

---

中海丰盈三个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2025 年第 2 季度报告

2025 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：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：2025 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 16 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 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 中海丰盈三个月定期开放债券  |
| 基金主代码      | 016431   |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 20 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 808,077,122.16 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、封闭期投资策略</p> <p>本基金在综合判断宏观经济周期、货币及财政政策方向、市场资金供需状况的基础上，结合收益率水平曲线形态分析，优化债券组合的期限结构和类属配置；在符合本基金相关投资比例规定的前提下，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</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。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。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。</p> |

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。

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：

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。

流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。

#### （4）信用债投资策略

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。

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%。本基金对信用债评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债项评级，若无债项评级的，则参照主体信用评级。本基金所指信用债主要包括商业银行金融债（不包括政策性金融债）。本基金持有信用债期间，如果其信用评级下降不再符合前述标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合约定。

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。

#### （5）同业存单投资策略

本基金经过对存单发行银行的信用资质和存单流动性进行分析，在严控信用风险底线的前提下，对信用资质、流动性、收益率进行综合考虑，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%。

#### 2、开放期投资策略

本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资

|        |  |
|--------|--|
|        | 品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。<br>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型、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  | 浙商银行股份有限公司   |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 10,190,646.52                       |
| 2. 本期利润         | 30,286,815.27                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0136                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 817,719,391.70                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0119                              |

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

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

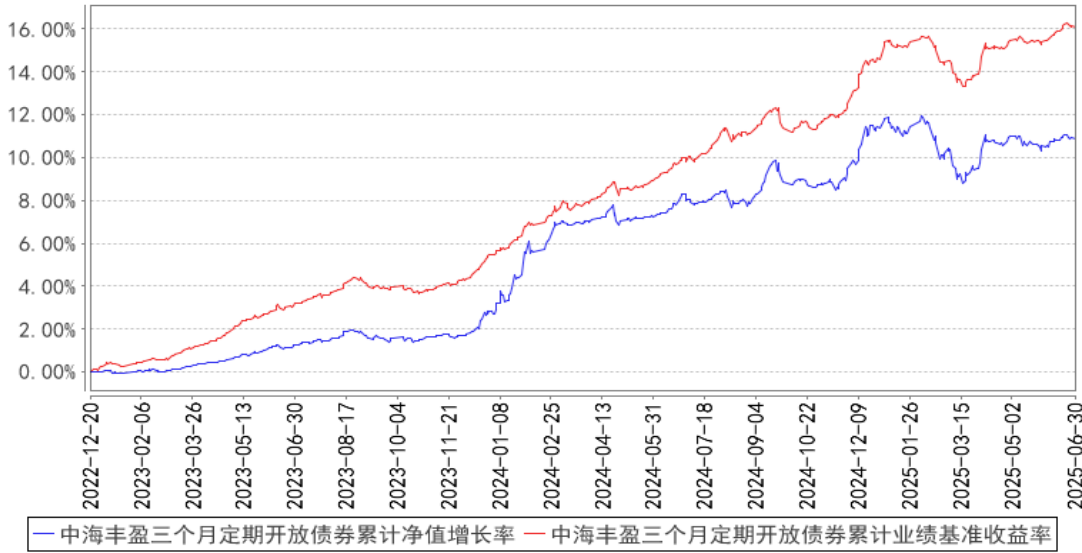
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 1.23%      | 0.15%         | 1.95%          | 0.11%                 | -0.72% | 0.04% |
| 过去六个月          | -0.58%     | 0.18%         | 1.14%          | 0.12%                 | -1.72% | 0.06% |
| 过去一年           | 2.33%      | 0.16%         | 5.52%          | 0.12%                 | -3.19% | 0.04% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 10.86%     | 0.13%         | 16.09%         | 0.09%                 | -5.23% | 0.04% |

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率变动的比较

中海丰盈三个月定期开放债券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 |        |  |
| 王影峰 | 固收中心总经理兼固收投资部总经理、固收投资总监、本基金基金经理、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理、中海纯债债券型证券投资基金基金经理 | 2022 年 12 月 20 日 | -    | 23 年   | 王影峰先生, 上海财经大学金融学专业硕士。历任上海证券有限责任公司债券交易部高级经理、上海耀之资产管理中心（有限合伙）投资交易部投资总监、耀之国际资产管理有限公司投资部投资总监、上海耀之资产管理中心（有限合伙）投资交易部投资交易总监、耀之国际资产管理有限公司投资部投资总监、华宝证券股份有限公司资产管理业务总部固定收益投资总监。2021 年 6 月进入本公司工作，历任固定收益投资部总经理、固定收益投资总监、基金经理兼资产管理一部总经理、投资总监、固定收益投资部总经理兼固定收益投资总监，现任固收中心总经理兼固收投资部总经理、固收投资总监、基金经理。2021 年 8 月至 2022 年 9 月任中海货币市场证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2022 年 9 月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 8 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 月至 2022 年 9 月任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至今任中海纯债债券型证券投资基金基金经理，2022 年 12 月至今任中海丰盈三个月定期开放债券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遵规守信情况的说明

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 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

2025 年二季度，在美国加征关税政策及地缘政治风险等影响下，海外经济增长动能有所走弱，通胀下行速度放缓，整体修复节奏存在分化。美国经济呈下行趋势，通胀担忧暂缓，美联储表态整体边际偏鹰，降息预期进一步收窄；美债收益率整体下行。欧洲处于“弱修复”区间，欧央行如期降息，但随着通胀回到目标区间，降息周期或进入尾声。英央行维持利率不变，降息预期升温。日本经济面临萎缩，日央行宣布维持政策利率不变，放缓缩表步伐。在美国高额关税等因素推动下，新兴市场海外资金转向净流出，经济增长放缓。

二季度国内经济缓慢修复。4 月经济整体平稳，工业增加值同比增速回落，但仍维持较快增长；制造业投资继续高增，地产销售及投资同比降幅扩大，基建及制造业投资同比增速小幅回落，社零同比不及预期。5 月中美贸易谈判阶段性缓和，出口修复带动制造业环比回升，工业增加值小幅放缓；结构上内需表现整体偏弱，底部回升态势仍存在较大不确定性；消费释放潜力，社零增速创下近期新高。6 月制造业 PMI 环比小幅上行 0.2 个百分点至 49.7%，略高于市场预期，但仍处于枯荣线之下，制造业供需两端均有所回升。

货币政策整体延续适度宽松基调。央行二季度例会召开，强调加大货币政策调控力度，灵活把握政策实施的力度和节奏，畅通货币政策传导机制，防范汇率超调风险；重申防范资金空转，从宏观审慎角度关注债市长期收益率变化。5 月，金融管理部门推出一揽子金融政策，释放了稳市场、稳预期的强烈信号。6 月陆家嘴论坛上，央行行长表示将继续做好货币政策框架转型的评估和完善，坚持支持性货币政策立场，持续优化创新结构性政策工具。

债券市场窄幅震荡，多空因素交织，股债跷跷板效应显现，信用风险事件仍较多。二季度，央行加大资金投放力度，市场流动性预期有所好转；超预期降准降息带动资金利率明显下行，持续回升的理财规模助推利差快速压缩。信用债方面，期限利差震荡下行，信用利差整体压缩，中长久期品种表现较突出；地方政府化债进展顺利，市场对城投债和金融债仍较为青睐；房地产行业风险仍在，中小银行信用风险上升，需关注敏感地区信用瑕疵，警惕弱资质主体二永债不赎回风险。

考虑到跨季资金成本较高，利率水平逐步接近前期低点，本基金 6 月中旬开始压降组合杠杆和久期；6 月底跨季资金安排结束后，再次将组合久期拉长。

债市当前面临的情况是：经过 4-6 月上涨后，绝对利率水平较低，但银行间资金成本在季末一直维持在较高水平，短端票息与资金成本之间的息差已非常有限，且期限利差和信用利差也极度压缩；但另一方面，经济基本面依然面临较大不确定性，房地产销售数据再次回落，中美贸易摩擦 5 月有所缓和后带来外贸抢出口效应，但 8 月再次面临不确定性，且“抢出口”本身就是透支未来的需求。因此总体来看，央行货币政策适度宽松的大方向没有改变，只是在利率接近前低的情况下，债市进入窄幅震荡区间，等待跨季后资金面情况进一步明朗。

综合来看，我们判断 7 月经济基本面对债市有利，而跨季后资金面应会逐步宽松，同样有利于债券市场，因此 6 月底再次拉长组合久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.0119 元（累计净值 1.1079 元）。报告期内本基金净值增长率为 1.23%，低于业绩比较基准 0.72 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              | -              | -            |
|    | 其中：股票             | -              | -            |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 806,159,480.83 | 98.48        |
|    | 其中：债券             | 806,159,480.83 | 98.48        |
|    | 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      | 12,367,088.75  | 1.51         |
| 8  | 其他资产              | 109,903.10     | 0.01         |
| 9  | 合计                | 818,636,472.68 | 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



注：本基金为纯债基金，不进行股票投资。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金为纯债基金，不进行股票投资。

## 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

注：本基金为纯债基金，不进行股票投资。

## 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      | 375,501,438.07 | 45.92        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 430,658,042.76 | 52.67        |
|    | 其中：政策性金融债 | 430,658,042.76 | 52.67        |
| 4  | 企业债券      | —              | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | —              | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 806,159,480.83 | 98.59        |

## 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  | 250413  | 25 农发 13     | 2,100,000 | 210,725,391.78 | 25.77        |
| 2  | 2500002 | 25 超长特别国债 02 | 1,200,000 | 120,928,983.61 | 14.79        |
| 3  | 250215  | 25 国开 15     | 1,200,000 | 119,638,520.55 | 14.63        |
| 4  | 250409  | 25 农发 09     | 1,000,000 | 100,294,130.43 | 12.27        |
| 5  | 019758  | 24 国债 21     | 600,000   | 60,538,389.04  | 7.40         |

## 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：本基金在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：本基金在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：本基金为纯债基金，不进行权证投资。

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

本基金在本报告期内未参与国债期货的投资。

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：本基金在本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内未参与国债期货的投资。

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中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京金融监管局的处罚。

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。

除上述发行主体外，基金管理人未发现报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

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

本基金为纯债基金，不进行股票投资。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 109,803.13 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 99.97      |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 109,903.10 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金为纯债基金，不进行可转换债券投资。

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：本基金为纯债基金，不进行股票投资。

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

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,309,927,545.29 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 20,534.59        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,501,870,957.72 |
| 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               | 808,077,122.16   |

§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              | 2025-04-01 至 2025-06-25 | 834,723,558.87 | 0.00 | 834,723,558.87 | 0.00           | 0.00     |
|       | 2              | 2025-06-25              | 282,245,742.78 | 0.00 | 0.00           | 282,245,742.78 | 34.93    |

|  |   |                               |                |      |                |                |       |
|--|---|-------------------------------|----------------|------|----------------|----------------|-------|
|  |   | 至<br>2025-06-30               |                |      |                |                |       |
|  | 3 | 2025-06-25<br>至<br>2025-06-30 | 469,791,412.20 | 0.00 | 0.00           | 469,791,412.20 | 58.14 |
|  | 4 | 2025-04-01<br>至<br>2025-06-23 | 470,765,464.65 | 0.00 | 470,765,464.65 | 0.00           | 0.00  |
| 产品特有风险   |   |                               |                |      |                |                |       |
| <p>1、持有人大会投票权集中的风险<br/>当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、巨额赎回的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、提前终止基金合同的风险<br/>持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p> |   |                               |                |      |                |                |       |

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海丰盈三个月定期开放债券型证券投资基金的文件
- 2、中海丰盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 3、中海丰盈三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 4、中海丰盈三个月定期开放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

2025 年 7 月 21 日