中海优质成长证券投资基金 2008年半年度报告摘要

一、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，于二〇〇八年八月二十二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。

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。

二、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：7，688，361，756.59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：021－38429808

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、上海证券报、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

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

本期利润	－2，443，507，248.38
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	－1，488，697，826.68
加权平均份额本期利润	－0.3129
期末可供分配利润	1，658，933，921.29
期末可供分配份额利润	0.2158
期末基金资产净值	4，813，713，824.49
期末基金份额净值	0.6261
加权平均净值利润率	－39.60％
本期基金份额净值增长率	－33.38％
基金份额累计净值增长率	200.99％

注：以上财务指标中“本期”指2008年1月1日始至2008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。

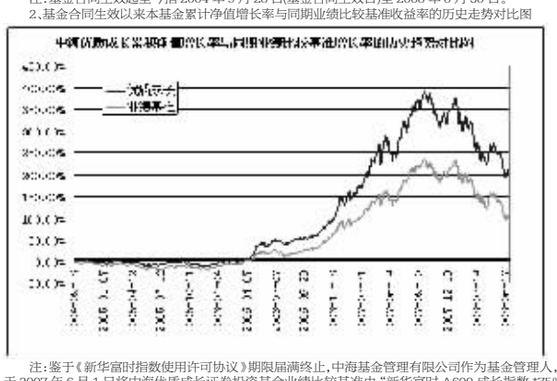
(二) 基金净值表现

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	－13.53%	2.20%	－17.37%	2.56%	3.84%	－0.36%
过去3个月	－15.40%	2.16%	－19.93%	2.49%	4.53%	－0.33%
过去6个月	－33.38%	2.16%	－37.45%	2.33%	4.07%	－0.17%
过去1年	－14.08%	1.99%	－18.06%	1.99%	3.98%	0.00%
过去3年	226.02%	1.68%	133.87%	1.55%	92.15%	0.13%
基金合同生效起至今	200.99%	1.56%	97.01%	1.47%	103.98%	0.09%

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2008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%”。

四、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2008年6月30日，共管理开放式证券投资基金4只。

基金经理：朱晓明先生，硕士，毕业于上海交通大学管理学院，9年证券从业经历。历任上海上实资产经营有限公司资产管理部投资经理、高级投资经理，上实集团下属盛通投资管理顾问有限公司副总经理、董事副总经理。2006年7月起进入本公司工作，现任投研中心副总经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理。2008年1月10日起任本基金基金经理。

李涛先生，本科，10年证券从业经历。历任西南证券投资银行部总经理助理，国泰君安证券股份有限公司资产管理部交易经理、基金经理助理、基金经理，新时代证券有限公司资产管理总部总经理。2005年3月进入本公司工作，2005年6月16日至2007年7月9日担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2007年7月10日起任本基金基金经理。

（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

08年上半年，沪深A股市场基本是走出了单边下跌的走势，在美国次贷危机的触发下，全球经济陷入了衰退的恐慌；同时石油价格的一路上扬，又推动了各国通货膨胀的预期。而相应的国内经济情况也不容乐观，上半年CPI一路攀升居高不下，而企业盈利增速也在宏观调控的政策影响下迅速下滑。在利润预测下调、估值缩水两大阴影的笼罩下，沪深300指数从年初的5262点一路下跌到08年6月30日收盘的2736点，调整幅度高达48%。本基金在上半年较好的回避了金融地产等行业的快速下跌浪潮，主要的配置重点放在了能源相关领域和农业主题投资上，仓位从2月份开始基本保持在行业较低水平，因此从半年业绩来看，在同类基金中排名较为靠前。我们预计08年下半年A股市场仍然将保持疲弱的走势，在经济金融形势明朗以前不会有系统性的机会出现，我们将主要的投资重点放在成长性好，前景确定的行业及品种上，努力在下跌过程中以合理的价格投资于优质成长股，为投资者提供更好的投资回报。

截至2008年6月30日，本基金份额净值0.6261元（累计净值2.4484元）。报告期内本基金净值增长率为－33.38%，超越业绩比较基准4.07个百分点。

（四） 公平交易执行情况

1、 公平交易制度的执行情况

为进一步完善公平交易管理，防范和杜绝不规范交易行为，保护基金份额持有人的合法权益，公司建立了有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

公司通过制定《中海基金研究部研究报告质量考评制度》，树立了研究导向的投资文化，强调投资应以研究作为依据，不断建立完善系统、科学的研究方法和流程，并认真地推行实施。

对于场内交易，公司制定了《中海基金管理有限公司交易管理制度》，所有的投资指令必须通过集中交易室下达，集中交易室与投资部门相隔离，规定多基金指令处理原则是：时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡，通过公司已有交易软件进行控制，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，同时禁止多基金之间的同日反向交易。对于场外交易，通过《固定收益证券投资管理办法》、《新股询价网下申购流程》以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对交易行为进行规范。

本报告期，本基金运作合法合规，不同投资组合的交易得到公平对待，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易，无损害基金份额持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

2、 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无

3、 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

五、托管人报告

2008年上半年度，基金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持有人利益的行为。

2008年上半年度，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持有人利益的行为。

2008年上半年度，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、财务会计报告相关内容、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

2008年8月22日

六、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

单位：人民币元

资产	2008年06月30日	2007年12月31日	附注	负债与持有人权益	2008年06月30日	2007年12月31日	附注
资产：				负债：			
银行存款	1，065，398，599.58	78，464，888.94		短期借款		－	
结算备付金	78，949，340.32	382，994，840.21		交易性金融负债		－	
交易保证金	7，996，002.56	2，883，248.10		衍生金融负债		－	
交易性金融资产	3，493，298，066.09	6，808，124，608.47		卖出回购金融资产款		－	
其中：股票投资	3，230，758，012.09	6，292，382，315.57	(1)	应付证券清算款		19，703，516.84	
债券投资	262，540，054.00	515，742，292.90	(1)	应付赎回款	406，962.83	6，531，130.93	
资产支持证券投资		－		应付管理人报酬	6，158，470.15	9，346，912.40	
基金投资		－		应付托管费	1，026，411.70	1，557，818.74	
衍生金融资产	5，698，677.60	－	(2)	应付销售服务费		－	
买入返售金融资产		500，000，870.00		应付交易费用	7，071，933.71	9，351，492.26	(4)
应收证券清算款	171，800，966.47	－		应付税费		－	
应收利息	3，349，045.25	4，107，337.81	(3)	应付利息		－	
应收股利	362，880.00	－		应付利润		－	
应收申购款	2，356，502.65	34，167.92		其他负债	832，477.64	633，340.50	(5)
其他资产		－		负债合计	15，496，256.03	47，124，211.67	
				所有者权益：			
				实收基金	3，088，790，254.01	3，304，293，132.61	(6)
				未分配利润	1，724，923，570.48	4，425，192，617.17	
				所有者权益合计	4，813，713，824.49	7，729，485，749.78	
资产合计	4，829，210，080.52	7，776，609，961.45		负债及所有人权益总计	4，829，210，080.52	7，776，609，961.45	

注：所附附注为本会计报表的组成部分

(二) 利润表

利润表

单位：人民币元

项 目	附注	本报告期	上年同期
一、收入		－2，316，269，723.27	261，919，505.76
1、利息收入（合计）		15，237，572.88	470，011.53
其中：存款利息收入		5，460，560.96	409，573.71
债券利息收入		8，493，906.10	60，437.82
资产支持证券利息收入		－	－
买入返售金融资产收入		1，283，105.82	－
2、投资收益（合计）		－1，377，422，470.10	233，826，369.95
其中：股票投资收益	(7)	－1，399，955，039.16	229，291，447.93
债券投资收益	(8)	4，904，629.17	3，378.00
资产支持证券投资收益		－	－
基金投资收益		－	－
衍生工具收益	(9)	1，427，149.82	2，244，492.67
股利收益		16，200，790.07	2，287，051.35
3、公允价值变动收益	(10)	－954，809，421.70	26，852，697.53
4、其他收入	(11)	724，595.65	770，426.75
二、费用		127，237，525.11	16，131，568.71
1、基金管理人报酬		46，154，598.50	4，072，745.65
2、基金托管费		7，692，433.13	678，790.97
3、销售服务费		－	－
4、交易费用	(12)	71，637，060.85	11，181，859.88
5、利息支出		1，508，510.62	－
其中：卖出回购金融资产支出		1，508，510.62	－
6、财务费用			
7、其他费用	(13)	244，922.01	198，172.21
三、利润总额		－2，443，507，248.38	245，787，937.05

注：所附附注为本会计报表的组成部分

(三) 所有者权益（基金净值）变动表

所有者权益（基金净值）变动表

单位：人民币元

项 目		本报告期			上年同期金额		
		实收基金	未分配利润	所有者权益合计	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）	1	3，304，293，132.61	4，425，192，617.17	7，729，485，749.78	161，068，732.94	16，116，445.36	177，185，178.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	2		－2，443，507，248.38	－2，443，507，248.38		245，787，937.05	245，787，937.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3	－215，502，878.60	－256，761，798.31	－472，264，676.91	350，304，461.29	167，780，563.92	518，085，025.21
其中：1.基金申购款	4	81，256，619.22	49，258，585.81	130，515，205.03	756，291，732.61	387，246，578.54	1，143，538，311.15
2.基金赎回款	5	－296，759，497.82	－306，020，384.12	－602，779，881.94	－405，987，271.32	－219，466，014.62	－625，453，285.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	6	－	－	－		－13，475，064.76	－13，475，064.76
五、期末所有者权益（基金净值）	7	3，088，790，254.01	1，724，923，570.48	4，813，713，824.49	511，373，194.23	416，209，881.57	927，583，075.80

注：所附附注为本会计报表的组成部分

(四) 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1，017，619.729.79份。

2、会计政策：

本基金本报告期的会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

自2007年7月1日起，本基金开始执行中国财政部2006年颁布的《企业会计准则》（简称“新会计准则”）、中国证券业协会2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、修改后的基金合同以及其他适用的基金行业实务操作的有关规定。

本基金已按照《企业会计准则第38号－首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定，对2007年1月1日至2007年6月30日止期间的会计报表予以追溯调整，调整涉及的主要内容包括：

a 将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；

b 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入权益的公允价值变动计入当期损益；

上述变更及调整对自2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净损益及所有者权益的汇总影响见会计报表主要项目注释的（15）。

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。根据财税[2007]84号文《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，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‰。经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由现行3‰调整为1‰。

(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[2006]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（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
交通银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人股东
国联证券股份有限公司（“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2008年6月30日基金各关联方投资本基金的情况：

	年初数					期末数	
关联人	持有份数	持有比例	买入	卖出	分红再投资	持有份数	持有比例
中海基金	57，006，954.99	0.69%	0	0	0	57，006，954.99	0.74%
中海信托	34，114，355.18	0.41%	0	0	0	34，114，355.18	0.44%

中海基金及中海信托在2007年上半年末持有本基金份额情况：

	年初数					期末数	
关联人	持有份数	持有比例	买入	卖出	分红再投资	持有份数	持有比例
中海基金	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%

中海基金其他主要股东及其实际控制人在2007年上半年末及2008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

2008年1月1日－2008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
1，893，751，955.42	9.33%	—	—	—	—	1，586，246.12	9.33%

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
1，677，872，083.06	37.63%	0.00	0.00%	5，416，731.84	15.71%	1，328，600.82	36.54%

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‰）

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

（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×1.5%／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46，154，598.50元，其中已支付基金管理人39，996，128.35元，尚余6，158，470.15元未支付。本基金上年同期应支付基金管理人管理费共4，072，745.65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×0.25%／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7，692，433.13元，其中已支付人民币6，666，021.43元，尚余人民币1，026，411.70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678，790.97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2008年1月1日起至2008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2008年6月30日保管的银行存款余额为1，065，398，599.58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2，255，396.43元。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。2007年1月1日至2007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164，266.07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2008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78，949，340.32元计入结算备付金科目。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。

6、报告期末流通转让受限制的基金资产

1）截至2008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	成功认购日	可流通日	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额（元）	期末估值总额(元)	流通受限类型
601899	紫金矿业	2008-04-18	2008-07-25	7.13	7.80	1，649，234	11，751，908.42	12，856，225.20	网下申购新股锁定
002223	鱼跃医疗	2008-04-10	2008-07-18	9.48	20.00	19，071	180，793.08	381，420.00	
002224	三力士	2008-04-17	2008-07-25	9.38	13.77	18，444	173，004.72	253，973.88	
002225	濮耐股份	2008-04-17	2008-07-25	4.79	6.50	46，153	221，072.87	299，994.50	
002226	江南化工	2008-04-24	2008-08-06	12.60	14.45	14，727	185，560.20	212，806.15	
002227	奥特迅	2008-04-24	2008-08-06	14.37	14.05	24，134	346，805.58	339，082.70	
002228	合兴包装	2008-04-24	2008-08-08	10.15	10.74	26，049	264，397.35	279，766.26	
002229	鸿博股份	2008-04-24	2008-08-08	13.88	13.58	19，853	275，559.64	269，603.74	
002231	奥维通信	2008-04-29	2008-08-12	8.46	8.50	21，837	184，741.02	185，614.50	
002232	启明信息	2008-04-29	2008-08-09	9.44	12.65	23，382	220，726.08	295，782.30	
002233	塔牌集团	2008-05-08	2008-08-18	10.03	9.70	81，237	815，408.91	788，580.90	
002234	民和股份	2008-05-08	2008-08-18	10.61	20.24	16，147	171，319.67	326，815.28	
002238	天威视讯	2008-05-14	2008-08-26	6.98	12.25	39，463	275，451.74	483，421.75	
002239	金飞达	2008-05-14	2008-08-22	9.33	8.98	26，180	244，259.40	235，096.40	
002241	歌尔声学	2008-05-16	2008-08-22	18.78	26.84	24，635	462，645.30	661，203.40	
002242	九阳股份	2008-05-20	2008-08-28	22.54	40.44	47，488	1，070，379.52	1，920，414.72	
002243	通产丽星	2008-05-20	2008-08-28	7.78	8.02	39，414	306，640.92	316，100.28	
002245	澳洋顺昌	2008-05-28	2008-09-05	16.38	16.02	10，566	173，071.08	169，267.32	
002246	北化股份	2008-05-29	2008-09-05	6.95	8.22	37，754	262，390.30	310，337.88	
002247	帝龙新材	2008-05-30	2008-09-12	16.05	14.65	13，026	209，067.30	190，830.90	
002257	立立电子	2008-06-30	未知	21.81	21.81	43，974	959，072.94	959，072.94	
002258	利尔化学	2008-06-30	2008-10-08	16.06	16.06	51，434	826，030.04	826，030.04	
600087	长航油运	2007-12-20	从2007年12月20日起12个月	9.33	7.32	6，300，000	58，800，000.00	46，116，000.00	非公开发行流通受限
600251	冠农股份	2008-06-06	从2008年6月6日起12个月	58.00	58.81	500，000	29，000，000.00	29，405，000.00	
000159	国际实业	2008-03-07	从2008年3月7日起12个月	12.10	13.65	3，000，000	36，300，000.00	40，950，000.00	
合计							143，680，306.08	139，032，440.04	

2）截至2008年06月30日，基金持有的暂时停牌股票明细如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额（元）	期末估值总额(元)
600096	云天化	2008-03-24	重大事项停牌	61.60	未知	－	1，567，729	76，255，571.77	96，572，106.40
600348	国阳新能	2008-06-30		45.11	2008-07-01	45.59	599，950	28，905，936.45	27，063，744.50
000423	东阿阿胶	2008-06-30		25.80	2008-07-01	25.87	2，503，060	65，531，113.45	64，578，948.00
000792	盐湖钾肥	2008-06-26		88.12	未知	－	446，978	39，747，047.34	39，387，701.36
合计								210，439，668.01	227，602，500.26

3）估值方法

本基金所持有的暂时停牌的股票，按停牌日交易所的股票收市价估值；

本基金所持有的认购新发或增发证券在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初始取得成本时，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初始取得成本时，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)×(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初始取得成本；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）。

七、投资组合报告

本基金托管人——交通银行已于2008年8月22日复核了本报告。截至2008年6月30日，中海优质成长证券投资基金资产净值为4，813，713，824.49元，基金份额净值为0.6261元，累计基金份额净值为2.4484元，基金份额为7，688，361，756.59份。

(一) 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	3，230，758，012.09	66.90
债券	262，540，054.00	5.44
权证	5，698，677.60	0.12
银行存款及清算备付金	1，144，347，939.90	23.70
其他资产	185，865，396.93	3.85
合计	4，829，210，080.52	100.00

(二) 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	96，652，389.28	2.01
2	B 采掘业	392，934，027.68	8.16
3	C 制造业	1，366，883，518.07	28.40
	C0 食品、饮料	242，440，000.00	5.04
	C1 纺织、服装、皮毛	235，096.40	0.00
	C2 木材、家具	－	－
	C3 造纸、印刷	867，750.00	0.02
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	598，294，616.70	12.43
	C5 电子	1，620，276.34	0.03
	C6 金属、非金属	175，410，029.31	3.64
	C7 机械、设备、仪表	152，603，970.42	3.17
	C8 医药、生物制品	137，156，948.00	2.85
	C9 其他制造业	58，254，830.90	1.21
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	30，932，000.00	0.64
5	E 建筑业	46，799，457.12	0.97
6	F 交通运输、仓储业	97，834，000.00	2.03
7	G 信息技术业	335，734，191.68	6.97
8	H 批发和零售贸易	307，218，862.81	6.38
9	I 金融、保险业	503，586，776.38	10.46
10	J 房地产	51，450，000.00	1.07
11	K 社会服务业	249，367.32	0.01
12	L 传播与文化产业	483，421.75	0.01
13	M 综合类	0.00	0.00
合 计		3，230，758，012.09	67.12

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	000061	农产品	9，175，942	185，904，584.92	3.86
2	000983	西山煤电	3，474，888	173，744，400.00	3.61
3	600486	扬农化工	3，925，477	123，299，232.57	2.56
4	600036	招商银行	5，000，000	117，100，000.00	2.43
5	600737	中粮屯河	7，000，000	114，870，000.00	2.39
6	000063	中兴通讯	1，800，000	112，680，000.00	2.34
7	600000	浦发银行	5，000，000	110，000，000.00	2.29
8	000159	国际实业	6，879，000	106，970，580.00	2.22
9	600588	用友软件	3，748，644	104，849，572.68	2.18
10	600096	云天化	1，567，729	96，572，106.40	2.01

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