

# 中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 18 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 中海优势精选混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 393001                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 前端交易代码     | 393001                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金合同生效日    | 2015 年 7 月 1 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 报告期末基金份额总额 | 124,030,391.76 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资目标       | 本基金主要投资具有估值优势、成长优势和财务优势的股票和较高投资价值的债券，通过构建股票与债券的动态均衡组合，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略       | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将深入分析宏观经济、政策层面、市场估值及市场情绪四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，优化大类资产配置，即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。</p> <p>2、二级市场股票投资策略</p> <p>在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。</p> <p>（1）定量分析</p> <p>本基金通过综合考察上市公司的财务优势、成长优势和估值优势来进行个股的筛选。</p> <p>本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、销售毛利率、利息保障比率。</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金考察的成长指标主要包括：总资产增长率、预测主营收入增长率、预测净利润增长率。</p> <p>本基金考察的估值指标主要包括：企业价值/息税折旧摊销前利润、市盈率、市净率。</p> <p>本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分，按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的核心竞争优势，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司，并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括：公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。</p> <p>3、新股申购策略</p> <p>本基金将充分依靠公司研究平台和股票估值体系、深入研究首次发行 (IPO) 股票及增发新股的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将实施积极的债券投资策略，主要运用利率预期策略、收益率曲线策略、利差策略、套利策略等多种策略获取稳健收益，以实现基金资产稳健增值。</p> <p>久期配置策略：通过分析宏观经济的周期变化，预判利率变动的方向和趋势，从而确定债券组合的久期，以有效回避利率风险。</p> <p>期限结构配置策略：在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，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。</p> <p>利差策略：在确定债券组合的期限结构后，本基金将通过对不同类别债券的收益率差进行分析，以其历史价格关系的数量分析为依据，预测其变动趋势，同时兼顾基本面分析，评价债券发行人的信用风险和信用级别，及时发现由于利差变动出现的价值被低估的债券品种，综合评判个券的投资价值，建立具体的个券组合。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×55%+中国债券总指数×45%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，在证券投资基金中属于中等风险收益品种。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金管理人  | 中海基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金托管人  | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                                     |
|--------|-------------------------------------|
| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） |
|--------|-------------------------------------|

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益      | 4,949,272.90   |
| 2. 本期利润         | 4,343,318.04   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0361         |
| 4. 期末基金资产净值     | 197,381,664.11 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.591          |

注：1：上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

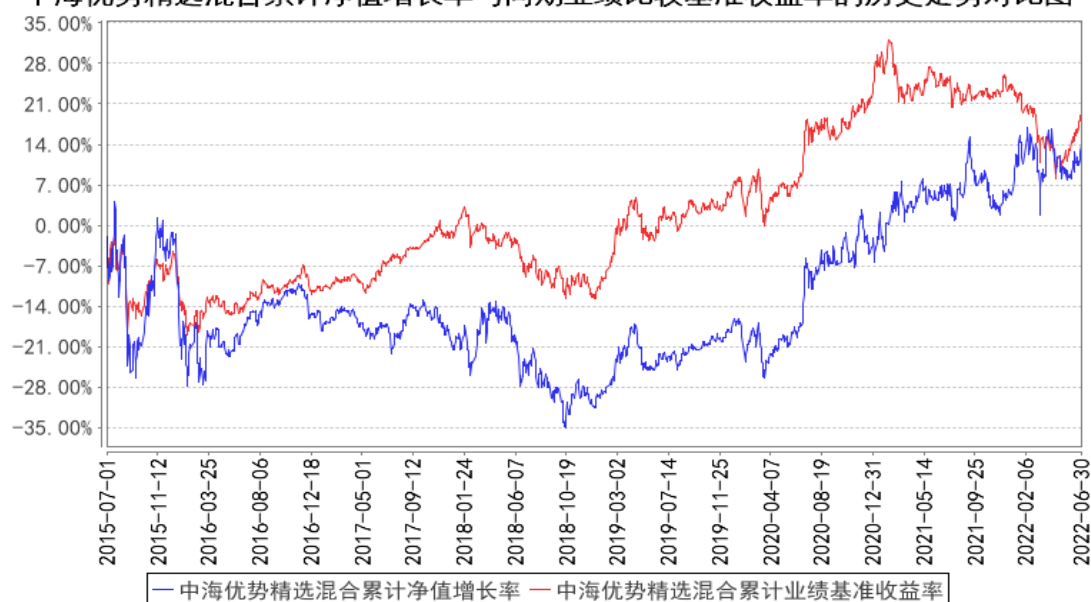
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

| 阶段      | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|---------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去 3 个月 | 2.25%      | 1.18%         | 3.96%          | 0.76%                 | -1.71% | 0.42% |
| 过去 6 个月 | 7.79%      | 1.33%         | -4.23%         | 0.79%                 | 12.02% | 0.54% |
| 过去 1 年  | 7.72%      | 1.16%         | -5.51%         | 0.68%                 | 13.23% | 0.48% |
| 过去 3 年  | 48.14%     | 1.07%         | 17.42%         | 0.69%                 | 30.72% | 0.38% |
| 过去 5 年  | 37.99%     | 1.10%         | 27.10%         | 0.68%                 | 10.89% | 0.42% |
| 成立至今    | 13.81%     | 1.27%         | 19.05%         | 0.76%                 | -5.24% | 0.51% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中海优势精选混合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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                         | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|----|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                            | 任职日期           | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 章俊 | 本基金基金经理、中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理、中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理、中海量化策略混合型证券投资基金基金经理、中海可转换债券债券型证券投资基金 | 2021 年 9 月 4 日 | —    | 9 年    | 章俊女士，上海海事大学国际贸易学专业硕士。历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信用评级分析师、长生人寿保险有限公司信用评估经理。2016 年 10 月进入本公司工作，曾任债券研究员、高级债券研究员、高级债券研究员兼基金经理助理，现任基金经理。2021 年 2 月至 2021 年 6 月任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2021 年 2 月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今任中海海颐混合型证券投资基金基金经理。 |

|     |                                                                                                    |                   |   |     |                                                                                                                                                                                                     |
|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|---|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 基金经<br>理、中海<br>海颐混合<br>型证券投<br>资基金基<br>金经理                                                         |                   |   |     |                                                                                                                                                                                                     |
| 梅寓寒 | 本基金基<br>金经理、<br>中海上证<br>50 指数增<br>强型证券<br>投资基金<br>基金经<br>理、中海<br>量化策略<br>混合型证<br>券投资基<br>金基金经<br>理 | 2021 年 9 月 4<br>日 | - | 9 年 | 梅寓寒女士，英国帝国理工学院风险管理与金融工程专业硕士。2013 年 3 月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、基金经理助理兼金融工程分析师，现任基金经理。2021 年 9 月至今任中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 9 月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2：证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入

有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，公司均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年二季度，受俄乌冲突，市场恐慌情绪升温，能源价格上涨导致国内工业成本增加。美国高通胀、美债收益率上行使得高估值板块大幅下跌。国内疫情扩散导致企业盈利预期出现大幅下滑，经济冲击较大，对市场进行二次冲击。随着疫情得到控制及相关政策的出台，A 股在 4 月 26 日起开始反弹。本轮反弹的驱动因素主要有：一、市场处于业绩真空期，经济基本面和上市公司业绩对市场的负面影响暂时消退。二、4 月底的政治局会议重申稳增长目标，市场预期政策利好出台。加之宽松的流动性环境下，使得 A 股风格从稳增长转向成长风格，股市资金活跃度和风险偏好有一定回归。二季度债市窄幅震荡，十年期国债利率先下后上，逐渐回升至疫情前水平。货币政策稳健中灵活适度，总量与结构调控双管齐下，保持流动性合理充裕。

5 月制造业 PMI 与非制造业 PMI 双双反弹，但是均处于荣枯线之下。内外需出现边际改善，但是内需依旧较为疲弱，表明我国宏观经济还面临一定压力。5 月出口金额当月同比超预期大幅反弹，5 月进口金额当月同比重返正增长，我国内外需出现边际改善。受疫情好转推动，5 月工业增加值当月同比与服务业生产指数当月同比均较前值上行。数据表明本轮新冠肺炎疫情最严重的冲击已经过去了，新冠肺炎疫情对 5 月宏观经济的冲击要弱于 4 月。

季内主要配置以银行为主的资产。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.591 元（累计净值 1.656 元）。报告期内本基金净值增长率为 2.25%，低于业绩比较基准 1.71 个百分点。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 155,214,093.55 | 74.36        |
|    | 其中：股票             | 155,214,093.55 | 74.36        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 40,196,121.44  | 19.26        |
|    | 其中：债券             | 40,196,121.44  | 19.26        |
|    | 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          | 1,500,000.00   | 0.72         |
|    | 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      | 11,780,162.66  | 5.64         |
| 8  | 其他资产              | 40,875.07      | 0.02         |
| 9  | 合计                | 208,731,252.72 | 100.00       |

### 5.2 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              | 24,401,601.93  | 12.36        |
| 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  | —              | —            |
| J  | 金融业              | 100,968,444.62 | 51.15        |
| K  | 房地产业             | 29,844,047.00  | 15.12        |
| 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 | 155,214,093.55 | 78.64 |
|--|----|----------------|-------|

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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  | 002244 | 滨江集团  | 1,882,600 | 16,284,490.00 | 8.25         |
| 2  | 601838 | 成都银行  | 949,739   | 15,746,672.62 | 7.98         |
| 3  | 601166 | 兴业银行  | 790,400   | 15,728,960.00 | 7.97         |
| 4  | 601658 | 邮储银行  | 2,911,800 | 15,694,602.00 | 7.95         |
| 5  | 601601 | 中国太保  | 664,800   | 15,642,744.00 | 7.93         |
| 6  | 601288 | 农业银行  | 5,179,600 | 15,642,392.00 | 7.92         |
| 7  | 601818 | 光大银行  | 4,514,400 | 13,588,344.00 | 6.88         |
| 8  | 000069 | 华侨城 A | 2,089,300 | 13,559,557.00 | 6.87         |
| 9  | 600019 | 宝钢股份  | 2,139,900 | 12,882,198.00 | 6.53         |
| 10 | 000898 | 鞍钢股份  | 3,562,500 | 11,471,250.00 | 5.81         |

### 5.4 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      | 11,308,510.03 | 5.73         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 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） | 28,887,611.41 | 14.64        |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 40,196,121.44 | 20.36        |

### 5.5 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  | 110053 | 苏银转债     | 117,230 | 14,768,574.38 | 7.48         |
| 2  | 019666 | 22 国债 01 | 111,830 | 11,308,510.03 | 5.73         |
| 3  | 113050 | 南银转债     | 66,140  | 8,114,321.57  | 4.11         |
| 4  | 113052 | 兴业转债     | 28,830  | 3,219,490.33  | 1.63         |
| 5  | 113055 | 成银转债     | 21,180  | 2,785,225.13  | 1.41         |

### 5.6 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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 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。

**5.9.2 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。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 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。

**5.10.2 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。

**5.10.3 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。

**5.11 投资组合报告附注****5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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。

**5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 25,546.99 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 3 | 应收股利  | —         |
| 4 | 应收利息  | —         |
| 5 | 应收申购款 | 15,328.08 |
| 6 | 其他应收款 | —         |
| — | 待摊费用  | —         |
| 7 | 其他    | —         |
| 8 | 合计    | 40,875.07 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 110053 | 苏银转债 | 14,768,574.38 | 7.48         |
| 2  | 113050 | 南银转债 | 8,114,321.57  | 4.11         |
| 3  | 113052 | 兴业转债 | 3,219,490.33  | 1.63         |

#### 5.11.5 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。

#### 5.11.6 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 100,130,859.27 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 45,826,692.81  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 21,927,160.32  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —              |
| 报告期期末基金份额总额               | 124,030,391.76 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|---------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比（%） |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 1              | 2022-04-01 至 2022-06-30 | 45,661,914.46 | 0.00 | 0.00 | 45,661,914.46 | 36.82   |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                         |               |      |      |               |         |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险</p> <p>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险</p> <p>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p> |                |                         |               |      |      |               |         |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海优势精选混合型证券投资基金的文件
- 2、中海优势精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海优势精选混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海优势精选混合型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

### 9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 9.3 查阅方式

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 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2022 年 7 月 21 日