

# 中海信息产业精选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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)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 日至 2024 年 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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	15
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	16
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	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
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 .....	47
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 .....	47
<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>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
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 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</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 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海信息产业精选混合型证券投资基金	
基金简称	中海信息产业混合	
基金主代码	000166	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 15 日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	62,489,155.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中海信息产业混合 A	中海信息产业混合 C
下属分级基金的交易代码	000166	018848
报告期末下属分级基金的份额总额	62,371,675.10 份	117,480.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信息产业的上市公司股票，在控制风险的前提下，力争实现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，比较不同证券市场 and 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>(1) 信息产业相关行业股票的界定</p> <p>本基金界定的信息产业相关行业或主题上市公司包括： 属于传统信息产业的行业：主要包含申万一级行业中的电子、通信、传媒、计算机等一级行业。具体包含： ①电子信息相关行业和公司，包括计算机整机制造、计算机网络设备制造、电子计算机外部设备制造、电子计算机应用产品制造、家庭视听设备、测量仪器、电子工业专用设备、电子元件、电子器件、电子信息机电产品、信息产品专用材料以及雷达等； ②通信设备和软件相关行业和公司，包括通信传输设备制造、通信交换设备制造、通信终端设备制造、移动通信设备制造、软件产品、系统集成制造和软件信息服务等； ③传媒相关行业和公司，包括平面媒体、广播电视、电影动画、互联网和整合营销等； ④计算机相关行业和公司，包括计算机制造业和计算机服务业，计算机制造业包含生产各种计算机系统、外围设备终端设备，以及有</p>

关装置、元件、器件和材料的制造。计算机服务业包括向用户提供各种技术服务和销售服务等。

未来若由于技术进步、经济结构变化、政策环境变化导致本基金对信息产业的相关行业或主题界定范围发生变动的或出现更为科学的行业分类标准的，本基金管理人将在审慎研究的基础上，重新界定本基金所覆盖的行业范围，并在更新的招募说明书中进行公告，而无需召开基金持有人大会。

#### (2) 信息产业股票的投资策略

本基金主要投资于信息产业相关行业上市公司的股票，投资比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金对信息产业的个股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。

##### 1) 定量方式

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。

本基金考察的成长指标主要包括：主营收入增长率、净利润增长率。

本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。

本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市盈率/净利增长率。

##### 2) 定性方式

本基金主要通过实地调研等方法，在综合考察评估公司核心竞争优势的基础上，侧重对公司成长能力进行研究，重点投资在业内具有明显竞争力和比较优势的公司；公司治理结构完善、经营管理稳定的公司以及在产品、技术、资源等方面具有明显优势并能在快速成长的过程中不断提高市场占有率的公司。坚决规避治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。

#### 3、债券投资策略

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

(2) 期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型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。

子弹组合，即使组合的现金流尽量集中分布；

杠铃组合，即使组合的现金流尽量呈两极分布；

梯形组合，即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

(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>本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。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。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、可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券兼具债券和股票的相关特性，其投资风险和收益介于债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时，本基金将首先对可转换债券自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资策略，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。</p> <p>6、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>7、权证投资策略</p> <p>本基金在中国证监会允许的范围内适度投资权证，权证投资策略主要从价值投资的角度出发，将权证作为套利和锁定风险的工具，采用包括套利投资策略、风险锁定策略和股票替代策略进行权证投资。由于权证市场的高波动性，本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险，寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。</p> <p>8、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，参与股指期货投资。本基金将通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，与现货组合进行匹配，</p>
--	---

	采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将在股指期货套期保值过程中，定期测算投资组合与股指期货的相关性，根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金运作效率，降低投资组合的整体风险。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期收益和预期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。

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄乐军	朱萍
	联系电话	021-38429808	021-31888888
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95528
传真		021-68419525	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		曾杰	张为忠

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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)	
	中海信息产业混合 A	中海信息产业混合 C
本期已实现收益	-28,540,400.34	-4,047,580.53

本期利润	-11,059,677.63	-7,567,315.43
加权平均基金份额本期利润	-0.1659	-1.2885
本期加权平均净值利润率	-19.12%	-139.71%
本期基金份额净值增长率	-14.94%	-14.98%
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	-15,682,110.76	-62,570.13
期末可供分配基金份额利润	-0.2514	-0.5326
期末基金资产净值	55,028,992.70	103,512.17
期末基金份额净值	0.8823	0.8811
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	-13.00%	-27.71%

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。

### 3.2 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

中海信息产业混合 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	7.40%	2.01%	0.94%	1.13%	6.46%	0.88%
过去三个月	1.08%	1.80%	-0.45%	1.20%	1.53%	0.60%
过去六个月	-14.94%	1.95%	-4.88%	1.54%	-10.06	0.41%

					%	
过去一年	-37.35%	1.90%	-16.64%	1.32%	-20.71%	0.58%
过去三年	-42.79%	2.04%	-24.18%	1.28%	-18.61%	0.76%
自基金合同生效起至今	-13.00%	1.94%	4.59%	1.34%	-17.59%	0.60%

中海信息产业混合 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	7.36%	2.01%	0.94%	1.13%	6.42%	0.88%
过去三个月	0.96%	1.80%	-0.45%	1.20%	1.41%	0.60%
过去六个月	-14.98%	1.96%	-4.88%	1.54%	-10.10%	0.42%
自基金合同生效起至今	-27.71%	1.87%	-15.60%	1.34%	-12.11%	0.53%

注：1. 基金管理人自 2023 年 8 月 1 日起对中海信息产业精选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。

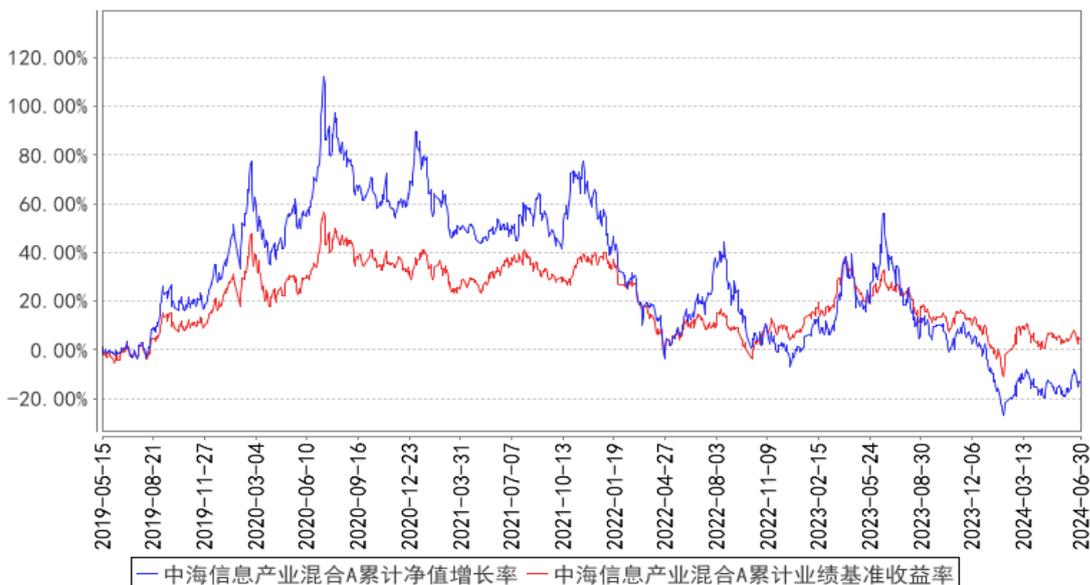
2. 中海信息产业精选混合型证券投资基金 A “自基金合同生效起至今”指 2019 年 5 月 15 日（基金转型日）至 2024 年 6 月 30 日。中海信息产业精选混合型证券投资基金 C “自基金合同生效起至今”为 2023 年 8 月 1 日（份额增加日）至 2024 年 6 月 30 日。

3. 本基金业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。本基金为混合型基金，股票投资占基金资产的比例为 50%-95%，其中投资于信息产业相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金对中证 TMT 产业主题指数和中证全债指数分别赋予 80%和 20%的权重，符合本基金的配置理念和投资特性。本基金股票部分主要投资于信息产业相关行业股票。中证 TMT 产业主题指数反映沪深 A 股上市公司中信息产业相关公司股票的表现，对信息产业相关股票具有较强的代表性。中证 TMT 产业主题指数是由中证指数有限公司编制并发布。该指数选取信息技术、电信业务以及消费电子产品、媒体中与 TMT 产业相关的代表性公司作为样本股编制而成，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。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，具有很高的代表性。综

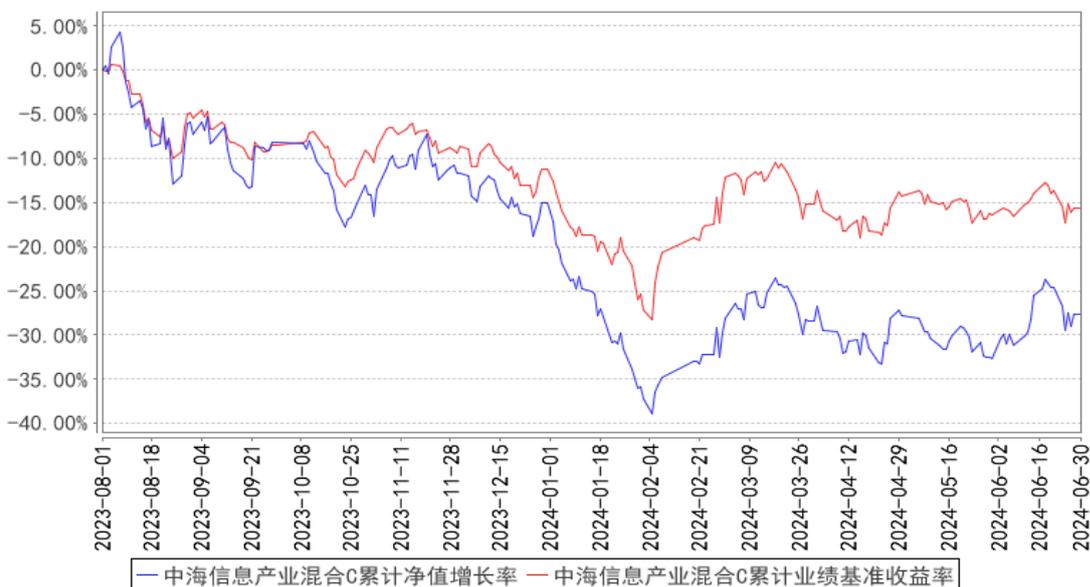
合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用中证 TMT 产业主题指数和中证全债指数收益率的加权作为本基金的投资业绩比较基准能够忠实地反应本基金的风险收益特征。

### 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

中海信息产业混合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



中海信息产业混合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 2023 年 8 月 1 日起对中海信息产业精选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. 中海信息产业精选混合型证券投资基金 C 图示日期为 2023 年 8 月 1 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		
姚晨曦	权益投资部副总经理兼权益投资副总监、本基金基金经理、中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理、中海新兴成长六个月持有期混合型证券投资基金基金经理、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金	2021 年 6 月 19 日	-	16 年	姚晨曦先生，复旦大学金融学专业硕士。曾任上海申银万国证券研究所二级分析师。2009 年 5 月进入本公司工作，历任分析师、分析师兼基金经理助理，现任权益投资部副总经理兼权益投资副总监、基金经理。2016 年 4 月至 2021 年 7 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，2015 年 4 月至今任中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至今任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至今任中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任中海新兴成长六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月至今任中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

	基金经 理、中海 积极增利 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。

#### 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

尽管在 3 月份的两会上，政府工作报告明确了全年 5% 的经济增长目标、提出发展新质生产力并推出超长期特别国债，但整个上半年的宏观经济发展依然显得较为平淡，财政刺激力度并不显著，房地产投资和基建投资相对低迷，消费复苏步伐缓慢，通缩压力始终存在，最大的亮点还是来自于出口以及由此带动的制造业投资。应该说，国内经济整体处在“固本培元”的调理阶段，上半年随着调控政策的全面放松和转向，房地产市场的风险有望逐步解除，后续还有地方政府债务问题有待去解决。

海外方面，美国经济的强势表现，以及通胀的反复，使得美联储降息时点在不断推后，但欧盟等其他发达经济体和部分发展中国家的经济放缓明显，部分国家央行已经陆续开启了降息周期。

面对纷繁复杂的全球经济环境和政策拐点，海内外资本都在市场中努力寻找确定性。美股市场是以“七姐妹”为代表的几大科技龙头一枝独秀，A 股市场则是低波红利、价值蓝筹以及部分业绩增长确定的出口板块表现突出。

本基金投资方向以“AI+大数据”为代表的新一代信息技术为主。年初，我们在配置结构上更偏重人形机器人、智能驾驶等板块，但特斯拉机器人的量产推迟以及 A 股小盘股的系统性风险使得本基金的净值受到较大冲击。经过深刻反思和策略重新梳理之后，我们及时调整了资产配置组合，将仓位重新转移至业绩增长相对明确的光模块、PCB（印制电路板）、服务器等人工智能算力产业链上。

##### 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 0.8823 元（累计净值 1.3051 元），报告期内本基金 A 类净值增长率为-14.94%，低于业绩比较基准 10.06 个百分点；本基金 C 类份额净值 0.8811 元（累计净值 0.8811 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-14.98%，低于业绩比较基准 10.10 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

展望下半年，国内外的经济和政策环境依然面临很大的不确定性。海外，美联储何时开启降息周期依然牵动市场神经，美国总统大选给明年的政策环境带来了更多变数。国内，维稳经济、深化改革依然是主基调，尤其是在三中全会召开之后，改革的陆续落地将成为市场关注的重点。就经济增长本身而言，我们更关心财税改革、地方政府债务问题如何化解，以及在此基础之上中

央和地方财政政策何时能真正发力。

就证券市场而言，我们判断，无论是国内还是海外，上半年相对极端的市場表现，在接下来可能会经历阶段性调整和再平衡的过程。但是，寻找确定性和性价比的市場主基调依然不会改变。

因此，我们的投资策略也会继续以稳为主，继续以行业中长期景气度和公司基本面业绩为准绳，保持耐心，更多专注于获取长期稳定的回报预期。行业方面，我们的配置重点依然会放在算力产业链上，同时也会密切关注其他信息产业领域是否有增长的机会，尤其是端侧 AI 的发展能否带动消费电子产业链的复苏。

#### 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

无。

## § 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中海信息产业精选混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对中海信息产业精选混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，由中海基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：中海信息产业精选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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	10,641,486.60	10,027,276.33
结算备付金		87,402.36	167,430.63
存出保证金		25,823.17	34,740.05
交易性金融资产	6.4.7.2	45,503,352.73	104,682,303.09
其中：股票投资		45,503,352.73	104,682,303.09
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,519.54	45,152.75

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		56,268,584.40	114,956,902.85
<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		-	-
应付赎回款		43,173.18	43,726.95
应付管理人报酬		55,073.08	119,196.59
应付托管费		9,178.86	19,866.11
应付销售服务费		69.05	13,897.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		882,648.36	882,648.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	145,937.00	302,556.29
负债合计		1,136,079.53	1,381,891.73
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	45,038,623.12	89,841,058.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,093,881.75	23,733,953.08
净资产合计		55,132,504.87	113,575,011.12
负债和净资产总计		56,268,584.40	114,956,902.85

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，中海信息产业混合 A 基金份额净值 0.8823 元，基金份额总额 62,371,675.10 份；中海信息产业混合 C 基金份额净值 0.8811 元，基金份额总额 117,480.21 份。中海信息产业混合基金份额总额合计为 62,489,155.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海信息产业精选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>		-18,078,505.09	31,751,304.99
1. 利息收入		15,945.72	17,515.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,945.72	17,515.88
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）		-32,094,620.00	11,085,317.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-32,424,105.10	10,863,344.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	827.53	-
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	328,657.57	221,972.73
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	13,960,987.81	20,402,690.32
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	39,181.38	245,781.13
<b>减：二、营业总支出</b>		548,487.97	871,886.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	373,830.50	677,302.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	62,305.14	112,883.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,992.73	-
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	102,359.60	81,699.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,626,993.06	30,879,418.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,626,993.06	30,879,418.76
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-18,626,993.06	30,879,418.76
----------	--	----------------	---------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中海信息产业精选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	89,841,058.04	-	23,733,953.08	113,575,011.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	89,841,058.04	-	23,733,953.08	113,575,011.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-44,802,434.92	-	-13,640,071.33	-58,442,506.25
(一)、综合收益总额	-	-	-18,626,993.06	-18,626,993.06
(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)	-44,802,434.92	-	4,986,921.73	-39,815,513.19
其中：1. 基金申购款	9,176,643.71	-	1,212,603.49	10,389,247.20
2. 基金赎回款	-53,979,078.63	-	3,774,318.24	-50,204,760.39
(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	45,038,623.12	-	10,093,881.75	55,132,504.87

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	52,703,249.81	-	19,186,741.75	71,889,991.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	52,703,249.81	-	19,186,741.75	71,889,991.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,852,248.49	-	40,589,050.96	50,441,299.45
(一)、综合收益总额	-	-	30,879,418.76	30,879,418.76
(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)	9,852,248.49	-	9,709,632.20	19,561,880.69
其中：1. 基金申购款	45,931,375.22	-	37,871,365.07	83,802,740.29
2. 基金赎回款	-36,079,126.73	-	-28,161,732.87	-64,240,859.60
(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	62,555,498.30	-	59,775,792.71	122,331,291.01

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

基金管理人负责人

李俊

主管会计工作负责人

周琳

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中海信息产业精选混合型证券投资基金（原名为“中海策略精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（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]369 号文《关于核准中海安鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中海基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 7 月 31 日正式生效，首次设立募集规模为 313,835,907.37 份基金份额，经江苏公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）苏公 W[2013]B079 号验资报告予以验证。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的保本周期每 2 年为一个周期。本基金的第一个保本周期为两年，自 2013 年 7 月 31 日开始至 2015 年 7 月 31 日止。第一个保本周期届满时，如符合保本基金存续条件，本基金进入下一保本周期。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期转入第二个保本周期的过渡期折算结果的公告》和《关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期的相关规则公告》，本基金将在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期，过渡期时间自 2015 年 8 月 8 日（含）至 2015 年 9 月 7 日（含）。过渡期最后一个工作日（即下一保本周期起始日前一工作日）为基金份额折算日。折算后基金份额净值调整为 1.00 元。经本基金管理人计算，并经本基金的基金托管人复核，2015 年 9 月 7 日本基金折算前的基金份额净值为 1.388 元，依据前述折算规则确定的折算比例为 1.388079651。折算后本基金的总份额由 486,047,922.07 份调整为 674,673,229.98 份。折算日的下一个工作日为下一保本周期起始日，保本周期两年，第二个保本周期自 2015 年 9 月 8 日至 2017 年 9 月 8 日，如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

根据《中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的规定和《中海基金管理有限公司关于中海安鑫保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金转型运作后相关业务规则的公告》，本基金在第二个保本周期届满时，由于本基金不再符合保本基金存续条件，因此按照本基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”。同时，本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日（含第 5 个工作日），即 2017 年 9 月 8 日至 2017 年 9 月 15 日。在本基金到期操作期间截止日次日，即 2017 年 9 月 16 日起“中海安鑫保本混合型证券投资基金”转型为“中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金”，《中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金存续

期限不定，本基金的基金管理人和注册登记机构为中海基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中海信息产业精选混合型证券投资基金基金合同》的规定和《关于中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 5 月 15 日表决通过了《关于中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金转型相关事项的议案》，决议自该日起生效，中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金转型为中海信息产业精选混合型证券投资基金。

根据基金管理人 2023 年 7 月 29 日发布的《关于旗下中海信息产业精选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》，经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 8 月 1 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。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

#### 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。

### 6.4.7 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	10,641,486.60
等于：本金	10,640,789.45
加：应计利息	697.15
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	10,641,486.60

#### 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	38,392,763.07	-	45,503,352.73	7,110,589.66
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	38,392,763.07	-	45,503,352.73	7,110,589.66

#### 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	40.89
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	54,546.87
其中：交易所市场	54,546.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,349.24
合计	145,937.00

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中海信息产业混合 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	70,361,117.36	50,675,241.78
本期申购	10,311,253.99	7,426,404.17
本期赎回（以“-”号填列）	-18,300,696.25	-13,180,503.04
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	62,371,675.10	44,921,142.91

中海信息产业混合 C

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	39,165,816.26	39,165,816.26
本期申购	1,750,239.54	1,750,239.54
本期赎回(以“-”号填列)	-40,798,575.59	-40,798,575.59
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	117,480.21	117,480.21

注：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。

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

中海信息产业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,127,941.11	10,182,875.36	22,310,816.47
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,127,941.11	10,182,875.36	22,310,816.47
本期利润	-28,540,400.34	17,480,722.71	-11,059,677.63
本期基金份额交易产生的变动数	730,348.47	-1,873,637.52	-1,143,289.05
其中：基金申购款	-1,521,272.65	2,969,228.38	1,447,955.73
基金赎回款	2,251,621.12	-4,842,865.90	-2,591,244.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,682,110.76	25,789,960.55	10,107,849.79

中海信息产业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,244,479.44	5,667,616.05	1,423,136.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-4,244,479.44	5,667,616.05	1,423,136.61
本期利润	-4,047,580.53	-3,519,734.90	-7,567,315.43
本期基金份额交易产生的变动数	8,229,489.84	-2,099,279.06	6,130,210.78
其中：基金申购款	-815,411.80	580,059.56	-235,352.24
基金赎回款	9,044,901.64	-2,679,338.62	6,365,563.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-62,570.13	48,602.09	-13,968.04

#### 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		14,532.51
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		1,146.30
其他		266.91
合计		15,945.72

#### 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		-32,424,105.10
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		-32,424,105.10

##### 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		132,340,142.94
减：卖出股票成本总额		164,516,864.25
减：交易费用		247,383.79
买卖股票差价收入		-32,424,105.10

##### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	825.96
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	827.53

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	161,366.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,386.70
减：应计利息总额	141.15
减：交易费用	12.89
买卖债券差价收入	825.96

##### 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	328,657.57
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	328,657.57

#### 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	13,960,987.81
股票投资	13,960,987.81
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	13,960,987.81

#### 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	38,290.94
基金转换费收入	890.44
合计	39,181.38

#### 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	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,710.36
账户维护费	18,600.00
合计	102,359.60

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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	373,830.50	677,302.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	144,581.06	242,857.16
应支付基金管理人的净管理费	229,249.44	434,445.51

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：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

2. 2023 年 8 月 24 日起管理费由 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 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托管费	62,305.14	112,883.85

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：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

2. 2023 年 8 月 24 日起托管费率由 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		
	中海信息产业混合 A	中海信息产业混合 C	合计
中海基金	-	9,474.10	9,474.10
浦发银行	-	-	-
国联证券	-	-	-
合计	-	9,474.10	9,474.10
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		
	中海信息产业混合 A	中海信息产业混合 C	合计
中海基金	-	-	-
浦发银行	-	-	-
国联证券	-	-	-
合计	-	-	-

注：根据基金管理人 2023 年 7 月 29 日发布的《关于旗下中海信息产业精选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》，中海信息产业精选混合型证券投资基金自 2023 年 8 月 1 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固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固有资金投资本基金。

#### 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
浦发银行	10,641,486.60	14,532.51	14,785,182.13	15,230.21

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年半年度获得的利息收入为人民币1,146.30元（2023年半年度：人民币2,037.39元），2024年6月30日结算备付金余额为人民币87,402.36元（2023年半年末：人民币182,234.20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
资产							

货币资金	10,641,486.60	-	-	-	-	-	10,641,486.60
结算备付金	87,402.36	-	-	-	-	-	87,402.36
存出保证金	25,823.17	-	-	-	-	-	25,823.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	45,503,352.73	45,503,352.73
应收申购款	-	-	-	-	-	10,519.54	10,519.54
资产总计	10,754,712.13	-	-	-	-	45,513,872.27	56,268,584.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	43,173.18	43,173.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	55,073.08	55,073.08
应付托管费	-	-	-	-	-	9,178.86	9,178.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69.05	69.05
应交税费	-	-	-	-	-	882,648.36	882,648.36
其他负债	-	-	-	-	-	145,937.00	145,937.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,136,079.53	1,136,079.53
利率敏感度缺口	10,754,712.13	-	-	-	-	44,377,792.74	55,132,504.87
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	10,027,276.33	-	-	-	-	-	10,027,276.33
结算备付金	167,430.63	-	-	-	-	-	167,430.63
存出保证金	34,740.05	-	-	-	-	-	34,740.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	104,682,303.09	104,682,303.09
应收申购款	-	-	-	-	-	45,152.75	45,152.75
资产总计	10,229,447.01	-	-	-	-	104,727,455.84	114,956,902.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	43,726.95	43,726.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,196.59	119,196.59
应付托管费	-	-	-	-	-	19,866.11	19,866.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,897.47	13,897.47
应交税费	-	-	-	-	-	882,648.32	882,648.32
其他负债	-	-	-	-	-	302,556.29	302,556.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,381,891.73	1,381,891.73
利率敏感度缺口	10,229,447.01	-	-	-	-	103,345,564.11	113,575,011.12

#### 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，因此无重大外汇风险。

### 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。

本基金通过多种投资策略，在控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值，回报投资人。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 50%-95%，其中投资于信息产业相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、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	45,503,352.73	82.53	104,682,303.09	92.17
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	45,503,352.73	82.53	104,682,303.09	92.17

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 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 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%	4,797,227.53	6,212,327.22
	-5%	-4,797,227.53	-6,212,327.22

#### 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 (%)	3.2	3.12
	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	45,503,352.73	104,682,303.09
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	45,503,352.73	104,682,303.09

##### 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	45,503,352.73	80.87
	其中：股票	45,503,352.73	80.87
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	10,728,888.96	19.07
8	其他各项资产	36,342.71	0.06
9	合计	56,268,584.40	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	42,016,567.02	76.21
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	3,486,785.71	6.32
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	45,503,352.73	82.53

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	300308	中际旭创	27,800	3,833,064.00	6.95
2	601138	工业富联	135,000	3,699,000.00	6.71
3	002916	深南电路	33,900	3,585,603.00	6.50
4	002463	沪电股份	92,000	3,358,000.00	6.09
5	300502	新易盛	31,300	3,303,715.00	5.99
6	300476	胜宏科技	96,200	3,103,412.00	5.63
7	688008	澜起科技	54,275	3,102,359.00	5.63
8	688183	生益电子	130,369	2,526,551.22	4.58
9	002371	北方华创	6,800	2,175,252.00	3.95
10	300394	天孚通信	23,100	2,042,502.00	3.70
11	688525	佰维存储	31,836	2,042,279.40	3.70
12	688256	寒武纪	9,363	1,860,147.21	3.37
13	301308	江波龙	17,500	1,657,950.00	3.01
14	603283	赛腾股份	20,800	1,589,120.00	2.88
15	002130	沃尔核材	108,300	1,529,196.00	2.77
16	688702	盛科通信	37,277	1,509,718.50	2.74
17	603986	兆易创新	12,600	1,204,812.00	2.19
18	001309	德明利	13,000	1,123,200.00	2.04
19	000938	紫光股份	48,704	1,088,534.40	1.97
20	688027	国盾量子	6,967	1,052,017.00	1.91
21	300017	网宿科技	14,800	116,920.00	0.21

## 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	601138	工业富联	4,630,761.00	4.08
2	600941	中国移动	3,175,282.00	2.80
3	600050	中国联通	3,088,239.00	2.72
4	300502	新易盛	3,054,044.00	2.69
5	601728	中国电信	3,051,753.00	2.69
6	300394	天孚通信	2,860,775.00	2.52
7	688008	澜起科技	2,829,039.48	2.49
8	002463	沪电股份	2,799,387.00	2.46
9	300308	中际旭创	2,663,041.00	2.34
10	000938	紫光股份	2,504,640.00	2.21
11	301236	软通动力	2,500,226.00	2.20
12	300017	网宿科技	2,457,482.00	2.16
13	688525	佰维存储	2,329,680.85	2.05

14	300476	胜宏科技	2,251,440.00	1.98
15	600363	联创光电	2,230,490.00	1.96
16	002371	北方华创	2,174,212.00	1.91
17	002916	深南电路	2,127,610.00	1.87
18	688183	生益电子	2,071,678.61	1.82
19	600602	云赛智联	1,980,492.34	1.74
20	000628	高新发展	1,913,862.00	1.69

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	002156	通富微电	4,378,560.00	3.86
2	601100	恒立液压	4,131,560.00	3.64
3	002050	三花智控	3,721,109.00	3.28
4	300124	汇川技术	3,603,581.03	3.17
5	002436	兴森科技	3,244,979.00	2.86
6	600941	中国移动	3,078,908.00	2.71
7	600050	中国联通	3,005,215.00	2.65
8	601728	中国电信	2,982,538.00	2.63
9	688322	奥比中光	2,888,196.55	2.54
10	002472	双环传动	2,744,548.90	2.42
11	300308	中际旭创	2,518,845.00	2.22
12	300354	东华测试	2,483,870.00	2.19
13	301236	软通动力	2,420,042.00	2.13
14	300017	网宿科技	2,299,794.00	2.02
15	688409	富创精密	2,294,166.47	2.02
16	688981	中芯国际	2,158,808.19	1.90
17	688259	创耀科技	2,147,081.76	1.89
18	300580	贝斯特	2,134,584.00	1.88
19	688525	佰维存储	2,073,937.62	1.83
20	688685	迈信林	2,032,616.74	1.79

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	91,376,926.08
卖出股票收入（成交）总额	132,340,142.94

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

本基金本报告期末参与股指期货交易。

### 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。

#### 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	25,823.17
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	10,519.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,342.71

#### 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 (%)
中海信息产业混合 A	9,162	6,807.65	196,348.59	0.31	62,175,326.51	99.69
中海信息产业混合 C	100	1,174.80	0.00	0.00	117,480.21	100.00
合计	9,262	6,746.83	196,348.59	0.31	62,292,806.72	99.69

### 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	中海信息产业混合 A	129,405.44	0.2075
	中海信息产业混合 C	0.00	0.0000
	合计	129,405.44	0.2071

### 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	中海信息产业混合 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中海信息产业混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中海信息产业混合 A	0~10
	中海信息产业混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海信息产业混合 A	中海信息产业混合 C
基金合同生效日 (2019 年 5 月 15 日) 基金份额总额	36,373,141.92	-
本报告期期初基金份额总额	70,361,117.36	39,165,816.26
本报告期基金总申购份额	10,311,253.99	1,750,239.54
减：本报告期基金总赎回份额	18,300,696.25	40,798,575.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	62,371,675.10	117,480.21

注：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。

## § 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，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 02 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：报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员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 (%)	
上海证券	2	117,629,998.54	52.58	87,739.83	52.58	-
东北证券	1	53,911,770.98	24.10	40,213.02	24.10	-
广发证券	2	23,444,997.27	10.48	17,487.67	10.48	-
华宝证券	1	13,084,908.27	5.85	9,760.11	5.85	-
方正证券	2	8,962,889.96	4.01	6,685.56	4.01	-

海通证券	1	6,682,504.00	2.99	4,984.49	2.99	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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；退租了天风证券的上海交易单元。

### 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 (%)
上海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	321,892.94	100.00	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中海信息产业精选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	中海基金管理有限公司关于旗下基金	报刊及规定网站	2024-1-17

	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		
3	中海信息产业精选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-1-22
4	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
5	中海信息产业精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	规定网站	2024-3-29
6	中海信息产业精选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-4-22
7	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
8	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
9	中海信息产业精选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	2024-6-27
10	中海信息产业精选混合型证券投资基金（C 类份额）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

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	2024-01-01 至 2024-01-23	38,938,652.76	0.00	38,938,652.76	0.00	0.00
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 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。							
2、巨额赎回的风险							

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，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额。

### 3、基金规模较小导致的风险

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。

### 4、基金净值大幅波动的风险

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。

### 5、提前终止基金合同的风险

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。

## § 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安鑫保本混合型证券投资基金的文件
- 2、中海安鑫保本混合型证券投资基金基金合同、中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同、中海信息产业精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海安鑫保本混合型证券投资基金托管协议、中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议、中海信息产业精选混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海安鑫保本混合型证券投资基金财务报表及报表附注、中海策略精选灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注、中海信息产业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

### 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