

中海海誉混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日至 9 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中海海誉混合
基金主代码	011514
交易代码	011514
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 15 日
报告期末基金份额总额	177,450,354.45 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
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>在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、具有核心竞争优势的上市公司进行投资。其间，本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。</p> <p>（1）定量分析</p> <p>本基金通过综合考察上市公司的财务优势、估值优势和成长优势来进行个股的筛选。</p> <p>本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。</p> <p>本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市净</p>

	<p>率和市销率。</p> <p>本基金考察的成长指标主要包括：营业收入增长率、净利润增长率。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的经营情况，重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势、经营稳健的公司，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>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>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。</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>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。</p> <p>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。</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>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。</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）信用债投资策略</p> <p>本基金将在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，精选预期风险可控、收益率较高的债券，结合适度分散的行业配置策略，构造和优化债券投资组合，为投资人获取较高的投资收益。</p> <p>本基金所投资的信用债的信用评级不得低于 AA+。其中本基金投资于 AA+ 的信用债占本基金投资信用债资产的比例为 0-50%；投资于 AAA 的信用债占本基金投资信用债资产的比例为 50-100%。</p> <p>为控制本基金的信用风险，本基金将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。</p> <p>（5）可转换债券以及可交换债券投资策略</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>可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析，综合开展投资决策。</p> <p>本基金投资于可转换债券和可交换债券比例合计不超过基金资产的 20%。</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</p>
--	---

	<p>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、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，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。</p> <p>6、同业存单投资策略</p> <p>本基金根据对存单发行银行的信用资质和存单流动性进行分析，严控信用风险底线的前提下，根据信用资质、流动性、收益率的综合考虑，选择具有良好投资价值的存单品种进行投资。信用资质分析，采用外部评级机构和内部评级相结合的方式，对信用风险进行审慎甄别。本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的 20%。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×80%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中海海誉混合 A	中海海誉混合 C
下属分级基金的交易代码	011514	011515
报告期末下属分级基金的份额总额	169,516,279.98 份	7,934,074.47 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）	
	中海海誉混合 A	中海海誉混合 C
1. 本期已实现收益	-2,583,977.73	-659,512.75
2. 本期利润	-2,701,119.17	-784,054.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0143	-0.0180
4. 期末基金资产净值	167,802,084.84	7,831,688.46
5. 期末基金份额净值	0.9899	0.9871

注：1：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

中海海誉混合 A

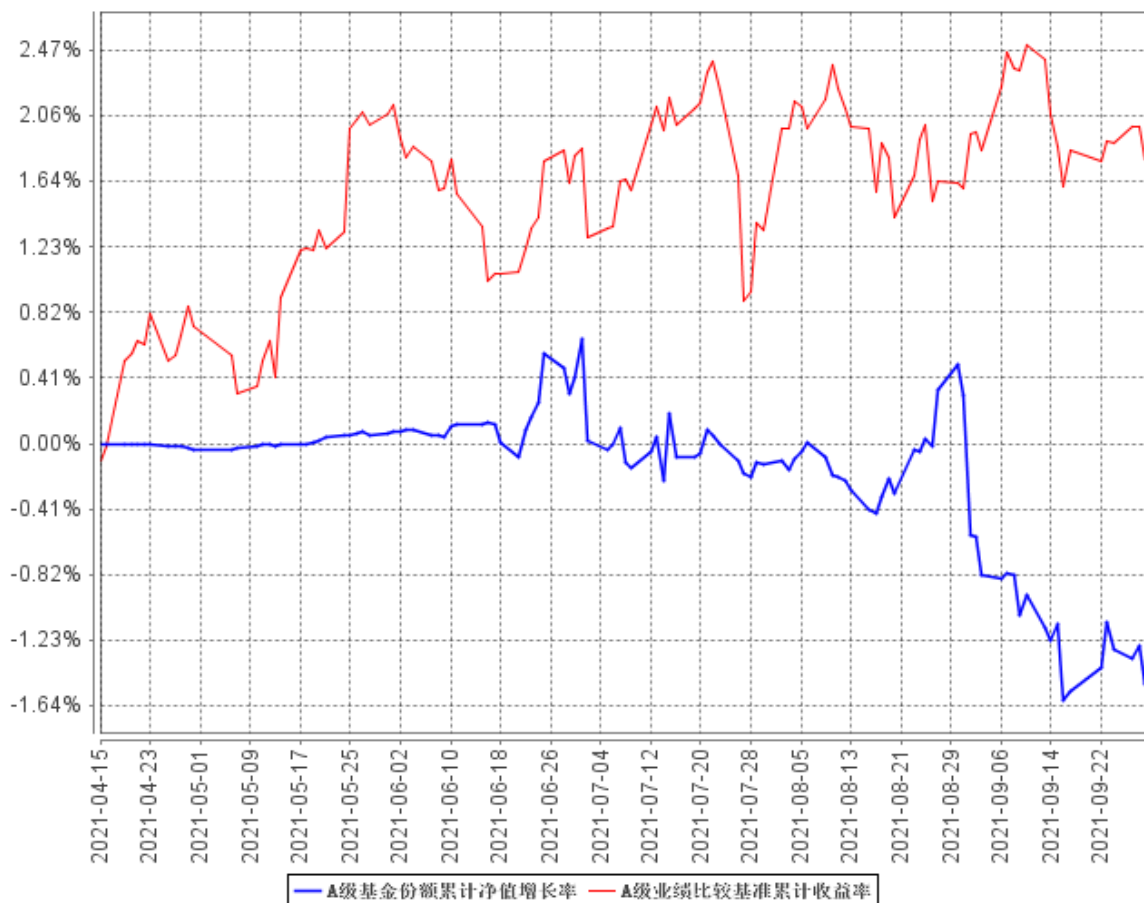
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去3个月	-1.42%	0.21%	0.14%	0.25%	-1.56%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.01%	0.17%	1.94%	0.23%	-2.95%	-0.06%

中海海誉混合 C

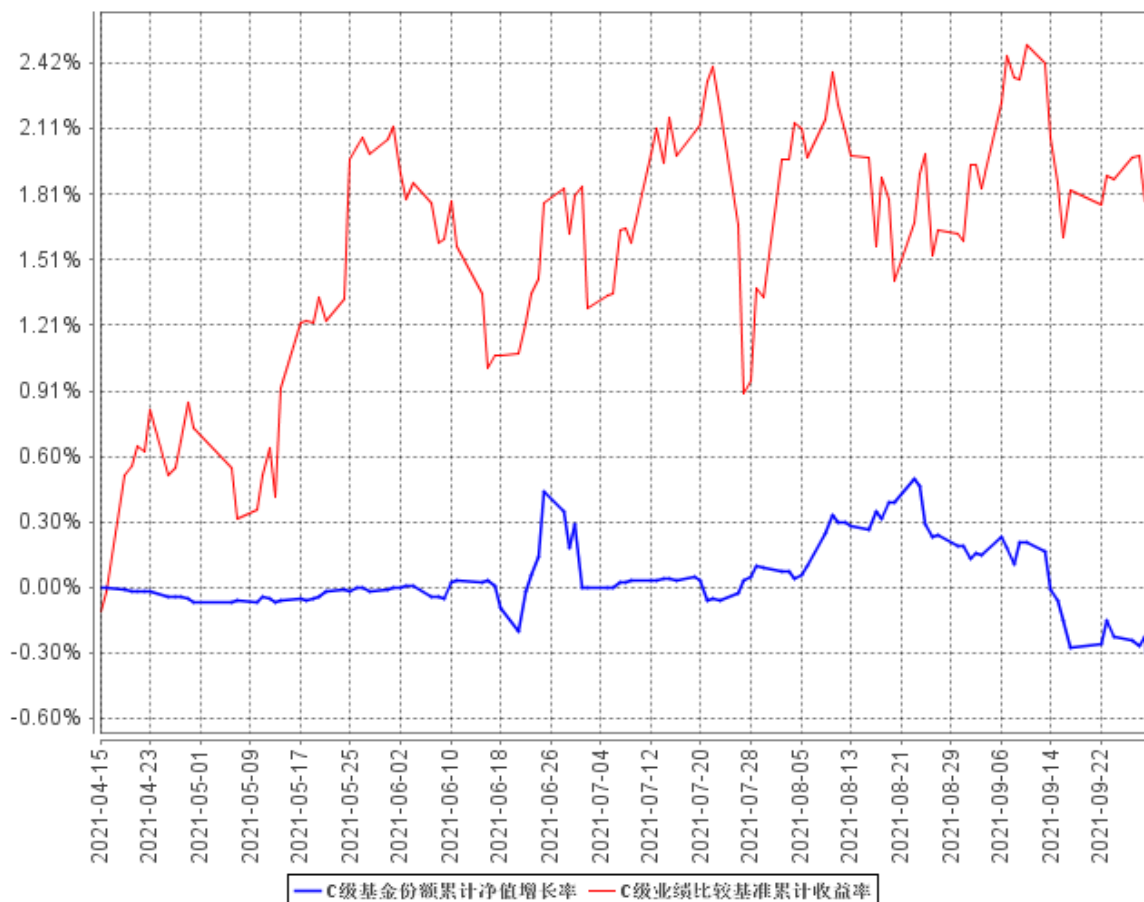
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去3个月	-1.58%	0.21%	0.14%	0.25%	-1.72%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.29%	0.17%	1.94%	0.23%	-3.23%	-0.06%

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

A级基金份额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



C级基金份额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：按相关法规规定，本基金自基金合同 2021 年 4 月 15 日生效日起 6 个月内为建仓期，至报告期末尚处于建仓期。

注 2：本基金合同生效日 2021 年 4 月 15 日起至披露时点不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘俊	本基金基金经理	2021 年 4 月 15 日	2021 年 7 月 30 日	18 年	刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007 年 3 月进入本公司工作，曾任产品开发总监、权

					<p>益投资部权益投资副总监。</p> <p>2010 年 3 月至 2015 年 8 月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2017 年 6 月任中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金基金经理，2012 年 6 月至 2019 年 4 月任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2021 年 2 月任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018 年 1 月至 2021 年 2 月任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2021 年 6 月任中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月至 2021 年 7 月任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 12 月至 2021 年 7 月任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018 年 6 月至 2021 年 7 月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，2020 年 5 月至 2021 年 7 月任中海医疗保健主题股票型证券投资基金基金经理，2021 年 4 月至 2021 年 7 月任中海海誉混合型证券投资基金基金经理。</p>
邱红丽	研究部 总经理、 本基金 经理、中海 蓝筹灵 活配置 混合型 证券投 资基金	2021 年 7 月 30 日	-	11 年	<p>邱红丽女士，英国纽卡斯尔大学跨文化交流与国际管理专业硕士。历任大连龙日本制品有限公司会计，交通银行大连开发区分行会计主管，上海康时信息系统有限公司财务总监，尊龙实业（香港）有限公司财务总监。2009 年 4 月进入我公司工作，历任定量财务分析</p>

	基金经 理、中海 分红增 利混合 型证券 投资基 金基金 经理、中 海积极 收益灵 活配置 混合型 证券投 资基金 基金经 理、中海 顺鑫灵 活配置 混合型 证券投 资基金 基金经 理			师、分析师、高级分析师、 高级分析师兼基金经理助理、 研究副总监、研究部副 总经理，现任研究部总经 理。2015 年 11 月至 2021 年 7 月任中海混改红利主题精 选灵活配置混合型证券投资 基金基金经理，2014 年 3 月至今任中海蓝筹灵活配 置混合型证券投资基金基金 经理，2014 年 11 月至今 任中海分红增利混合型证 券投资基金基金经理，2021 年 7 月至今任中海积极收 益灵活配置混合型证券投资 基金基金经理，2021 年 7 月 至今任中海顺鑫灵活配置 混合型证券投资基金基金 经理，2021 年 7 月至今任中 海海誉混合型证券投资基 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。

注 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司

制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年第 3 季度，海外疫情反弹，全球经济增速放缓，国别差异仍较显著，疫情对消费领域冲击依旧较强；美国就业遭受的冲击逐步弱化，美联储货币政策转向风险抬升，欧元区开启货币正常化，欧洲央行仍将维持宽松基调；欧美货币政策正常化的力度将保持和缓，但是对边际变化对市场情绪带来的冲击需保持警惕。日本经济复苏动力不足，奥运经济收益低于预期，形成巨额赤字；新兴经济体保持复苏。

三季度国内疫情反复，经济仍在修复。7 月份，投资、消费、生产三项数据增速均出现明显下行，国内汛情叠加疫情影响对消费产生扰动，楼市调控政策升级，地产投资增速持续回落，工业生产增速持续小幅回落，延续淡季走势。8 月份经济增速继续回落，除基数效应外，点状疫情的冲击进一步显现；在供需两端增长双双放缓的过程中，社零增速超预期下滑，净出口对国内经济增长将呈现为负向拉动，基建投资受洪涝灾害后赶工影响有所修复，投资有望得益于基建补位而企稳回升。

货币政策方面，7 月降准之后，央行并未如市场预期一样在短期内进一步释放宽松的信号，央行官员亦多次表示本次降准是“货币政策回归常态后的常规流动性操作，稳健货币政策取向并未发生改变”，央行货币政策整体维持中性，9 月重启 14 天逆回购，维护季末流动性平稳。三季

度央行货币政策委员会例会纪要公布，强调货币政策保持流动性合理充裕，增强信贷总量增长的稳定性。

债券市场方面，债券收益率大幅下行。7月初国常会提及降准之后，债券收益率迅速下行，10年期国债收益率下行 20BP 至 2.88%，收益率绝对水平回落至历史地位；曲线整体呈现牛平趋势，长短端收益率走势分化明显，长端利率快速下行后窄幅震荡，短端下行后有所回调，1年期国债收益率已回到降准前水平，流动性没有明显转松。信用风险方面，地产债悲观情绪蔓延，政策持续趋严，房地产行业信用风险持续发酵，个别房企债务危机持续暴露，须继续关注并保持谨慎。信用利差略微走阔，市场对城投债仍较为青睐，但尾部信用瑕疵频发，对敏感地区仍需保持谨慎。

权益市场方面，A 股指数呈现区间宽幅震荡的走势。期间市场投资风险偏好总体趋于稳定。3 季度创业板指的表现整体好于沪深 300 指数。表现相对比较好的行业是周期类行业；表现相对较差的行业是消费类行业，市场整体呈现非常明显的结构性行情。

回顾整个 3 季度，季度内权益资产主要配置消费、医药、新能源、半导体等行业优质龙头公司。债券资产主要配置利率债和高等级信用债。

3 季度操作上基本延续我们 2 季度的操作思路和结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值 0.9899 元（累计净值 0.9899 元），报告期内本基金 A 类净值增长率为-1.42%，低于业绩比较基准 1.56 个百分点；本基金 C 类份额净值 0.9871 元（累计净值 0.9871 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-1.58%，低于业绩比较基准 1.72 个百分点。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,229,729.00	9.79
	其中：股票	17,229,729.00	9.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,459,326.40	65.01
	其中：债券	114,459,326.40	65.01
	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	42,615,463.29	24.20
8	其他资产	1,772,547.78	1.01
9	合计	176,077,066.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,463,866.00	7.10
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	3,700,288.00	2.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	524,550.00	0.30
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	541,025.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,229,729.00	9.81

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600570	恒生电子	64,600	3,700,288.00	2.11

2	002472	双环传动	145,900	3,427,191.00	1.95
3	603690	至纯科技	61,700	2,997,386.00	1.71
4	002049	紫光国微	8,800	1,819,840.00	1.04
5	000661	长春高新	2,000	549,320.00	0.31
6	600519	贵州茅台	300	549,000.00	0.31
7	000516	国际医学	47,500	541,025.00	0.31
8	688037	芯源微	2,180	532,138.00	0.30
9	000568	泸州老窖	2,400	531,792.00	0.30
10	603290	斯达半导	1,300	529,906.00	0.30

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金在本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	64,782,062.70	36.88
	其中：政策性金融债	64,782,062.70	36.88
4	企业债券	29,644,387.70	16.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,316,876.00	5.87
8	同业存单	9,716,000.00	5.53
9	其他	-	-
10	合计	114,459,326.40	65.17

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108803	进出 2102	639,750	64,365,247.50	36.65
2	163847	20 银河 S3	165,290	16,550,487.70	9.42
3	132015	18 中油 EB	98,100	10,281,861.00	5.85
4	112184446	21 常熟农村商业银行 CD040	100,000	9,716,000.00	5.53
5	175282	20 华鑫 03	50,000	5,053,500.00	2.88

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,629.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,744,933.90
5	应收申购款	984.05
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,772,547.78

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18 中油 EB	10,281,861.00	5.85

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海海誉混合 A	中海海誉混合 C
报告期期初基金份额总额	208,406,695.57	92,038,388.92
报告期期间基金总申购份额	638,140.41	820,436.66
减：报告期期间基金总赎回份额	39,528,556.00	84,924,751.11

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	169,516,279.98	7,934,074.47

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

8.3 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

2021 年 10 月 27 日