

# 中海合嘉增强收益债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 26 日

## §1 重要提示

### 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。

基金托管人平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中海合嘉增强收益债券	
基金主代码	002965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 24 日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	40,558,212.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中海合嘉增强收益债券 A	中海合嘉增强收益债券 C
下属分级基金的交易代码:	002965	002966
报告期末下属分级基金的份额总额	35,944,480.60 份	4,613,732.32 份

### 2.2 基金产品说明

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	<p>本基金的投资理念是基于宏观经济周期趋势性变化，确定利率变动的方向和趋势，据此合理安排资产组合的配置结构，在控制投资风险的前提下获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。此外，本基金还将通过积极的个股精选等来增强基金资产的收益。</p> <p>1、一级资产配置</p> <p>一级资产配置主要采取自上而下的方式。本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析判断，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。</p> <p>2、债券投资策略（可转债除外）</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，判断宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此预测利率变动的方向和趋势。</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）其它交易策略</p> <p>a、短期资金运用：在短期资金运用上，如果逆回购利率较高，选择逆回购融出资金。</p> <p>b、公司债跨市场套利：公司债将在银行间市场和交易所市场同时挂牌，根据</p>

	<p>以往的经验，两个市场的品种将出现差价套利交易的机会。</p> <p>3、可转换债券投资策略 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。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 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、股票投资策略 本基金可适当参与股票投资，增强基金资产收益。本基金股票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。</p> <p>6、权证投资策略 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>7、中小企业私募债投资策略 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。</p>
业绩比较基准	中国债券总指数收益率×90%+沪深 300 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。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	李帅帅
	联系电话	021-38429808	0755-25878287
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95511-3
传真		021-68419525	0755-82080387

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及

---

	30 层。
--	-------

### §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

基金级别	中海合嘉增强收益债券 A	中海合嘉增强收益债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	944,699.68	105,450.38
本期利润	1,664,988.50	34,114.34
加权平均基金份额本期利润	0.0396	0.0062
本期基金份额净值增长率	3.91%	3.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1471	-0.1499
期末基金资产净值	35,016,807.96	4,479,834.39
期末基金份额净值	0.9742	0.9710

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。

注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

中海合嘉增强收益债券 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	1.75%	0.34%	1.12%	0.10%	0.63%	0.24%
过去三个月	-1.43%	0.38%	0.29%	0.14%	-1.72%	0.24%
过去六个月	3.91%	0.38%	3.94%	0.14%	-0.03%	0.24%
过去一年	-1.00%	0.39%	6.60%	0.15%	-7.60%	0.24%
自基金合同生效起至今	-2.58%	0.27%	9.28%	0.14%	-11.86%	0.13%

中海合嘉增强收益债券 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	1.74%	0.34%	1.12%	0.10%	0.62%	0.24%

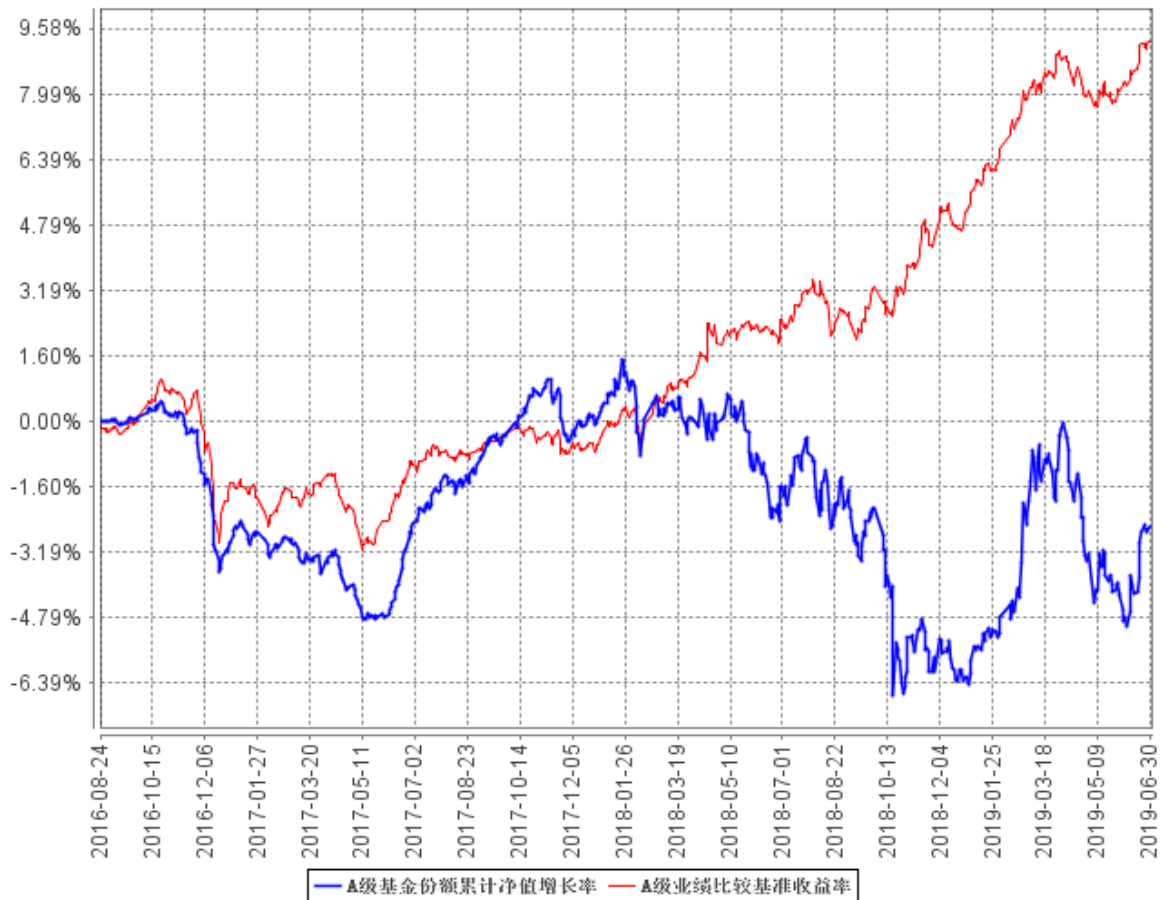
过去三个月	-1.43%	0.38%	0.29%	0.14%	-1.72%	0.24%
过去六个月	3.82%	0.38%	3.94%	0.14%	-0.12%	0.24%
过去一年	-0.96%	0.39%	6.60%	0.15%	-7.56%	0.24%
自基金合同生效起至今	-2.90%	0.27%	9.28%	0.14%	-12.18%	0.13%

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2016 年 8 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为中国债券总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%，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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具、权证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的相关规定）。基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，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%。因此，我们选取市场认同度很高的中国债券总指数和沪深 300 指数作为计算业绩基准指数的基础指数。在一般均衡配置的状况下，本基金投资于股票资产的比例控制在 20%以内，其他资产投资比例控制在 80%以内。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，选择 90%作为债券资产所代表的长期平均权重，选择 10%作为基准指数中股票资产所代表的长期平均权重，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 90%、10%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

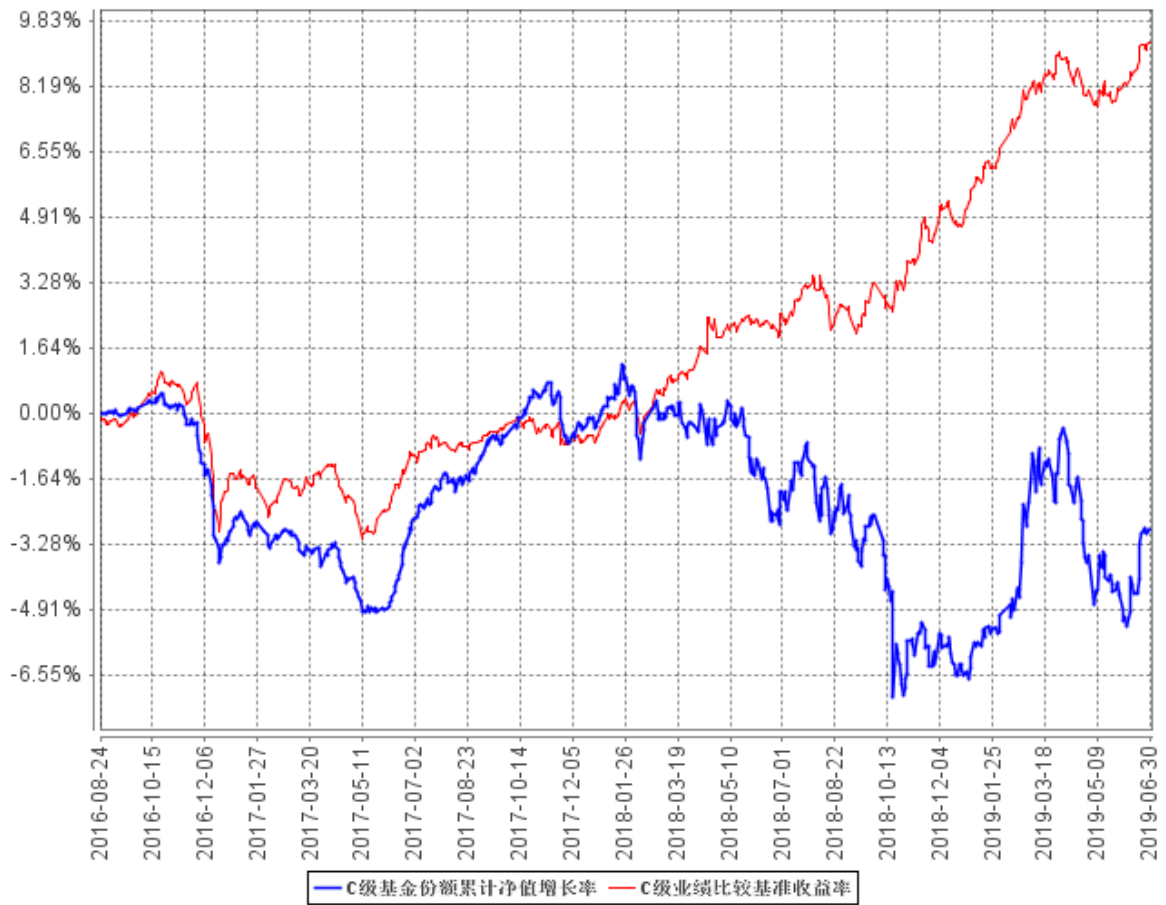
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



## §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 2019 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 31 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		
江小震	本基金基金经理	2016 年 8 月 24 日	2019 年 4 月 23 日	21 年	江小震先生，复旦大学金融学专业硕士。历任长江证券股份有限公司投资经理、中维资产管理有限责任公司部门经理、天安人寿保险股份有限公司（原名恒康天安保险有限责任公司）投资部经理、太平洋资产管理有限责任公司高级经理。2009 年 11 月进入本公司工作，历任固定收益小组负责人、固定收益部副总监、固定收益部总经理、投资副总监、投资经理。2010 年 7 月至 2012 年 10 月任中海货币市场证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至 2017 年 7 月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2018 年 3 月任中海惠丰纯债分级债券型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2018 年 5 月任中海货币市场证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2018 年 5 月任中海纯债债券型证

					<p>券投资基金基金经理，2016 年 7 月至 2018 年 5 月任中海稳健收益债券型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月至 2018 年 9 月任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理，2011 年 3 月至 2019 年 3 月任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理，2013 年 1 月至 2019 年 3 月任中海惠裕纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理，2014 年 8 月至 2019 年 4 月任中海惠祥分级债券型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至 2019 年 4 月任中海惠利纯债分级债券型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至 2019 年 4 月任中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理。</p>
于航	<p>本基金基金经理、中海优质成长证券投资基金基金经理、中海魅力长三角灵活配置混合型证券投资基金基金经理</p>	<p>2016 年 8 月 24 日</p>	<p>2019 年 4 月 23 日</p>	<p>9 年</p>	<p>于航先生，复旦大学运筹学与控制论专业博士。2010 年 7 月进入本公司工作，历任助理分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月任中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至 2017 年 7 月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月至 2019 年 4 月任中海增强收益债券型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月至 2019 年 4 月任中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金经理。</p>

					经理，2015 年 4 月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理，2016 年 3 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。
周梦婕	本基金基金经理	2019 年 4 月 3 日	-	6 年	周梦婕女士，华东师范大学计算机软件与理论专业硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司产品助理、长江证券股份有限公司投资经理助理、长江证券（上海）资产管理有限公司研究员。2016 年 11 月进入中海基金管理有限公司工作，曾任基金经理助理。2019 年 4 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。

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 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

2019 年上半年，经济运行总体保持平稳态势，外部的不稳定因素有所增加。6 月以来，美联储降息预期强烈，为国内宽松政策环境打开空间。

基本面方面，5 月 CPI 同比上涨 2.7%，涨幅有所扩大；1-5 月全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，增速比 1-4 月回落 0.2%；1-5 月社会消费品零售总额同比增长 8.1%，增速比 1-4 月加快 0.1%；1-5 月全国固定资产投资同比增长 5.6%，增速比 1-4 月回落 0.5%；5 月全国城镇调查失业率为 5.0%，与上月持平。

货币政策方面，2019 年以来，央行继续实施稳健中性的货币政策，M2 与社融规模增长与名义 GDP 增速基本匹配，为应对信用收缩压力，流动性维持合理充裕。5 月以来，包商银行被托管事件，表明监管机构整顿银行业的力度与决心，金融服务实体经济能力进一步加强。

金融市场方面，流动性保持稳定，市场对于经济预期一季度较为乐观，二季度受到外围贸易影响转为谨慎。十年国债收益率在 3.0%-3.4% 的区间内波动，股票市场一季度反弹，二季度进入调整。

本基金在 2019 年第二季度进行持仓调整，降低股票持仓比例，调整债券持仓结构。在操作上，各资产比例严格按照法规要求，没有出现流动性风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 0.9742 元（累计净值 0.9742 元）。报告期内本基金 A 类净值增长率为 3.91%，低于业绩比较基准 0.03 个百分点。本基金 C 类份额净值 0.9710 元（累计净值 0.9710 元）。报告期内本基金 C 类净值增长率为 3.82%，低于业绩比较基准

0.12 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 2019 年下半年，近期海外仍保持再宽松的趋势，但央行坚持目前的货币政策。考虑到通胀及经济基本面等因素，预计未来货币政策依旧保持稳健中性。包商银行事件及信用事件的发生，金融机构间流动性分层的情况依旧存在，货币政策大概率不会持续收紧。未来，在金融刚兑打破及信用收缩的背景下，低等级信用债发行主体的融资难度加大，中长期更加利好高等级信用债、利率债及可转债。

#### 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、监察稽核负责人、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 2019 年 1 月 30 日至 3 月 31 日期间，本基金曾出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

自 2019 年 4 月 1 日至 6 月 30 日期间，本基金曾出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## §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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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：中海合嘉增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,946,101.69	269,350.16
结算备付金		42,939.81	21,570.75
存出保证金		20,807.77	10,194.81
交易性金融资产	6.4.7.2	33,638,845.40	46,029,226.62
其中：股票投资		-	6,542,140.92
基金投资		-	-
债券投资		33,638,845.40	39,487,085.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,500,000.00	-
应收证券清算款		755,020.59	144,666.23
应收利息	6.4.7.5	1,015,730.52	1,120,819.00
应收股利		-	-
应收申购款		84.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		41,919,529.78	47,595,827.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		2,057,750.13	-
应付赎回款		298,952.02	49.32
应付管理人报酬		17,369.81	21,177.24
应付托管费		5,210.93	6,353.19
应付销售服务费		1,144.95	631.49
应付交易费用	6.4.7.7	19,383.63	11,415.19
应交税费		760.47	1,971.07



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	22,315.49	95,000.07
负债合计		2,422,887.43	136,597.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	40,558,212.92	50,631,754.75
未分配利润	6.4.7.10	-1,061,570.57	-3,172,524.75
所有者权益合计		39,496,642.35	47,459,230.00
负债和所有者权益总计		41,919,529.78	47,595,827.57

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.9738 元，基金份额总额为 40,558,212.92 份。其中 A 类基金份额净值为人民币 0.9742 元，份额总额为 35,944,480.60 份；C 类基金份额净值为人民币 0.9710 元，份额总额为 4,613,732.32 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海合嘉增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,958,144.09	-92,545.41
1.利息收入		682,616.04	2,051,550.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,250.91	14,340.58
债券利息收入		661,936.31	2,035,512.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,428.82	1,697.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		611,486.44	-8,732,718.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	667,190.75	198,966.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-81,678.36	-8,987,083.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	25,974.05	55,398.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	648,952.78	6,588,587.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,088.83	36.33
<b>减：二、费用</b>		259,041.25	649,054.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	114,234.56	225,728.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,270.36	67,718.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,393.87	6,406.04
4. 交易费用	6.4.7.19	56,138.48	83,345.88
5. 利息支出		7,103.21	129,378.55
其中：卖出回购金融资产支出		7,103.21	129,378.55
6. 税金及附加		985.28	6,299.60
7. 其他费用	6.4.7.20	40,915.49	130,177.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,699,102.84	-741,599.46
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,699,102.84	-741,599.46

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海合嘉增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	50,631,754.75	-3,172,524.75	47,459,230.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,699,102.84	1,699,102.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-10,073,541.83	411,851.34	-9,661,690.49
其中：1.基金申购款	31,261,533.07	-1,385,380.17	29,876,152.90
2.基金赎回款	-41,335,074.90	1,797,231.51	-39,537,843.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生	-	-	-

的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	40,558,212.92	-1,061,570.57	39,496,642.35
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	150,688,673.18	91,516.68	150,780,189.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-741,599.46	-741,599.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-87,867,649.05	-371,120.55	-88,238,769.60
其中：1.基金申购款	108,647.22	11.62	108,658.84
2.基金赎回款	-87,976,296.27	-371,132.17	-88,347,428.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	62,821,024.13	-1,021,203.33	61,799,820.80

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：

杨皓鹏

宋宇

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

中海合嘉增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”) 由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中海合嘉增强收益债券型证券投资基金基金合同》公开募集, 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[2016]1379号《关于

准予中海合嘉增强收益债券型证券投资基金注册的批复》核准。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人和注册登记机构均为中海基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案，基金合同于 2016 年 8 月 24 日生效，该日的基金份额总额为 922,943,555.37 份，其中 A 类基金份额总额 749,762,288.01 份，C 类基金份额总额 173,050,020.89 份，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1123 号予以验证。

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具、权证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的相关规定）。本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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 2 号《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〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

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‰；

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品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暂行条例（2011 年修订）》、《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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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、直销机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 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没有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	114,234.56	225,728.11
其中：支付销售机构的	41,644.25	90,124.51

客户维护费		
-------	--	--

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数} \quad (H \text{ 为每日应支付的基金管理费, } E \text{ 为前一日的基金资产净值})$$

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	34,270.36	67,718.42

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数} \quad (H \text{ 为每日应支付的基金托管费, } E \text{ 为前一日的基金资产净值})$$

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

#### 6.4.8.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海合嘉增强收益债券 A	中海合嘉增强收益债券 C	合计
中海基金	-	976.96	976.96
平安银行	-	1,376.04	1,376.04
国联证券	-	853.45	853.45
合计	-	3,206.45	3,206.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海合嘉增强收益债券 A	中海合嘉增强收益债券 C	合计
中海基金	-	18.48	18.48
平安银行	-	3,819.20	3,819.20
国联证券	-	1,270.39	1,270.39
合计	-	5,108.07	5,108.07

注：A 类本基金基金份额不收取销售服务费，C 类按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中海基金，再由中海基金计算并支付给各基金销售机构。其计



算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
平安银行股份有限公司	2,946,101.69	9,629.97	87,907.80	11,327.61

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，2019 半年度获得的利息收入为人民币 941.53 元(2018 半年度：人民币 2,667.21 元)，2019 年 6 月末结算备付金余额为人民币 42,939.81 元(2018 年 6 月末：人民币 166,664.20 元)。

#### 6.4.8.6 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未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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。

#### **6.4.9.2 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。

#### **6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

##### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算成标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## §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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,638,845.40	80.25
	其中：债券	33,638,845.40	80.25
	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	3,500,000.00	8.35
	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	2,989,041.50	7.13
8	其他各项资产	1,791,642.88	4.27
9	合计	41,919,529.78	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.3 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：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 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	000002	万科 A	499,870.00	1.05
2	601012	隆基股份	460,339.45	0.97
3	600031	三一重工	444,128.00	0.94
4	601233	桐昆股份	400,868.00	0.84
5	603986	兆易创新	354,788.00	0.75
6	002044	美年健康	351,230.00	0.74
7	600703	三安光电	343,491.00	0.72

8	300450	先导智能	339,985.00	0.72
9	600745	闻泰科技	329,787.00	0.69
10	600887	伊利股份	327,177.00	0.69
11	000063	中兴通讯	320,890.00	0.68
12	000333	美的集团	310,215.00	0.65
13	600690	海尔智家	309,745.00	0.65
14	600837	海通证券	297,360.00	0.63
15	002594	比亚迪	291,338.00	0.61
16	300760	迈瑞医疗	273,857.00	0.58
17	002821	凯莱英	265,554.00	0.56
18	300365	恒华科技	262,681.00	0.55
19	300750	宁德时代	236,410.00	0.50
20	300340	科恒股份	228,341.00	0.48

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	601012	隆基股份	977,494.14	2.06
2	300760	迈瑞医疗	897,697.43	1.89
3	002230	科大讯飞	636,563.63	1.34
4	300059	东方财富	615,509.02	1.30
5	603986	兆易创新	606,189.26	1.28
6	600570	恒生电子	604,710.28	1.27
7	002594	比亚迪	565,171.97	1.19
8	000002	万科A	506,076.00	1.07
9	300750	宁德时代	486,045.42	1.02
10	300365	恒华科技	483,062.90	1.02
11	600845	宝信软件	475,872.78	1.00
12	600031	三一重工	457,728.69	0.96
13	300124	汇川技术	426,142.73	0.90
14	601233	桐昆股份	382,416.00	0.81
15	600887	伊利股份	360,974.00	0.76
16	300253	卫宁健康	348,241.15	0.73
17	600703	三安光电	345,739.11	0.73

18	002821	凯莱英	342,435.22	0.72
19	000063	中兴通讯	341,723.50	0.72
20	002044	美年健康	332,127.80	0.70

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	10,202,938.45
卖出股票收入（成交）总额	18,228,218.69

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,998,400.00	5.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,811,990.00	60.29
	其中：政策性金融债	23,811,990.00	60.29
4	企业债券	7,828,455.40	19.82
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	33,638,845.40	85.17

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	169,000	17,047,030.00	43.16
2	018008	国开 1802	35,000	3,561,950.00	9.02
3	122397	15 宜华 01	39,870	3,325,955.40	8.42
4	018003	国开 1401	27,000	3,203,010.00	8.11
5	136830	16 中信 G1	25,000	2,502,500.00	6.34

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**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：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.10.3 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。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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	20,807.77
2	应收证券清算款	755,020.59
3	应收股利	-
4	应收利息	1,015,730.52
5	应收申购款	84.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,791,642.88

#### **7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

#### **7.11.5 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。

#### **7.11.6 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。

## §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
中海合嘉增强收益债券 A	393	91,461.78	0.00	0.00%	35,944,480.60	100.00%
中海合嘉增强收益债券 C	91	50,700.36	1,019,756.48	22.10%	3,593,975.84	77.90%
合计	484	83,797.96	1,019,756.48	2.51%	39,538,456.44	97.49%

### 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	中海合嘉增强收益债券 A	264.29	0.0007%
	中海合嘉增强收益债券 C	189.73	0.0041%
	合计	454.02	0.0011%

### 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的情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	中海合嘉增强收益债券 A	0
	中海合嘉增强收益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	中海合嘉增强收益债	0



	券 A	
开放式基金	中海合嘉增强收益债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海合嘉增强收 益债券 A	中海合嘉增强收 益债券 C
基金合同生效日（2016 年 8 月 24 日）基金 份额总额	749,883,030.48	173,060,524.89
本报告期期初基金份额总额	46,507,598.44	4,124,156.31
本报告期基金总申购份额	21,342,457.72	9,919,075.35
减：本报告期基金总赎回份额	31,905,575.56	9,429,499.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,944,480.60	4,613,732.32

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，本基金基金经理变更为周梦婕女士。

本报告期内，本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

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚。

### 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	
招商证券	1	14,963,287.73	52.68%	13,935.31	40.84%	-
华创证券	1	10,735,472.20	37.79%	18,205.34	53.36%	-
川财证券	1	2,706,482.76	9.53%	1,979.30	5.80%	-
安信证券	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；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报风险管理部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内本基金租用券商交易单元的情况未发生变更。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

注 4：以上数据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。

### 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
招商证券	30,713,303.97	19.37%	-	-	-	-
华创证券	104,281,621.12	65.76%	40,500,000.00	90.00%	-	-
川财证券	23,586,317.30	14.87%	4,500,000.00	10.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

## §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	2019-1-23 至 2019-1-29	1,019,756.48	21,111,580.28	21,111,580.28	1,019,756.48	2.51%

#### 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。

中海基金管理有限公司

2019 年 8 月 26 日