720	祁连山	4,047,057.14	2.28
130	600824	益民百货	4,041,036.95	2.28
131	600584	长电科技	3,893,841.07	2.20
132	600320	振华港机	3,836,222.90	2.17
133	600900	长江电力	3,815,825.15	2.15
134	000657	中钨高新	3,552,419.24	2.00
累计卖出金额占期初基金资产净值比例超过2%的股票明细				
	股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比(%)
1	600000	浦发银行	81,113,901.67	45.78
2	000612	焦作万方	57,583,271.23	32.50
3	600036	招商银行	55,768,015.17	31.47
4	600426	华鲁恒升	51,312,234.65	28.96
5	600230	沧州大化	51,089,175.39	28.83
6	000002	万科A	50,056,019.59	28.25
7	000999	S 三 九	45,810,727.51	25.85
8	600309	烟台万华	35,147,420.96	19.84
9	000623	吉林敖东	31,204,121.13	17.61
10	000828	东莞控股	30,724,055.38	17.34
11	600263	路桥建设	30,469,849.18	17.20
12	600690	青岛海尔	30,100,128.06	16.99
13	600887	伊利股份	29,716,005.12	16.77
14	600361	华联综超	29,109,092.25	16.43
15	000401	冀东水泥	28,206,185.92	15.92
16	000402	金融街	28,203,776.50	15.92
17	600011	华能国际	27,859,307.25	15.72
18	600978	宜华木业	27,567,441.76	15.56
19	600028	中国石化	27,080,360.21	15.28
20	000597	东北制药	26,992,910.00	15.23
21	600122	宏图高科	26,531,903.14	14.97
22	600825	新华传媒	25,860,993.09	14.60
23	601006	大秦铁路	25,483,873.48	14.38
24	000726	鲁 泰 A	24,621,737.86	13.90
25	600835	上海机电	24,592,997.35	13.88
26	002116	中国海诚	24,303,322.63	13.72

27	600590	泰豪科技	23,338,297.18	13.17
28	600055	万东医疗	22,004,446.01	12.42
29	000501	鄂武商A	21,889,623.36	12.35
30	600343	航天动力	21,750,295.77	12.28
31	600240	华业地产	21,130,014.04	11.93
32	600280	南京中商	20,922,113.42	11.81
33	600638	新黄浦	20,580,539.77	11.62
34	000584	舒卡股份	19,935,114.99	11.25
35	600266	北京城建	19,349,459.06	10.92
36	600555	九龙山	18,298,890.31	10.33
37	000001	深发展A	18,250,270.47	10.30
38	000952	广济药业	18,205,731.55	10.27
39	000900	现代投资	18,134,230.28	10.23
40	600616	第一食品	18,063,281.55	10.19
41	600635	大众公用	17,701,989.45	9.99
42	600016	民生银行	15,940,612.35	9.00
43	000651	格力电器	15,755,498.07	8.89
44	600363	联创光电	15,621,380.84	8.82
45	600348	国阳新能	15,287,261.29	8.63
46	600378	天科股份	15,091,859.41	8.52
47	000562	宏源证券	14,856,777.66	8.38
48	601628	中国人寿	14,831,995.85	8.37
49	002073	青岛软控	14,602,853.15	8.24
50	000598	蓝星清洗	14,210,977.92	8.02
51	000755	山西三维	14,166,588.17	8.00
52	600085	同仁堂	14,152,126.10	7.99
53	000839	中信国安	13,508,517.12	7.62
54	600331	宏达股份	13,227,109.61	7.47
55	000822	山东海化	13,051,969.14	7.37
56	000063	中兴通讯	12,995,219.52	7.33
57	000858	五粮液	12,887,628.40	7.27
58	600216	浙江医药	12,777,977.59	7.21
59	600832	东方明珠	12,741,435.88	7.19
60	600517	置信电气	12,476,070.07	7.04
61	000823	超声电子	12,076,012.98	6.82
62	601398	工商银行	11,990,053.45	6.77
63	600320	振华港机	11,810,024.25	6.67
64	600009	上海机场	11,777,738.05	6.65
65	000978	桂林旅游	11,387,524.90	6.43
66	000831	关铝股份	11,151,886.37	6.29
67	600300	维维股份	10,877,625.70	6.14
68	600005	武钢股份	10,594,276.66	5.98
69	600823	世茂股份	10,236,337.47	5.78
70	000541	佛山照明	10,061,122.43	5.68

71	000422	湖北宜化	9,976,390.39	5.63
72	601166	兴业银行	9,720,415.90	5.49
73	000878	云南铜业	9,712,612.16	5.48
74	600365	通葡股份	9,647,100.26	5.44
75	000039	中集集团	9,602,955.21	5.42
76	600104	上海汽车	9,459,223.57	5.34
77	601699	潞安环能	9,440,976.33	5.33
78	600362	江西铜业	9,425,095.20	5.32
79	600798	宁波海运	9,385,770.17	5.30
80	600549	厦门钨业	9,191,194.14	5.19
81	601318	中国平安	9,112,270.74	5.14
82	600015	华夏银行	9,050,856.72	5.11
83	600050	中国联通	9,011,271.82	5.09
84	600177	雅戈尔	8,984,124.91	5.07
85	600197	伊力特	8,815,172.08	4.98
86	600858	银座股份	8,571,967.57	4.84
87	002120	新海股份	8,341,309.90	4.71
88	600713	南京医药	8,121,068.97	4.58
89	600030	中信证券	8,030,318.44	4.53
90	600596	新安股份	8,017,884.15	4.53
91	600600	青岛啤酒	7,998,832.39	4.51
92	600210	紫江企业	7,991,751.26	4.51
93	600627	上电股份	7,985,993.53	4.51
94	600535	天士力	7,983,893.89	4.51
95	600269	赣粤高速	7,970,317.38	4.50
96	000400	许继电气	7,875,722.61	4.44
97	600585	海螺水泥	7,437,559.12	4.20
98	000061	农产品	7,287,761.26	4.11
99	600578	京能热电	6,981,303.57	3.94
100	000522	白云山A	6,922,064.99	3.91
101	600849	上海医药	6,793,917.55	3.83
102	600511	国药股份	6,778,987.26	3.83
103	600162	香江控股	6,530,545.79	3.69
104	600066	宇通客车	6,391,216.81	3.61
105	600037	歌华有线	6,320,306.63	3.57
106	000717	韶钢松山	6,273,682.42	3.54
107	000852	江钻股份	5,646,023.04	3.19
108	002082	栋梁新材	5,546,291.20	3.13
109	002007	华兰生物	5,443,528.13	3.07
110	600754	锦江股份	5,306,974.48	3.00
111	600685	广船国际	5,060,159.40	2.86
112	600519	贵州茅台	4,830,969.61	2.73
113	600824	益民百货	4,720,951.03	2.66
114	600867	通化东宝	4,697,900.49	2.65

115	600900	长江电力	4,566,182.65	2.58
116	000910	大亚科技	4,521,096.90	2.55
117	000792	盐湖钾肥	4,509,940.93	2.55
118	600802	福建水泥	4,469,252.31	2.52
119	600219	南山铝业	4,380,813.94	2.47
120	600026	中海发展	4,195,689.67	2.37
121	600033	福建高速	4,194,586.00	2.37
122	600418	江淮汽车	4,150,837.61	2.34
123	600785	新华百货	4,127,785.41	2.33
124	600720	祁连山	3,931,541.58	2.22
125	000657	中钨高新	3,889,654.20	2.20
126	600639	浦东金桥	3,825,257.98	2.16
127	000836	鑫茂科技	3,735,758.03	2.11
128	000625	长安汽车	3,679,014.14	2.08
129	600584	长电科技	3,658,340.34	2.06
130	600019	宝钢股份	3,606,158.81	2.04

(2) 报告期内买入股票成本总额及卖出股票收入总额

买入股票成本总额（人民币元）	卖出股票收入总额（人民币元）
2,478,819,024.66	2,039,797,864.74

5、 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	券种	市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	国债	624,797.20	0.07
	合计	624,797.20	0.07

6、 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	国债 0214	624,797.20	0.07
2	—	—	—
3	—	—	—
4	—	—	—
5	—	—	—

7、 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 2007 年 6 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

其他资产项目	金额（元）
交易保证金	1,077,861.67
权证价差交收保证金	101,282.05

应收证券清算款	0.00
应收利息	43,049.59
应收申购款	1,516,323.23
合计	2,738,516.54

4、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转债。

5、报告期内，本基金持有权证数量和成本列示如下：

权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
580003	邯钢 JTB1	630,000	1,594,938.43	主动持有
580005	万华 HXB1	199,517	6,813,593.89	主动持有
580007	长电 CWB1	847,000	5,568,070.73	主动持有
030002	五粮 YGC1	72,000	1,201,080.10	主动持有

6、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有权证投资。

7、截至 2007 年 6 月 30 日，中海基金管理有限公司持有本基金的份额如下：

	基金份额（份）
2007 年 6 月 30 日	18,538,820.56

七、基金份额持有人户数、持有人结构

基金份额持有人户数	户均持有份额（万份）	基金持有人份额结构			
		机构		个人	
		持有份额（万份）	持有比例（%）	持有份额（万份）	持有比例（%）
12,408	4.1213	25,070.09	49.03	26,067.23	50.97

经本基金管理人统计，截止2007年6月30日，本公司员工持有本基金情况如下：

基金名称	本公司员工持有该只基金总份额	占该只基金份额比例
中海优质成长证券投资基金	31867.56	0.0064%

八、开放式基金份额变动

项目	份额（份）
基金合同生效日基金份额总额	1,017,619,728.79
本报告期内基金份额变动情况：	
期初基金份额总额	161,068,732.94
加：本期总申购份额	756,291,732.61
减：本期总赎回份额	405,987,271.32
期末基金份额总额	511,373,194.23

九、重大事件揭示

- 1、本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼、仲裁等；
- 2、本报告期内本基金管理人、托管机构及高级管理人员未受监管部门稽查或处罚；
- 3、本报告期内基金管理人董事长发生变动，聘任储晓明先生为公司董事长；
- 4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动；
- 5、本报告期内本基金的投资策略未有重大变化；
- 6、本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.80 元（暂免征收所得税），派发红利金额共计 13,475,064.76 元；
- 7、本基金租用席位由公司投资研究部门定期对券商的研究报告和相关服务质量进行综合评价，然后确定席位的租用。本基金租用证券公司专用交易席位情况如下：

2006 年 1 月 1 日——2006 年 6 月 30 日

券商名称	席位数量	股票成交金额 (元)	比例 (%)	债券成交金额 (元)	比例 (%)	回购成交金额 (元)	比例 (%)
国联证券	2	337,529,042.25	28.30	—	—	—	—
东吴证券	1	287,865,850.65	24.14	2,798,040.00	10.77	7,000,000.00	1.06
东方证券	1	256,766,439.90	21.53	3,249,772.00	12.51	487,200,000.00	73.57
申银万国	1	194,417,481.92	16.30	14,947,013.00	57.53	168,000,000.00	25.37
银河证券	1	115,983,962.39	9.73	4,986,177.70	19.19	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—	—
合计	7	1,192,562,777.11	100.00	25,981,002.70	100.00	662,200,000.00	100.00

券商名称	席位数量	权证成交金额 (元)	比例 (%)	佣金(元)	比例 (%)
国联证券	2	—	—	265,719.46	27.68
东吴证券	1	—	—	235,949.77	24.58
东方证券	1	—	—	205,675.55	21.42
申银万国	1	3,704,596.91	100.00	157,592.78	16.42
银河证券	1	—	—	95,056.43	9.90
国元证券	1	—	—	—	—
合计	7	3,704,596.91	100.00	959,993.99	100.00

2007年1月1日——2007年6月30日

券商名称	席位数量	股票成交金额 (元)	比例 (%)	债券成交金额 (元)	比例 (%)	回购成交金额 (元)	比例 (%)
国联证券	2	1,697,872,083.06	37.63	—	—	—	—
东吴证券	1	496,034,036.27	10.99	—	—	—	—
申银万国	1	731,029,633.51	16.20	—	—	—	—
银河证券	1	1,586,708,786.82	35.17	—	—	—	—
合计	5	4,511,644,539.66	100.00	—	—	—	—

券商名称	席位数量	权证成交金额(元)	比例(%)	佣金(元)	比例(%)
国联证券	2	5,416,731.84	15.71	1,328,600.82	36.54
东吴证券	1	4,375,903.72	12.70	406,746.71	11.19
申银万国	1	18,507,539.43	53.69	599,440.85	16.49
银河证券	1	6,171,186.12	17.90	1,301,090.55	35.78
合计	5	34,471,361.11	100.00	3,635,878.93	100.00

注：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。

8、报告期基金披露过的其他重要事项：

公告事项	信息披露报纸	披露日期
中海优质成长证券投资基金 2006 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报	2007-1-19
关于中海旗下基金参与中信建投证券开放式基金网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-2-2

中海基金管理有限公司增加天相投资顾问有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-2-12
中海基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-20
中海基金管理有限公司关于变更法定代表人的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-3-24
中海优质成长证券投资基金 2006 年年度报告	中国证券报、证券时报	2007-3-30
中海优质成长证券投资基金 2007 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报	2007-4-19
关于中海基金管理有限公司旗下基金参与广发证券基金网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-4-23
中海优质成长证券投资基金更新招募说明书（2007 年第 1 号）	中国证券报、证券时报	2007-5-11
中海基金管理有限公司关于修改旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007-5-18
中海基金管理有限公司关于变更中海优质成长证券投资基金业绩比较基准的公告	中国证券报、证券时报	2007-5-25

十、备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立中海优质成长证券投资基金的文件
- 2、中海优质成长证券投资基金基金合同
- 3、中海优质成长证券投资基金托管协议
- 4、中海优质成长证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

查阅地点：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 34 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司
二〇〇七年八月二十九日