

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.8 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贵金属投资明细 .....	46
7.9 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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
11.1 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 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中海沪港深价值优选混合	
基金主代码	002214	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,333,499.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中海沪港深价值优选混合 A	中海沪港深价值优选混合 C
下属分级基金的交易代码	002214	020362
报告期末下属分级基金的份额总额	48,331,848.36 份	2,001,651.26 份

注：根据法律法规及本基金基金合同的约定，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金于 2024 年 1 月 12 日起增加 C 类份额，并相应修改基金合同、托管协议及相关法律文件。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对国家政策导向以及行业发展趋势的研究，在沪深港三地证券市场中优选出具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严格控制投资组合风险的前提下力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和港股两地股票配置比例及投资策略：</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>本基金对于国内 A 股选择将采用自上而下的分析方法，在行业发展趋势中选择具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>1) 行业精选策略</p> <p>本基金主要从宏观经济周期和行业生命周期两个层次来分析不同行业的周期性属性。</p> <p>本基金基于“投资时钟理论”对宏观经济周期进行分析，根据不同行业在宏观经济周期各阶段的表现进行最优配置。本基金还将根据行业本身的生命周期分析，重点加强对成长期行业和成熟期行业的</p>

	<p>配置。</p> <p>2) 股票精选策略</p> <p>本基金对精选行业内的个股选择将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>①定量方式</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>②定性方式</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>(2) 港股投资策略</p> <p>本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金主要采用自上而下、重点挑选最符合国家产业政策和行业发展方向的主题，然后自下而上、精选个股的投资策略，重点投资于受益于经济结构转型及相关主题且具备估值优势的股票。</p> <p>1) 主题及行业发掘</p> <p>本基金通过投资研究团队持续关注政府财政及货币政策等宏观经济因素、产业振兴计划等政府政策导向来发掘具有以下特性的行业：具有长期可持续增长模式/享有强劲的长期增长；具有高进入壁垒和健康的竞争格局；受益于政策支持；新兴行业以及有升级潜力的行业；具有催化剂的行业。</p> <p>2) 股票精选策略</p> <p>对上市公司进行系统性分析，其中主要关注：</p> <p>①采用预期市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)及企业价值倍数(EV/EBITDA)等方法优选出财务透明稳健、管理出色且成长性较好的个股。</p> <p>②低估值、相对于A股折价或股价没有充分反映投资价值的、具有持续竞争优势的企业。</p> <p>③相对于A股较为稀缺或具有独特投资属性的公司。</p> <p>④符合国家战略导向、具备高成长性的企业。</p> <p>⑤具有股价催化剂、具有估值重估潜力的股票。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而下的资产配置。</p> <p>(2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。</p> <p>(3) 债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。</p> <p>个券选择：基于各个投资品种具体情况，自下而上的资产配置。</p> <p>个券选择应遵循如下原则：</p> <p>相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低的品种。</p> <p>流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。</p>
--	--

	<p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金将运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中海基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄乐军	任航
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95599
传真		021-68419525	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		曾杰	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层。

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	2024年1月12日(基金合同生效日) -2024年6月30日
	中海沪港深价值优选混合 A	中海沪港深价值优选混合 C
本期已实现收益	-6,811,488.31	-165,401.16
本期利润	-2,769,801.28	229,241.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0556	0.0610
本期加权平均净值利润率	-7.43%	8.02%
本期基金份额净值增长率	-6.58%	-1.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-27,112,453.17	-1,122,643.40
期末可供分配基金份额利润	-0.5610	-0.5609
期末基金资产净值	36,365,347.82	1,499,830.48
期末基金份额净值	0.752	0.749
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-18.60%	-1.45%

注：1、以上所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、自 2024 年 1 月 12 日起，本基金增加 C 类基金份额类别。

4、本基金增加 C 类基金份额类别后，本基金分设 A 类和 C 类两类基金份额，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额全部自动转换为中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额。



## 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

中海沪港深价值优选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.92%	1.05%	-2.26%	0.58%	1.34%	0.47%
过去三个月	1.62%	1.28%	2.47%	0.81%	-0.85%	0.47%
过去六个月	-6.58%	1.49%	2.86%	0.94%	-9.44%	0.55%
过去一年	-22.63%	1.46%	-6.32%	0.93%	-16.31%	0.53%
过去三年	-61.65%	1.65%	-31.08%	1.11%	-30.57%	0.54%
自基金合同生效起至今	-18.60%	1.39%	2.84%	1.01%	-21.44%	0.38%

中海沪港深价值优选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.79%	1.06%	-2.26%	0.58%	1.47%	0.48%
过去三个月	1.63%	1.28%	2.47%	0.81%	-0.84%	0.47%
自基金合同生效起至今	-1.45%	1.50%	6.83%	0.95%	-8.28%	0.55%

注：1. 基金管理人自 2024 年 1 月 12 日起对中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金进行份额分类, 原有基金份额为 A 类份额, 增设 C 类份额。

2. 中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 A “自基金合同生效起至今”指 2016 年 4 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日。中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 C “自基金合同生效起至今”为 2024 年 1 月 12 日（份额增加日）至 2024 年 6 月 30 日。

3. 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%。

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数来衡量 A 股股票投资部分的绩效。

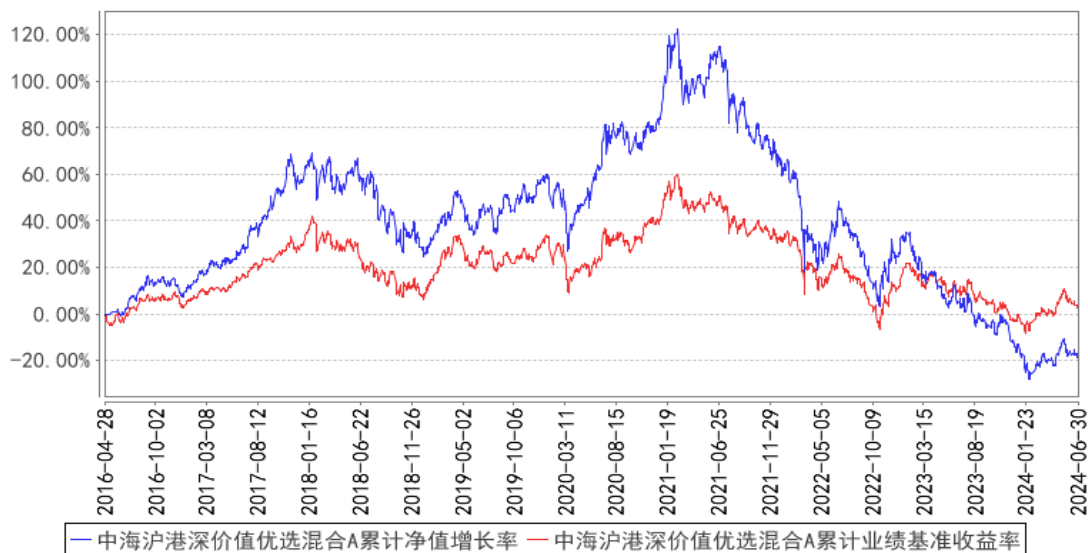
恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股股票投资部分的绩效。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。

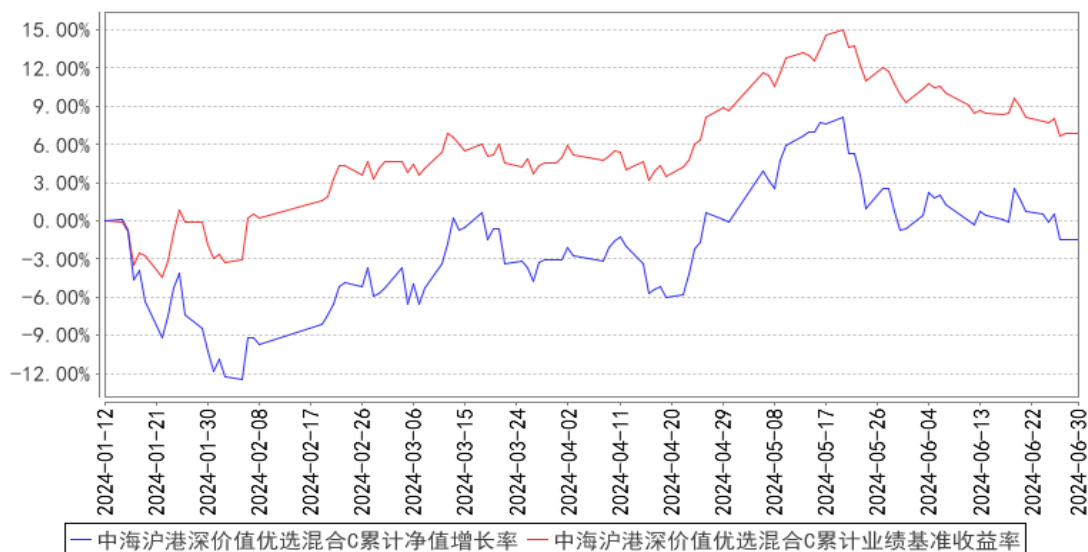
根据本基金的投资范围和投资比例，设定本基金的业绩比较基准为：“沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%”，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

中海沪港深价值优选混合A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



中海沪港深价值优选混合C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：1. 基金管理人自 2024 年 1 月 12 日起对中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金进行份额分类, 原有基金份额为 A 类份额, 增设 C 类份额。

2. 中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 C 图示日期为 2024 年 1 月 12 日（份额增加日）至 2024 年 6 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。截至 2024 年 6 月 30 日, 共管理证券投资基金 33 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚炜	本基金基金经理、中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金	2021 年 7 月 30 日	-	15 年	姚炜先生, 华东师范大学世界经济专业硕士。历任凯基证券（原台证证券）上海代表处分析师、光大证券国际有限公司分析师、交银国际(上海)股权投资管理有限公司分析师、兴业证券股份有限公司高级分析师。2017 年 10 月进入本公司工作, 曾任高级分析师兼基金经理助理, 现任基金

	金基金经理、中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理				经理。2018 年 12 月至 2021 年 7 月任中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月至今任中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 4 月至今任中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月至今任中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈玮	本基金基金经理	2019 年 7 月 19 日	2024 年 5 月 9 日	15 年	陈玮先生，美国约翰霍普金斯大学化学专业硕士。历任美国 Vertex Inc. 项目经理，南方基金管理股份有限公司研究员、高级研究员、投资经理助理，深圳市玮越达私募证券投资基金管理有限公司董事长、总经理兼投资总监，宁波市梅山保税港区荟金投资管理有限公司股票投资总监。2019 年 5 月至 2024 年 5 月在本公司工作，曾任基金经理。2019 年 7 月至 2024 年 4 月任中海沪港深多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2019 年 7 月至 2024 年 5 月任中海沪港深价值优选灵活配置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《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。

3：2024 年 5 月 9 日，陈玮离任本基金的基金经理，由姚炜继续管理该基金。

## 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的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，全球股票市场整体走势分化，发达经济体中，日经 225 指数表现最好，新兴市场中印度 SENSEX30 指数表现最好，AH 指数表现中规中矩。今年上半年沪深 300 指数上涨 0.9%；恒生指数整体上涨 3.9%。

具体到港股方面，港股整体呈现先抑后扬的走势，1 月份受到美国通胀超预期以及国内部分经济数据偏弱的影响，市场连续下跌，最低跌破 15000 点。2 月以后，由于春节消费数据较好，叠加降准降息等利好推动，市场出现触底反弹。3 月以后，指数虽然横盘整理，但是内部结构性机会不断。进入 2 季度以后，港股市场有一波明显的反弹走势，行情是从 4 月 22 日开始，5 月 20 日结束，恒生指数上涨 21.4%，恒生科技指数上涨 26.2%。此轮市场的上涨我们认为并不是由于整体经济基本面发生了大的改变。主要是由于：1、港股本身的估值偏低；2、部分政策刺激带来预期的改善，如房地产政策的不断出台；3、海外角度，美国的经济数据表现低于预期，以及日元的贬值等，推动资金阶段性从海外回流至香港市场。板块表现来看，今年上半年表现比较好的板块包括家电、军工、有色、建筑、环保和煤炭等。可以看出，上半年出口占比高或者低估值高股息类型板块表现更加亮眼。

报告期内，本基金主要是以中观角度去选股，优先选择成长性好的行业，在成长性好的行业中选择龙头或者最有竞争力的企业。对于稳定性的行业，挑选市场份额有提升空间的个股，同时注重盈利能力及现金流水平。此外也会结合宏观判断和估值的安全边际进行考虑。我们上半年的

持仓主要集中在港股，A 股的持仓有所下降，主要是基于市场比较优势进行配置。行业上，增加了金融和材料的持仓，减少了消费和医药的持仓。主要是考虑目前消费数据偏弱，以及美联储降息预期连续推迟，消费和医药整体投资环境不佳，相较而言，高股息资产和景气度高的周期行业更有优势。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 0.752 元(累计净值 0.872 元)，报告期内本基金 A 类净值增长率为-6.58% 低于业绩比较基准 9.44 个百分点；本基金 C 类份额净值 0.749 元（累计净值 0.749 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-1.45%，低于业绩比较基准 8.28 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 A 股和 H 股市场总体的走势判断持谨慎乐观态度，支持市场的因素主要来自于：1、估值上来看，AH 估值都不高，H 股尤其更低，恒指的 PB 估值低于 1，且低于历史均值 1 个标准差；2、AH 具有各自的优势产业，港股的优势产业体现在互联网、生化科技、餐饮及纺织服装等大消费行业个股，同时 A+H 同时上市的个股中，H 股的估值更低。A 股的优势体现在制造业以及新能源等。目前市场能否出现反转行情，主要取决于分子端的经济基本面何时出现扭转，和分母端的美联储何时能够降息。上述条件若发生，市场的情绪有望显著改善。美联储如果能够降息，新兴市场流动性有望出现改善，H 股市场相较于 A 股受益会更加明显。我们现在整体的配置思路仍然是以港股为主体框架，同时我们会考虑增加 A 股优势行业来适度增强弹性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、合规管理负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2024 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间，本基金曾出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，公司已向中国证券监督管理委员会上报相关后续运作方案。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中海基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中海基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	5,080,653.88	4,735,028.70
结算备付金		617,933.95	478,329.49
存出保证金		17,855.72	15,120.90
交易性金融资产	6.4.7.2	32,370,347.93	38,064,483.50
其中：股票投资		32,370,347.93	38,064,483.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	893,708.43
应收股利		170,091.96	-
应收申购款		9,208.50	39,467.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		38,266,091.94	44,226,138.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7.22	144,316.45
应付赎回款		247,800.80	2,661,140.39
应付管理人报酬		38,453.38	47,391.51
应付托管费		6,408.91	7,898.59
应付销售服务费		594.21	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	107,649.12	174,754.16
负债合计		400,913.64	3,035,501.10
<b>净资产：</b>			



实收基金	6.4.7.10	50,333,499.62	51,151,059.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-12,468,321.32	-9,960,422.51
净资产合计		37,865,178.30	41,190,637.06
负债和净资产总计		38,266,091.94	44,226,138.16

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，中海沪港深价值优选混合 A 基金份额净值 0.752 元，基金份额总额 48,331,848.36 份；中海沪港深价值优选混合 C 基金份额净值 0.749 元，基金份额总额 2,001,651.26 份。中海沪港深价值优选混合基金份额总额合计为 50,333,499.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,210,760.17	-8,865,130.33
1. 利息收入		23,571.40	22,989.20
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,571.40	22,989.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,679,194.16	-5,551,306.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,967,007.72	-5,835,566.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	287,813.56	284,260.32
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,436,329.82	-3,353,801.62
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 21	8, 532. 77	16, 988. 38
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>329, 799. 48</b>	<b>544, 474. 05</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	236, 944. 18	404, 091. 65
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	39, 490. 70	67, 348. 62
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	5, 030. 30	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	48, 334. 30	73, 033. 78
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-2, 540, 559. 65</b>	<b>-9, 409, 604. 38</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-2, 540, 559. 65</b>	<b>-9, 409, 604. 38</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-2, 540, 559. 65</b>	<b>-9, 409, 604. 38</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51, 151, 059. 57	-	-9, 960, 422. 51	41, 190, 637. 06
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51, 151, 059. 57	-	-9, 960, 422. 51	41, 190, 637. 06
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-817, 559. 95	-	-2, 507, 898. 81	-3, 325, 458. 76

(一)、综合收益总额	-	-	-2,540,559.65	-2,540,559.65
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-817,559.95	-	32,660.84	-784,899.11
其中：1. 基金申购款	11,832,186.70	-	-3,075,623.87	8,756,562.83
2. 基金赎回款	-12,649,746.65	-	3,108,284.71	-9,541,461.94
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,333,499.62	-	-12,468,321.32	37,865,178.30
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	50,622,386.53	-	8,303,475.99	58,925,862.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	50,622,386.53	-	8,303,475.99	58,925,862.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-178,245.72	-	-9,718,731.35	-9,896,977.07
(一)、综合收益总额	-	-	-9,409,604.38	-9,409,604.38
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-178,245.72	-	-309,126.97	-487,372.69

其中：1. 基金申购款	5,471,997.86	-	468,757.04	5,940,754.90
2. 基金赎回款	-5,650,243.58	-	-777,884.01	-6,428,127.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,444,140.81	-	-1,415,255.36	49,028,885.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

曾杰

李俊

周琳

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]2745号《关于准予中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中海基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开发行募集,基金合同生效日为2016年4月28日,首次设立募集规模为221,570,748.81份基金份额,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验字[2016]第435号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年4月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为221,570,748.81份基金份额,其中认购资金利息折合40,622.25份基金份额。本基金为契约型,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中海基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据基金管理人2024年1月9日发布的《关于旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同相应条款的公告》,经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案,自2024年1月12日起对本基金增加C类份额并相应修改基

金合同。本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。本基金新增基金份额类别后，将分设 A 类和 C 类基金份额。其中，A 类基金份额指在投资者申购基金时收取申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；C 类基金份额指在投资者申购基金时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，并分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金的投资范围为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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券等）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金在本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,080,653.88
等于：本金	5,079,825.25
加：应计利息	828.63
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,080,653.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	31,216,346.98	-	32,370,347.93	1,154,000.95



贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,216,346.98	-	32,370,347.93	1,154,000.95

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金在本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金在本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金在本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金在本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期无债权投资，不需计提减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金在本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期无其他债权投资，不需计提减值准备。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	884.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	64,472.16
其中：交易所市场	64,472.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,292.30
合计	107,649.12

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 中海沪港深价值优选混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,151,059.57	51,151,059.57
本期申购	3,090,615.82	3,090,615.82
本期赎回（以“-”号填列）	-5,909,827.03	-5,909,827.03
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	48,331,848.36	48,331,848.36

## 中海沪港深价值优选混合 C

项目	本期 2024年1月12日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	8,741,570.88	8,741,570.88

本期赎回（以“-”号填列）	-6,739,919.62	-6,739,919.62
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,001,651.26	2,001,651.26

注：1、其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

2、根据基金管理人 2024 年 1 月 9 日发布的《关于旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同相应条款的公告》，中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金自 2024 年 1 月 12 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金在本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中海沪港深价值优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,819,950.86	11,859,528.35	-9,960,422.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-21,819,950.86	11,859,528.35	-9,960,422.51
本期利润	-6,811,488.31	4,041,687.03	-2,769,801.28
本期基金份额交易产生的变动数	1,518,986.00	-755,262.75	763,723.25
其中：基金申购款	-1,631,746.03	872,240.17	-759,505.86
基金赎回款	3,150,732.03	-1,627,502.92	1,523,229.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,112,453.17	15,145,952.63	-11,966,500.54

中海沪港深价值优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-165,401.16	394,642.79	229,241.63
本期基金份额交易产生的变动数	-957,242.24	226,179.83	-731,062.41
其中：基金申购款	-4,732,291.83	2,416,173.82	-2,316,118.01
基金赎回款	3,775,049.59	-2,189,993.99	1,585,055.60

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,122,643.40	620,822.62	-501,820.78

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		19,486.76
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		3,795.31
其他		289.33
合计		23,571.40

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-6,967,007.72
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-6,967,007.72

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		94,840,974.74
减：卖出股票成本总额		101,486,716.78
减：交易费用		321,265.68
买卖股票差价收入		-6,967,007.72

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期无股票投资收益—证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	287,813.56
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	287,813.56

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	4,436,329.82
股票投资	4,436,329.82
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,436,329.82

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	8,391.84
基金转换费收入	140.93
合计	8,532.77

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	12,929.28
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行费用	1,542.00
账户维护费	9,000.00
合计	48,334.30

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、代销机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	236,944.18	404,091.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	100,248.00	182,210.96

应支付基金管理人的净管理费	136,696.18	221,880.69
---------------	------------	------------

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

2、自 2023 年 8 月 24 日起管理费率为 1.50%/年调整为 1.20%/年。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,490.70	67,348.62

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

2、自 2023 年 8 月 24 日起托管费率为 0.25%/年调整为 0.20%/年。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海沪港深价值优选混合 A	中海沪港深价值优选混合 C	合计
中海基金	-	0.00	0.00
农业银行	-	0.00	0.00
国联证券	-	0.00	0.00
合计	-	0.00	0.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		



	中海沪港深价值优选 混合 A	中海沪港深价值优选 混合 C	合计
中海基金	-	-	-
农业银行	-	-	-
国联证券	-	-	-
合计	-	-	-

注：根据基金管理人 2024 年 1 月 9 日发布的《关于旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同相应条款的公告》，中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金自 2024 年 1 月 12 日起，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金在本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	5,080,653.88	19,486.76	6,832,420.64	18,020.71

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2024 半年度获得的利息收入为人民币 3,795.31 元 (2023 半年度：人民币 4,787.77 元)，2024 半年末结算备付金余额为人民币 617,933.95 元 (2023 半年末：人民币 405,369.88 元)。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金管理有限公司投资决策委员会议事规则》、《中海基金管理有限公司公募基金投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司研究部管理办法》、《中海基金管理有限公司基金股票库管理办法》、《中海基金管理有限公司基金债券库管理办法》、《中海基金管理有限公司基金投资组合信用债业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理部门、合规管理部门、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人管理的托管户中，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市或在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

下表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	5,080,653.88	-	-	-	-	-	5,080,653.88
结算备付金	617,933.95	-	-	-	-	-	617,933.95
存出保证金	17,855.72	-	-	-	-	-	17,855.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	32,370,347.93	32,370,347.93
应收股利	-	-	-	-	-	170,091.96	170,091.96
应收申购款	-	-	-	-	-	9,208.50	9,208.50
资产总计	5,716,443.55	-	-	-	-	32,549,648.39	38,266,091.94
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	247,800.80	247,800.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,453.38	38,453.38
应付托管费	-	-	-	-	-	6,408.91	6,408.91
应付清算款	-	-	-	-	-	7.22	7.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	594.21	594.21
其他负债	-	-	-	-	-	107,649.12	107,649.12
负债总计	-	-	-	-	-	400,913.64	400,913.64
利率敏感度缺口	5,716,443.55	-	-	-	-	32,148,734.75	37,865,178.30
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	4,735,028.70	-	-	-	-	-	4,735,028.70
结算备付金	478,329.49	-	-	-	-	-	478,329.49
存出保证金	15,120.90	-	-	-	-	-	15,120.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-38,064,483.50	-	38,064,483.50
应收申购款	-	-	-	-	-	39,467.14	39,467.14
应收清算款	-	-	-	-	-	893,708.43	893,708.43
资产总计	5,228,479.09	-	-	-	-38,997,659.07	-	44,226,138.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,661,140.39	2,661,140.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,391.51	47,391.51
应付托管费	-	-	-	-	-	7,898.59	7,898.59
应付清算款	-	-	-	-	-	144,316.45	144,316.45
其他负债	-	-	-	-	-	174,754.16	174,754.16
负债总计	-	-	-	-	-	3,035,501.10	3,035,501.10
利率敏感度缺口	5,228,479.09	-	-	-	-	-35,962,157.97	41,190,637.06

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末和上年度末均未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价。本基金在购买港股时会存在人民币与港币之间的转换，但本基金不持有外币头寸，故汇率变化不会给基金资产带来重大影响，因此本基金无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于股

票的比例占基金资产的 0-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，本基金持有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。。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	32,370,347.93	85.49	38,064,483.50	92.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	32,370,347.93	85.49	38,064,483.50	92.41

注：由于四舍五入的原因，上表“占基金资产净值的比例”列数据可能与实际值存在微小的误差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数与恒生指数同时变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数与恒生指数同时变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	+5%	1,835,348.25	2,014,524.13
	-5%	-1,835,348.25	-2,014,524.13

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。		
	根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。		
	以 95% 的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值（不足 100 个交易日不予计算）。		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	收益率绝对 VaR (%)	2.31	2.44
	合计	-	-

注：上述分析衡量了在 95% 的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	32,370,347.93	38,064,483.50
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	32,370,347.93	38,064,483.50



#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金在本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,370,347.93	84.59
	其中：股票	32,370,347.93	84.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,698,587.83	14.89
8	其他各项资产	197,156.18	0.52
9	合计	38,266,091.94	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	835,520.00	2.21
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	-	-
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	835,520.00	2.21

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	2,670,950.00	7.05
B 消费者非必需品	2,935,386.60	7.75
C 消费者常用品	360,780.00	0.95
D 能源	1,818,915.00	4.80
E 金融	5,326,278.00	14.07
F 医疗保健	6,434,945.85	16.99
G 工业	2,160,993.00	5.71
H 信息技术	1,292,204.32	3.41
I 电信服务	6,844,781.56	18.08
J 公用事业	699,143.60	1.85
K 房地产	990,450.00	2.62
合计	31,534,827.93	83.28

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	00700	腾讯控股	10,412	3,538,830.56	9.35

2	03690	美团-W	21,319	2,161,746.60	5.71
3	00013	和黄医药	78,967	1,982,071.70	5.23
4	09626	哔哩哔哩-W	15,980	1,850,803.60	4.89
5	01801	信达生物	44,910	1,508,526.90	3.98
6	00941	中国移动	20,705	1,455,147.40	3.84
7	00388	香港交易所	6,300	1,438,605.00	3.80
8	03968	招商银行	43,500	1,407,225.00	3.72
9	00005	汇丰控股	21,200	1,321,608.00	3.49
10	02899	紫金矿业	84,000	1,263,360.00	3.34
11	02601	中国太保	66,600	1,158,840.00	3.06
12	09995	荣昌生物	50,500	1,129,180.00	2.98
13	00317	中船防务	68,000	1,092,080.00	2.88
14	09926	康方生物	30,393	1,047,038.85	2.77
15	01088	中国神华	31,500	1,033,515.00	2.73
16	00123	越秀地产	213,000	990,450.00	2.62
17	01818	招金矿业	66,500	795,340.00	2.10
18	01164	中广核矿业	330,000	785,400.00	2.07
19	01347	华虹半导体	38,536	775,344.32	2.05
20	00175	吉利汽车	90,000	721,800.00	1.91
21	00189	东岳集团	79,000	612,250.00	1.62
22	03898	时代电气	19,900	559,389.00	1.48
23	02057	中通快递-W	3,400	509,524.00	1.35
24	603283	赛腾股份	5,700	435,480.00	1.15
25	03692	翰森制药	28,000	416,920.00	1.10
26	601138	工业富联	14,600	400,040.00	1.06
27	01816	中广核电力	121,740	382,263.60	1.01
28	00322	康师傅控股	42,000	360,780.00	0.95
29	00285	比亚迪电子	10,000	355,900.00	0.94
30	06990	科伦博泰生物-B	2,300	348,036.00	0.92
31	01811	中广核新能源	136,000	316,880.00	0.84
32	00992	联想集团	16,000	160,960.00	0.43
33	02255	海昌海洋公园	81,000	51,840.00	0.14
34	02162	康诺亚-B	103	3,172.40	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01024	快手-W	3,652,459.48	8.87
2	00005	汇丰控股	2,250,628.26	5.46
3	03993	洛阳钼业	2,185,777.38	5.31
4	09626	哔哩哔哩-W	2,173,274.90	5.28

5	02899	紫金矿业	1,318,799.75	3.20
6	601899	紫金矿业	766,639.00	1.86
7	01347	华虹半导体	2,053,502.92	4.99
8	00388	香港交易所	2,051,318.64	4.98
9	03347	泰格医药	1,364,105.93	3.31
10	300347	泰格医药	430,604.00	1.05
11	01548	金斯瑞生物科技	1,759,310.73	4.27
12	09995	荣昌生物	1,731,492.69	4.20
13	300308	中际旭创	1,722,792.00	4.18
14	03690	美团-W	1,555,104.89	3.78
15	02318	中国平安	1,554,927.02	3.77
16	601138	工业富联	1,524,387.00	3.70
17	03968	招商银行	1,474,709.29	3.58
18	03898	时代电气	1,423,633.72	3.46
19	01088	中国神华	1,394,557.04	3.39
20	02601	中国太保	1,311,359.35	3.18
21	02338	潍柴动力	1,261,508.44	3.06
22	01818	招金矿业	1,181,982.41	2.87
23	00013	和黄医药	1,164,291.08	2.83
24	02269	药明生物	1,116,757.82	2.71
25	00857	中国石油股份	1,107,307.85	2.69
26	001309	德明利	1,098,830.00	2.67
27	02020	安踏体育	1,048,016.45	2.54
28	02382	舜宇光学科技	1,046,527.71	2.54
29	00123	越秀地产	1,036,507.46	2.52
30	688037	芯源微	949,630.74	2.31
31	09868	小鹏汽车-W	924,875.02	2.25
32	300702	天宇股份	891,215.00	2.16
33	01211	比亚迪股份	887,785.55	2.16
34	02669	中海物业	866,422.69	2.10
35	00317	中船防务	855,878.59	2.08
36	00700	腾讯控股	853,175.56	2.07
37	06690	海尔智家	831,931.14	2.02

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01024	快手-W	4,906,421.08	11.91
2	01548	金斯瑞生物科技	2,931,102.69	7.12

		技		
3	02318	中国平安	2,830,970.66	6.87
4	03993	洛阳钼业	2,631,844.78	6.39
5	300308	中际旭创	2,269,804.00	5.51
6	02382	舜宇光学科技	2,031,611.46	4.93
7	09868	小鹏汽车-W	1,984,890.02	4.82
8	03690	美团-W	1,836,124.98	4.46
9	03347	泰格医药	1,237,316.35	3.00
10	300347	泰格医药	487,680.00	1.18
11	01093	石药集团	1,646,169.89	4.00
12	01088	中国神华	1,631,283.31	3.96
13	00857	中国石油股份	1,610,578.38	3.91
14	601899	紫金矿业	1,602,096.00	3.89
15	001309	德明利	1,549,340.00	3.76
16	00700	腾讯控股	1,547,355.43	3.76
17	00941	中国移动	1,536,070.75	3.73
18	06160	百济神州	1,519,834.34	3.69
19	02162	康诺亚-B	1,428,606.76	3.47
20	01928	金沙中国有限公司	1,388,168.21	3.37
21	02269	药明生物	1,378,673.42	3.35
22	00388	香港交易所	1,367,485.00	3.32
23	02338	潍柴动力	1,274,550.83	3.09
24	09995	荣昌生物	1,261,625.74	3.06
25	601138	工业富联	1,227,860.00	2.98
26	01347	华虹半导体	1,114,416.80	2.71
27	00006	电能实业	1,095,181.52	2.66
28	02020	安踏体育	1,024,300.04	2.49
29	09926	康方生物	996,891.02	2.42
30	02359	药明康德	971,571.12	2.36
31	00005	汇丰控股	959,017.85	2.33
32	03759	康龙化成	956,725.94	2.32
33	300702	天宇股份	926,953.00	2.25
34	01258	中国有色矿业	888,659.53	2.16
35	02273	固生堂	886,543.92	2.15
36	06690	海尔智家	870,426.34	2.11
37	00762	中国联通	859,649.46	2.09
38	688037	芯源微	858,129.38	2.08
39	03898	时代电气	842,715.63	2.05
40	09896	名创优品	827,112.66	2.01

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	91,356,251.39
卖出股票收入（成交）总额	94,840,974.74

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金在本报告期末未持有债券。

### 7.6 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

注：本基金在本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金在本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金在本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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

注：本基金在本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局的处罚。

本基金投资上述发行主体的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。本基金管理人的投研团队对上述发行主体受处罚事件进行了及时分析和跟踪研究，认为该事件对相关标的投资价值未产生实质性影响。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,855.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	170,091.96
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,208.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,156.18

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金在本报告期末未持有债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金在本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
中海沪港深价值优选混合 A	24,273	1,991.18	0.00	0.00	48,331,848.36	100.00
中海沪港深价值优选混合 C	82	24,410.38	0.00	0.00	2,001,651.26	100.00
合计	24,355	2,066.66	0.00	0.00	50,333,499.62	100.00

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中海沪港深价值优选混合 A	45,557.92	0.0943
	中海沪港深价值优选混合 C	25.21	0.0013
	合计	45,583.13	0.0906

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中海沪港深价值优选混合 A	0~10
	中海沪港深价值优选混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中海沪港深价值优选混合 A	0~10
	中海沪港深价值优选混合 C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海沪港深价值优选混合 A	中海沪港深价值优选混合 C
基金合同生效日 (2016年4月28日) 基金份额总额	221,570,748.81	-
本报告期期初基金份额总额	51,151,059.57	-
本报告期基金总申购份额	3,090,615.82	8,741,570.88
减：本报告期基金总赎回份额	5,909,827.03	6,739,919.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	48,331,848.36	2,001,651.26

注：1、报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2、本基金于 2024 年 1 月 12 日增加 C 类份额，详见本基金管理人于 2024 年 1 月 9 日发布的《关于旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同相应条款的公告》。



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人于 2024 年 5 月 22 日发布公告，曹伟先生、祝康先生担任公司总经理助理。

本报告期内，本基金管理人于 2024 年 6 月 25 日发布公告，许定晴女士担任公司总经理助理。

本报告期内，本基金基金经理变更为姚炜先生。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 2 月 27 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	公司：警示函；高级管理人员：警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	在业务开展过程中存在违反《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等相关法规的情形
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已按照法律法规及监管要求，完成整改工作并向监管机构报送整改报告
其他	此事项不影响公司业务的正常开展

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	2	140,708,577.22	75.57	113,014.18	76.75	-
国海证券	2	22,046,750.61	11.84	16,445.07	11.17	-
华福证券	2	10,219,416.35	5.49	7,622.76	5.18	-
东北证券	1	8,310,692.80	4.46	6,198.89	4.21	-
西南证券	1	3,355,414.00	1.80	2,502.64	1.70	-
国泰君安	1	1,164,548.00	0.63	1,101.47	0.75	-
华创证券	1	391,827.15	0.21	370.60	0.25	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演、应我方委托完成的课题研究或专项培训等。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司分别与券商进行商务谈判，签订协议后租用证券交易单元。

2. 本报告期内没有新增交易单元；退租了银河证券的上海、深圳交易单元，国投证券、申万宏源证券的上海交易单元，以及天风证券、渤海证券的深圳交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏	-	-	-	-	-	-

源						
首创证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金年度最后一日净值公告	报刊及规定网站	2024-1-1
2	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金修订后基金合同（2024年1月）	规定网站	2024-1-9
3	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-1-9
4	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	规定网站	2024-1-9
5	关于中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同相应条款的公告	报刊及规定网站	2024-1-9
6	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2024年第1号）	规定网站	2024-1-9
7	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金修订后托管协议（2024年1月）	规定网站	2024-1-9
8	中海基金管理有限公司关于旗下中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券	报刊及规定网站	2024-1-17

	投资基金 C 新增销售机构的公告		
9	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务并参加费率优惠的公告	报刊及规定网站	2024-1-17
10	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-1-22
11	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务并参加费率优惠的公告	报刊及规定网站	2024-3-25
12	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	规定网站	2024-3-29
13	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-4-22
14	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	报刊及规定网站	2024-5-9
15	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	报刊及规定网站	2024-5-13
16	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（中海沪港深价值优选混合 A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-5-14
17	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（中海沪港深价值优选混合 C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-5-14
18	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 2 号）	规定网站	2024-5-14
19	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2024-6-24
20	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 3 号）	规定网站	2024-6-27
21	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（中海沪港深价值优选混合 A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-6-27
22	中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（中海沪港深价值优选混合 C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-6-27

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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  
无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海沪港深价值优选灵活配置证券投资基金的文件
- 2、中海沪港深价值优选灵活配置证券投资基金基金合同
- 3、中海沪港深价值优选灵活配置证券投资基金托管协议
- 4、中海沪港深价值优选灵活配置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

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 12.3 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

2024 年 8 月 30 日