

中海增强收益债券型证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中海增强收益债券 |
| 基金主代码 | 395011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 3 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 232,545,841.02 份 |
| 投资目标 | 在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定收益。 |
| 投资策略 | 1、一级资产配置 本基金采取自上而下的分析方法，比较不同市场和金融工具的收益及风险特征，动态确定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。 2、纯债投资策略 （1）久期配置：基于宏观经济周期的变化趋势，预测利率变动的方向。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，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，确定投资组合的久期配置。 （2）期限结构配置：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，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。 （3）债券类别配置/个券选择：个券选择遵循的原则包括：相对价值原则即同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低品种。流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。 （4）其它交易策略：包括短期资金运用和跨市场套利等。 3、可转换债券投资策略 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；最后确定可投资的品种。 4、股票投资策略 本基金股票二级市场投资采用红利精选投资策略，通过运用分红模型和分红潜力模型，精选出现金股息率高、分红潜力强并具有成长性的优质上市公司，结合投研团队的综合判断，构造股票投资组合。 5、权证投资策略 本基金在证监会允许的范围内适度投资权证，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权证进行适量配置。 | |
| 业绩比较基准 | 中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10% | |
| 风险收益特征 | 本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。 本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 中海基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中海增强收益债券 A | 中海增强收益债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 395011 | 395012 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 210,312,893.04 份 | 22,232,947.98 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 中海增强收益债券 A | 中海增强收益债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 609,935.53 | 46,230.95 |
| 2. 本期利润 | -404,241.44 | -28,673.55 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0032 | -0.0022 |
| 4. 期末基金资产净值 | 248,110,466.86 | 25,194,238.25 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.180 | 1.133 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中海增强收益债券 A

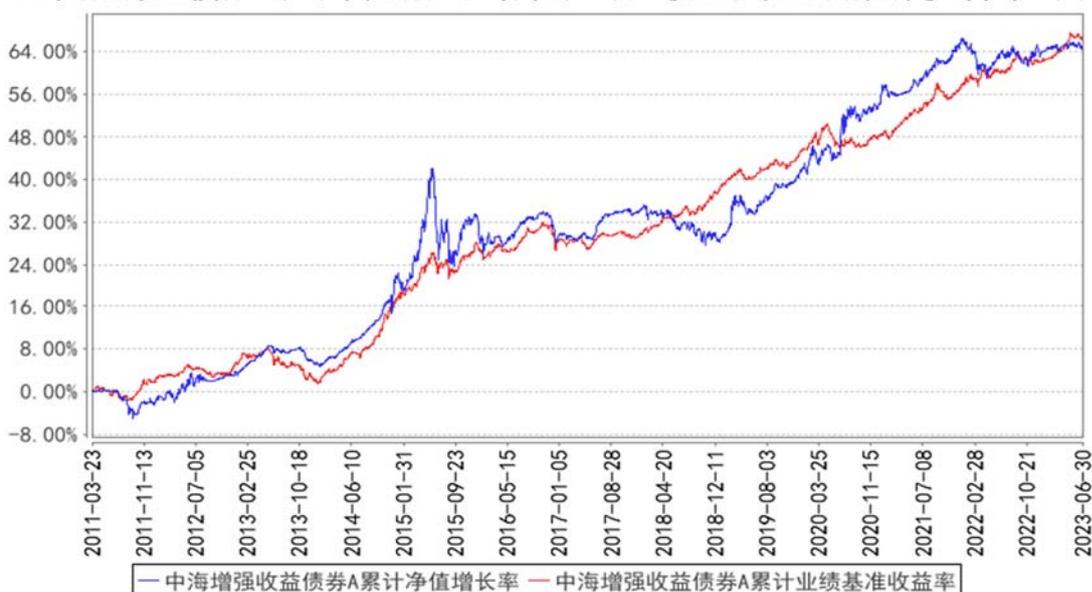
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.17% | 0.12% | 1.57% | 0.11% | -1.40% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.74% | 0.11% | 2.83% | 0.09% | -2.09% | 0.02% |
| 过去一年 | 0.66% | 0.16% | 4.00% | 0.11% | -3.34% | 0.05% |
| 过去三年 | 13.76% | 0.23% | 13.70% | 0.13% | 0.06% | 0.10% |
| 过去五年 | 26.07% | 0.24% | 24.95% | 0.13% | 1.12% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 65.04% | 0.29% | 66.82% | 0.16% | -1.78% | 0.13% |

中海增强收益债券 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -0.17% | 0.13% | 1.57% | 0.11% | -1.74% | 0.02% |
| 过去六个月 | 0.25% | 0.12% | 2.83% | 0.09% | -2.58% | 0.03% |
| 过去一年 | 0.01% | 0.16% | 4.00% | 0.11% | -3.99% | 0.05% |
| 过去三年 | 11.97% | 0.23% | 13.70% | 0.13% | -1.73% | 0.10% |
| 过去五年 | 23.22% | 0.24% | 24.95% | 0.13% | -1.73% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 55.55% | 0.29% | 66.82% | 0.16% | -11.27% | 0.13% |

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

中海增强收益债券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



中海增强收益债券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



§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 | | |
| 殷婧 | 本基金基金经理 | 2021年11月5日 | - | 10年 | 殷婧女士, 厦门大学应用经济学(保险学)专业硕士, 中级经济师。历任华宝证券股份有限公司资产管理部投资助理、交易主管、固定收益投资经理。2021年9月进入本公司工作, 现任基金经理。2021年11月至今任中海增强收益债券型证券投资 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|----------|
| | | | | | 资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------|

注：

- 1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
- 2：证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

海外方面，二季度较之一季度发生的主要变化在于美国区域性银行风波逐步平息、债务上限达成协议，同时，6月美联储暂缓加息，布林肯顺利访华。虽然美联储持续了1年多的货币紧缩政策，但美经济在温和放缓中具有韧性，尤其是就业、零售销售等硬数据都有较好表现，通胀也在基数效应下持续回落。6月最新披露的美联储利率点阵图表明未来还可能进行2次25个基点的加息，未来可能的紧缩节奏取决于经济数据的表现，这是需要密切关注的。

国内方面，二季度经济修复动能并没有如一季度预期的那么强烈，消费、生产等主要经济指标剔除基数效应的两年复合增速出现回落，经济修复斜率放缓。物价方面，供需错位下CPI同比低位运行，居民消费延续服务和小额消费有韧性、大额消费偏弱的结构特征，而需求不足、企业主动去库扰动下，PPI的同比降幅持续扩大。

宏观政策方面，4月政治局会议定调政策以稳为主，4月、5月政策定力较强，财政政策力度有所退坡。进入6月，经济复苏动能仍显乏力，外需承压、内需不足的压力进一步显现，市场对政策层面的期待开始升温，6月中旬央行率先下调政策利率，以加强逆周期调节。此外，二季度汇率压力较大，人民币持续贬值一度接近7.3关口，央行在二季度货币政策委员会例会中提到“坚决防范汇率大起大落风险”，这意味着后续央行有信心、也有能力防范汇率过快贬值，保持汇率在合理均衡水平上基本稳定。

债券市场方面，二季度债市呈现牛市行情，收益率震荡下行。4月和5月债市主线从“强现实、弱预期”切换为“弱现实、弱预期”，在经济复苏和政策力度均低于预期的背景下，叠加流动性宽松、资金利率中枢下移，债券收益率开启单边下行行情。6月“弱预期”边际上有所修复，市场关注点转向7月政治局会议，6月中旬央行降息打破窄幅震荡行情，10年国债新券收益率最低下探至2.6%关口，降息后市场开始担忧宽信用政策的冲击，且前期获利盘存在止盈需求，债券收益率从低位快速反弹，此后维持偏强震荡行情。

权益市场方面，二季度延续一季度缺乏主线下的快速轮动行情。4月初在人工智能概念带动下叠加PMI、出口、社融等经济、金融数据改善，A股市场出现了一定的回暖。4月底至整个5月，弱现实弱预期的环境下，权益市场震荡下行，6月份，上证指数下探至年初水平，权益性价比回升，同时市场对于稳增长政策预期逐渐积累，地产、大金融板块有所回暖。经济弱复苏背景下，行业分化较为明显，有独立景气度的通信、汽车、公用事业等涨幅居前，而消费、地产等复苏链普遍较弱。

报告期内本基金规模小幅增长，组合增加了权益类资产的配置，看好权益资产当前阶段的配置价值，看好下半年经济自身动能的修复。纯债配置以利率债和高等级信用债为主，严控信用风

险，组合整体久期偏短。可转债方面，转股溢价率整体偏高，保持兼顾个股基本面和转债性价比的持仓配置。权益方面，除继续持有低估值偏复苏预期的消费、地产、大金融板块外，增配了汽车、公用事业、电子等板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 1.180 元(累计净值 1.580 元)，报告期内本基金 A 类净值增长率为 0.17%，低于业绩比较基准 1.40 个百分点；本基金 C 类份额净值 1.133 元（累计净值 1.503 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-0.17%，低于业绩比较基准 1.74 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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 | 49,939,518.00 | 18.24 |
| | 其中：股票 | 49,939,518.00 | 18.24 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 222,642,108.87 | 81.30 |
| | 其中：债券 | 222,642,108.87 | 81.30 |
| | 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 | -105.70 | -0.00 |
| | 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 | 876,077.92 | 0.32 |
| 8 | 其他资产 | 407,591.26 | 0.15 |
| 9 | 合计 | 273,865,190.35 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 1,802,015.00 | 0.66 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 26,384,652.00 | 9.65 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | 4,705,083.00 | 1.72 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| | 业 | | |
| E | 建筑业 | 1,745,600.00 | 0.64 |
| F | 批发和零售业 | 1,506,799.00 | 0.55 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 1,740,174.00 | 0.64 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 6,929,647.00 | 2.54 |
| K | 房地产业 | 2,254,416.00 | 0.82 |
| 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 | 391,375.00 | 0.14 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,637,757.00 | 0.60 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 842,000.00 | 0.31 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 49,939,518.00 | 18.27 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 | 600030 | 中信证券 | 140,000 | 2,769,200.00 | 1.01 |
| 2 | 000002 | 万科 A | 160,800 | 2,254,416.00 | 0.82 |
| 3 | 601985 | 中国核电 | 315,100 | 2,221,455.00 | 0.81 |
| 4 | 000786 | 北新建材 | 90,000 | 2,205,900.00 | 0.81 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 18,800 | 2,192,644.00 | 0.80 |
| 6 | 600104 | 上汽集团 | 153,300 | 2,172,261.00 | 0.79 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 13,200 | 2,159,124.00 | 0.79 |
| 8 | 600529 | 山东药玻 | 74,800 | 2,036,056.00 | 0.74 |
| 9 | 600926 | 杭州银行 | 171,000 | 2,009,250.00 | 0.74 |
| 10 | 600315 | 上海家化 | 68,700 | 1,992,987.00 | 0.73 |

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 | 23,200,882.14 | 8.49 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 111,458,695.69 | 40.78 |
| | 其中：政策性金融债 | 81,233,530.66 | 29.72 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 4 | 企业债券 | 51,155,385.76 | 18.72 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,148,536.99 | 3.71 |
| 6 | 中期票据 | 20,554,221.92 | 7.52 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 6,124,386.37 | 2.24 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 222,642,108.87 | 81.46 |

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 | 220322 | 22 进出 22 | 300,000 | 30,607,520.55 | 11.20 |
| 2 | 210402 | 21 农发 02 | 200,000 | 20,349,180.33 | 7.45 |
| 3 | 137729 | 22 华安 G2 | 200,000 | 20,310,193.97 | 7.43 |
| 4 | 092218001 | 22 农发清发 01 | 200,000 | 20,181,698.63 | 7.38 |
| 5 | 2328017 | 23 农业银行三农债 | 200,000 | 20,056,961.75 | 7.34 |

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 10,362.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | 395,268.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,960.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| - | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 407,591.26 |

5.10.4 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 | 113632 | 鹤 21 转债 | 532,969.52 | 0.20 |
| 2 | 128116 | 瑞达转债 | 472,349.59 | 0.17 |
| 3 | 110089 | 兴发转债 | 435,534.47 | 0.16 |
| 4 | 113655 | 欧 22 转债 | 363,590.96 | 0.13 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 345,044.47 | 0.13 |
| 6 | 113636 | 甬金转债 | 343,107.53 | 0.13 |
| 7 | 118018 | 瑞科转债 | 342,934.43 | 0.13 |
| 8 | 113043 | 财通转债 | 267,092.40 | 0.10 |
| 9 | 110075 | 南航转债 | 250,261.21 | 0.09 |
| 10 | 118015 | 芯海转债 | 227,164.93 | 0.08 |
| 11 | 118020 | 芳源转债 | 223,075.89 | 0.08 |
| 12 | 113651 | 松霖转债 | 204,046.76 | 0.07 |
| 13 | 110080 | 东湖转债 | 189,023.01 | 0.07 |
| 14 | 113623 | 凤 21 转债 | 169,731.16 | 0.06 |
| 15 | 113054 | 绿动转债 | 163,590.70 | 0.06 |
| 16 | 127039 | 北港转债 | 162,297.70 | 0.06 |
| 17 | 127049 | 希望转 2 | 133,501.55 | 0.05 |
| 18 | 113661 | 福 22 转债 | 121,046.88 | 0.04 |
| 19 | 127017 | 万青转债 | 119,628.20 | 0.04 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 20 | 123119 | 康泰转 2 | 115,654.66 | 0.04 |
| 21 | 128048 | 张行转债 | 114,401.34 | 0.04 |
| 22 | 123132 | 回盛转债 | 110,767.75 | 0.04 |
| 23 | 128135 | 洽洽转债 | 94,237.37 | 0.03 |
| 24 | 113050 | 南银转债 | 90,067.64 | 0.03 |
| 25 | 111009 | 盛泰转债 | 89,948.14 | 0.03 |
| 26 | 113650 | 博 22 转债 | 88,384.00 | 0.03 |
| 27 | 123151 | 康医转债 | 69,288.00 | 0.03 |
| 28 | 110064 | 建工转债 | 56,453.01 | 0.02 |
| 29 | 123106 | 正丹转债 | 56,283.49 | 0.02 |
| 30 | 123091 | 长海转债 | 48,750.58 | 0.02 |
| 31 | 123039 | 开润转债 | 46,319.10 | 0.02 |
| 32 | 113046 | 金田转债 | 42,126.84 | 0.02 |
| 33 | 123146 | 中环转 2 | 35,713.09 | 0.01 |

5.10.5 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。

5.10.6 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 | 中海增强收益债券 A | 中海增强收益债券 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 15,869,258.44 | 2,476,427.22 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 198,587,917.77 | 41,891,141.82 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,144,283.17 | 22,134,621.06 |
| 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 | 210,312,893.04 | 22,232,947.98 |

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-----------------------------|--------------|---------------|---------------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 2023-4-19 至 2023-5-10 | 0.00 | 20,209,377.53 | 0.00 | 20,209,377.53 | 8.6900 |
| | 2 | 2023-4-1 至 2023-4-11 | 7,860,849.06 | 373,373.66 | 0.00 | 8,234,222.72 | 3.5400 |
| | 3 | 2023-4-12 至 2023-6-30 | 0.00 | 80,741,232.38 | 0.00 | 80,741,232.38 | 34.7200 |
| | 4 | 2023-4-1 至 2023-4-18 | 4,590,218.80 | 37,458,574.86 | 21,640,000.00 | 20,408,793.66 | 8.7800 |
| | 5 | 2023-5-11 至 2023-6-30 | 0.00 | 80,774,636.51 | 0.00 | 80,774,636.51 | 34.7300 |

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，基金份额持有人将可能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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准募集中海增强收益债券型证券投资基金的文件
- 2、 中海增强收益债券型证券投资基金基金合同
- 3、 中海增强收益债券型证券投资基金托管协议
- 4、 中海增强收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2023 年 7 月 21 日