

# 中海量化策略混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定,于 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<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.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 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.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
11.1 备查文件目录.....	58
11.2 存放地点.....	58

11.3 查阅方式.....58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海量化策略混合型证券投资基金
基金简称	中海量化策略混合
基金主代码	398041
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 6 月 24 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
报告期末基金份额总额	263, 221, 343. 78 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	根据量化模型，精选个股，积极配置权重，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金在对经济周期、财政政策、货币政策和通货膨胀等宏观经济因素进行前瞻性充分研究的基础上，通过比较股票资产与债券资产预期收益率的高低进行大类资产配置，动态调整基金资产在股票、债券和现金之间的配置比例。</p> <p>股票投资：本基金产品的特色在于采用自下而上的选股策略，施行一级股票库初选、二级股票库精选以及投资组合行业权重配置的全程数量化。</p> <p>债券投资：债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、可分离可转债产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。</p> <p>本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p>

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄乐军	郭明

	联系电话	021-38429808	010-66105799
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9788、 021-38789788	95588
传真		021-68419525	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		曾杰	陈四清

## 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	17,476,046.03
本期利润	-8,005,384.31
加权平均基金份额本期利润	-0.0285
本期加权平均净值利润率	-1.66%
本期基金份额净值增长率	-1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	124,696,555.47
期末可供分配基金份额利润	0.4737
期末基金资产净值	452,775,043.23
期末基金份额净值	1.720
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	158.47%

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

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	-4.50%	1.04%	-1.59%	0.64%	-2.91%	0.40%
过去三个月	2.69%	1.31%	3.11%	0.78%	-0.42%	0.53%
过去六个月	-1.71%	1.36%	0.77%	1.05%	-2.48%	0.31%
过去一年	24.73%	1.66%	20.92%	1.06%	3.81%	0.60%
过去三年	104.28%	1.96%	42.89%	1.07%	61.39%	0.89%
自基金合同生效起至今	158.47%	1.69%	75.78%	1.18%	82.69%	0.51%

注1：“自基金合同生效起至今”指2009年6月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日。

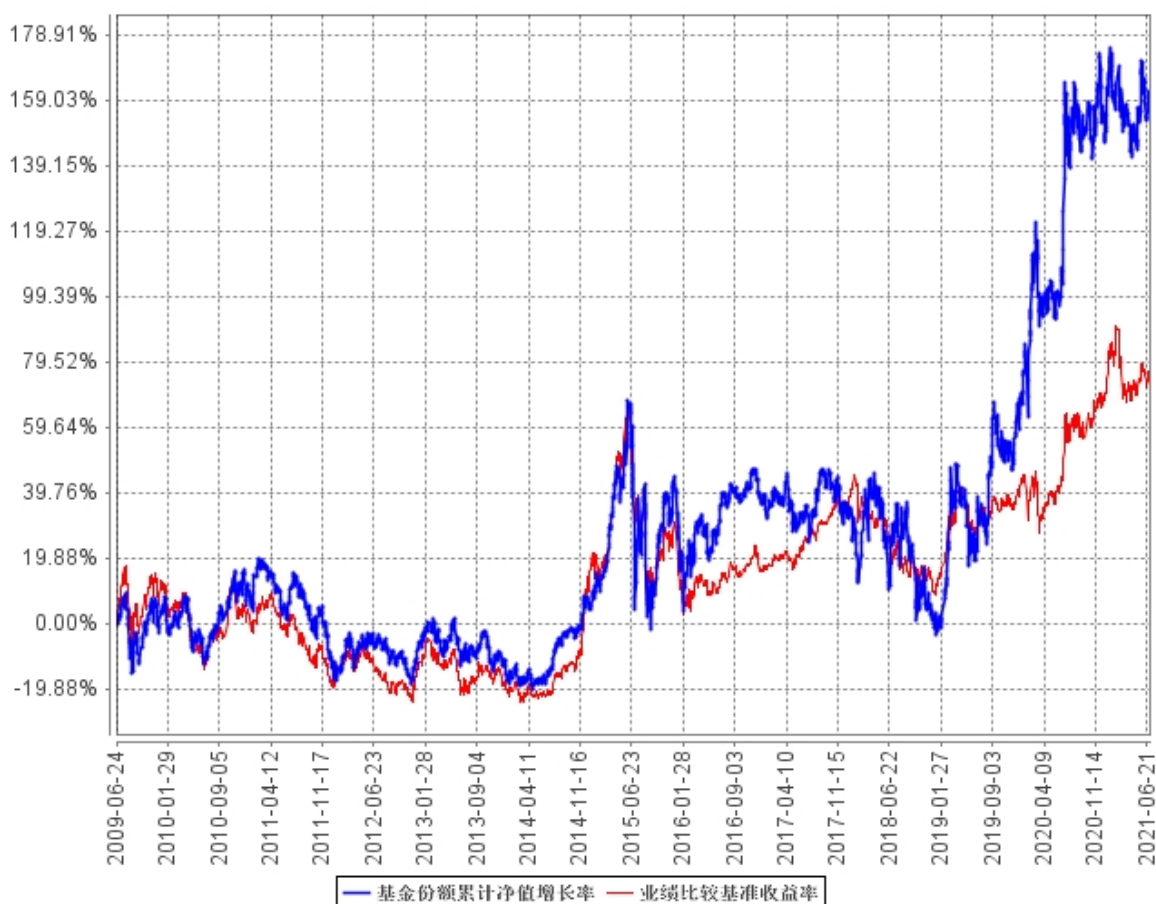
注2：本基金的业绩比较基准为沪深300指数涨跌幅\*80%+中国债券总指数涨跌幅\*20%，我们选取市场认同度很高的沪深300指数、中国债券总指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投



资股票的比例为 60%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 80%左右，债券投资比例控制在 20%左右。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，以使业绩比较更加合理。本基金业绩基准指数每日按照 80%、20%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

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 2021 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 30 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		
彭海平	本基金基金经理、中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理、中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理	2016 年 12 月 20 日	-	11 年	彭海平先生，中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009 年 7 月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2015 年 7 月至 2019 年 1 月任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理，2018 年 4 月至 2019 年 3 月任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 4 月至 2019 年 4 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 2019 年 4 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 1 月至今任中海上证 50 指数增强型证券投资基金基金经理，2016 年 4 月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2018 年 9 月至今任中海

					可转换债券债券型证券投资 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

全球经济受益于疫苗接种、政策支持等因素影响，中美等主要经济体复苏势头强劲。然而，发达经济体复苏快于新兴经济体，各国国内产业间的分化走势依旧显著。其次，各国经济复苏的分化导致经济政策的时间错位。发达经济体中的美国率先收紧货币政策，其外溢效应通过资本市场、外汇市场等渠道加大了全球金融风险。

我国经济呈现制造业温和修复、基建小幅发力、消费尚存阻力、出口增速放缓的特征。上半年企业利润率、终端需求、产能利用率等指标均持续回升，叠加政策对制造业投资支持力度不减，带动制造业投资修复。国内消费修复持续缓慢且不均衡，消费总量增速不足及服务消费和限额以下商品零售拖累消费恢复。我国上半年出口金额两年平均增长 13.6%，主要由中国替代产能及全球防疫物资新增需求提供。我国上半年 CPI 呈逐步回升态势，但受制于猪肉下行周期及居民消费不足，CPI 增速依然温和。PPI 同比由 1 月份的 0.3% 快速攀升至 5 月份的 9%，创下 2009 年以来的新高点。

宏观政策方面，随着国内经济稳步恢复，上半年货币政策如期向常态回归。在“调结构、化风险”上加大力度。从本轮货币退出可以看出央行最先强化对地方政府隐性债务和金融体系资金空转的监管，主动化解部分金融风险。目前处于宽信用紧货币的状态，但是全面降准举措和 6 月超预期的社融增速数据预示信用收紧已经边际放缓。

A 股上半年行业表现分化显著，最好的行业与最差的行业之间的收益差接近 60%，领涨的行业主要集中在周期和成长板块。领涨的行业绝大部分行业全年的一致预期 EPS 同比增速都超过 40%，业绩确定性高。根据二季度业绩预告，净利润增速最高的公司也主要分布在上述板块中，说明上述板块业绩正在逐步兑现。从估值指标来看，沪深 300、上证 50 及创业板指等大市值宽基指数的估值处于历史中等估值水平，市值中等的中证 500 处于低估水平。从拥挤度视角来看，A 股拥挤度持续上行，A 股的微观交易结构集中且分歧较大。

本基金上半年主要集中配置在低估值金融板块，包括证券和银行。证券板块虽连续几个季度保持 30% 左右的增长，估值却一路走低，上半年延续了这种背离，主要原因可能是牛市预期不再，且成长股挣钱效应带来的证券板块的资金流出。银行板块受制于政策以及经济复苏预期的反复，估值受到压制，表现不佳。因此，本基金上半年业绩不佳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.720 元（累计净值 2.257 元）。报告期内本基金净值增长率为 -1.71%，低于业绩比较基准 2.48 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

展望未来，我们认为对于高估值的成长股要降低预期收益率，低估值的金融板块或将有更好的表现。本基金将继续集中配置低估值金融。

#### 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。

## §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，本基金托管人在对中海量化策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，中海量化策略股票型证券投资基金的管理人——中海基金管理有限公司在中海量化策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对中海基金管理有限公司编制和披露的中海量化策略股票型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：中海量化策略混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,957,730.58	4,000,737.82
结算备付金		1,247,864.91	2,504,950.64
存出保证金		59,725.09	174,222.22
交易性金融资产	6.4.7.2	453,184,303.81	614,409,510.00
其中：股票投资		429,722,126.51	581,949,308.10
基金投资		-	-
债券投资		23,462,177.30	32,460,201.90
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	-	-
应收证券清算款		8,820,280.51	3,946,720.86
应收利息	6.4.7.5	707,000.85	398,717.24
应收股利		-	-
应收申购款		2,505,538.22	2,960,217.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		470,482,443.97	628,395,076.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		6,000,000.00	13,000,000.00
应付证券清算款		4,621,462.47	-
应付赎回款		6,158,260.37	3,928,428.58
应付管理人报酬		564,927.10	773,006.15
应付托管费		94,154.51	128,834.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	117,157.71	327,264.52
应交税费		-	-

应付利息		-	-3,364.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	151,438.58	239,698.69
负债合计		17,707,400.74	18,393,868.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	263,221,343.78	348,493,191.52
未分配利润	6.4.7.10	189,553,699.45	261,508,016.99
所有者权益合计		452,775,043.23	610,001,208.51
负债和所有者权益总计		470,482,443.97	628,395,076.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.720 元，基金份额总额 263,221,343.78 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-2,807,322.83	43,591,353.42
1.利息收入		544,265.24	512,925.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,021.49	54,587.61
债券利息收入		520,243.75	458,337.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,547,828.59	74,744,723.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,126,991.42	69,649,391.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,093,417.53	606,133.13
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	2,327,419.64	4,489,199.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-25,481,430.34	-33,585,137.97
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	582,013.68	1,918,842.48
<b>减：二、费用</b>		5,198,061.48	6,329,697.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,590,052.21	3,427,274.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	598,341.97	571,212.41



3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	729,587.87	2,065,804.63
5. 利息支出		176,285.43	168,799.25
其中：卖出回购金融资产支出		176,285.43	168,799.25
6. 税金及附加		0.45	0.84
7. 其他费用	6.4.7.20	103,793.55	96,606.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,005,384.31	37,261,655.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,005,384.31	37,261,655.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	348,493,191.52	261,508,016.99	610,001,208.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,005,384.31	-8,005,384.31
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）	-85,271,847.74	-63,948,933.23	-149,220,780.97
其中：1. 基金申购款	156,675,889.77	115,739,530.67	272,415,420.44
2. 基金赎回款	-241,947,737.51	-179,688,463.90	-421,636,201.41
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）	263,221,343.78	189,553,699.45	452,775,043.23
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	280,150,900.61	30,442,289.25	310,593,189.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,261,655.63	37,261,655.63
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)	30,132,323.32	49,916,676.46	80,048,999.78
其中：1.基金申购款	707,007,889.72	253,130,976.98	960,138,866.70
2.基金赎回款	-676,875,566.40	-203,214,300.52	-880,089,866.92
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)	310,283,223.93	117,620,621.34	427,903,845.27

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                                          李俊                                          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

中海量化策略混合型证券投资基金(原中海量化策略股票型证券投资基金，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》、《证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定，经中国证券监督管理委员会证监基金字[2009]347号《关于核准中海量化策略股票型证券投资基金募集的批复》核准募集。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，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2009年6月24日生效，该日的基金份额总额为1,646,387,741.58份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2009]B049号验资报告予以验证。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，中海量化策略

股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为中海量化策略混合型证券投资基金。

本基金投资范围限于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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×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《中国证监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 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〈年度报告和中期报告〉》、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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,957,730.58
定期存款	-
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	-
合计：	3,957,730.58

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	432,251,771.98	429,722,126.51	-2,529,645.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	23,462,177.30	-75,672.30
	银行间市场	-	-
	合计	23,462,177.30	-75,672.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	455,789,621.58	453,184,303.81	-2,605,317.77

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**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无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	270.24
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	505.35
应收债券利息	706,201.05
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	24.21
合计	707,000.85

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	117,157.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	117,157.71

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,249.66
应付证券出借违约金	-
其他	34,969.37
预提费用	94,219.55
合计	151,438.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	348,493,191.52	348,493,191.52
本期申购	156,675,889.77	156,675,889.77
本期赎回(以“-”号填列)	-241,947,737.51	-241,947,737.51
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	263,221,343.78	263,221,343.78

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	146,445,383.08	115,062,633.91	261,508,016.99
本期利润	17,476,046.03	-25,481,430.34	-8,005,384.31
本期基金份额交易产生的变动数	-39,224,873.64	-24,724,059.59	-63,948,933.23
其中：基金申购款	72,905,053.50	42,834,477.17	115,739,530.67
基金赎回款	-112,129,927.14	-67,558,536.76	-179,688,463.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	124,696,555.47	64,857,143.98	189,553,699.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	7,214.43
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	15,955.06
其他	852.00
合计	24,021.49

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,126,991.42
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	18,126,991.42
----	---------------

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	296,942,446.72
减：卖出股票成本总额	278,815,455.30
买卖股票差价收入	18,126,991.42

#### 6.4.7.12.3 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。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,093,417.53
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	1,093,417.53

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,049,947.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,745,583.57
减：应收利息总额	210,946.48
买卖债券差价收入	1,093,417.53

**6.4.7.13.3 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。

**6.4.7.13.4 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。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 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。

**6.4.7.14.2 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。

**6.4.7.14.3 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。

**6.4.7.14.4 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 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。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,327,419.64
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	2,327,419.64

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-25,481,430.34
——股票投资	-25,329,589.31
——债券投资	-151,841.03
——资产支持证券投资	-
——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	-25,481,430.34

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	554,184.76
转出基金补偿收入	27,828.92
合计	582,013.68

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	729,587.87
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	729,587.87

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
帐户服务费	9,000.00
银行费用	574.00
合计	103,793.55

### 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、直销机构
中国工商银行股份有限公司	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

### 6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

国联证券	-	-	112,898,574.93	7.90%
------	---	---	----------------	-------

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	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 成交总额的比例
国联证券	-	-	33,599,339.20	62.51%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
国联证券	-	-	385,500,000.00	20.12%

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国联证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国联证券	105,141.45	8.44%	19,636.04	6.04%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,590,052.21	3,427,274.18
其中：支付销售机构的客户维护费	1,419,977.33	1,162,406.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	598,341.97	571,212.41

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应支付的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值）

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国工商银行股份有限公司	3,957,730.58	7,214.43	2,866,000.56	29,238.08

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，2021年半年度获得的利息收入为人民币15,955.06元（2020年半年度：人民币21,909.46元），2021年6月末结算备付金余额为人民币1,247,864.91元（2020年6月末：2,495,611.59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未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内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：本基金在本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	新股流通受限	2.87	4.75	63,505	182,259.35	301,648.75	-
688630	芯碁微装	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	新股流通受限	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688667	菱电电控	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-



688328	深科达	2021年3月1日	2021年9月9日	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2022年1月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300950	德国特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

#### 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

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额 6,000,000.00 元，于 2021 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为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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投研中心投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司投研中心研究部管理办法》、《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基金信用债业务运作管理办法》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、风控合规部、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。

##### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	23,462,177.30	32,460,201.90
合计	23,462,177.30	32,460,201.90

注：本期末和上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券均为政策性金融债。

#### 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 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

《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、存出保证金及债券投资等，持有的利率敏感性负债主要为卖出回购金融资产等。

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 2021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							
银行存款	3,957,730.58	-	-	-	-	-	3,957,730.58
结算备付金	1,247,864.91	-	-	-	-	-	1,247,864.91
存出保证金	59,725.09	-	-	-	-	-	59,725.09
交易性金融资产	-	-23,462,177.30	-	-	-	-429,722,126.51	453,184,303.81
应收证券清算款	-	-	-	-	-	8,820,280.51	8,820,280.51
应收利息	-	-	-	-	-	707,000.85	707,000.85
应收申购款	-	-	-	-	-	2,505,538.22	2,505,538.22
资产总计	5,265,320.58	23,462,177.30	-	-	-	-441,754,946.09	470,482,443.97
负债							
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,621,462.47	4,621,462.47
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,158,260.37	6,158,260.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	564,927.10	564,927.10
应付托管费	-	-	-	-	-	94,154.51	94,154.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	117,157.71	117,157.71
其他负债	-	-	-	-	-	151,438.58	151,438.58
负债总计	6,000,000.00	-	-	-	-	-11,707,400.74	17,707,400.74
利率敏感度缺口	-734,679.42	23,462,177.30	-	-	-	-430,047,545.35	452,775,043.23
上年度末 2020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							
银行存款	4,000,737.82	-	-	-	-	-	4,000,737.82
结算备付金	2,504,950.64	-	-	-	-	-	2,504,950.64
存出保证金	174,222.22	-	-	-	-	-	174,222.22
交易性金融资产	-	-	-32,460,201.90	-	-	-581,949,308.10	614,409,510.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,946,720.86	3,946,720.86

应收利息	-	-	-	-	398,717.24	398,717.24
应收申购款	-	-	-	-	2,960,217.83	2,960,217.83
资产总计	6,679,910.68	-32,460,201.90	-	-	-589,254,964.03	628,395,076.61
负债						
卖出回购金 融资产款	13,000,000.00	-	-	-	-	13,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	3,928,428.58	3,928,428.58
应付管理人 报酬	-	-	-	-	773,006.15	773,006.15
应付托管费	-	-	-	-	128,834.36	128,834.36
应付交易费 用	-	-	-	-	327,264.52	327,264.52
应付利息	-	-	-	-	-3,364.20	-3,364.20
其他负债	-	-	-	-	239,698.69	239,698.69
负债总计	13,000,000.00	-	-	-	5,393,868.10	18,393,868.10
利率敏感度 缺口	-6,320,089.32	-32,460,201.90	-	-	-583,861,095.93	610,001,208.51

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金管理人为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率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；买入返售金融资产（如有）的利息收益和卖出回购金融资产（如有）的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券。		
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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	利率下降 25 个基点	9,429.76	52,094.67
利率上升 25 个基点	-9,402.92	-51,883.55	

#### 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产的比例为基金资产的 60%—95%，债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)为基金资产的 0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的 0%—3%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	429,722,126.51	94.91	581,949,308.10	95.40
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	23,462,177.30	5.18	—	—
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	453,184,303.81	100.09	581,949,308.10	95.40

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	15,213,483.36	33,957,712.01
	-5%	-15,213,483.36	-33,957,712.01

## 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR (%)	2.14	2.37
	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。

## §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	429,722,126.51	91.34
	其中：股票	429,722,126.51	91.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,462,177.30	4.99
	其中：债券	23,462,177.30	4.99
	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	5,205,595.49	1.11
8	其他各项资产	12,092,544.67	2.57
9	合计	470,482,443.97	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,853,442.52	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	1.14
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	33,299.34	0.01
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	40,226.27	0.01
J	金融业	422,589,607.90	93.33
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	14,291.73	0.00
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	429,722,126.51	94.91

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	601377	兴业证券	3,570,640	34,492,382.40	7.62
2	600030	中信证券	1,362,542	33,981,797.48	7.51
3	600926	杭州银行	2,035,214	30,019,406.50	6.63
4	600999	招商证券	1,554,925	29,574,673.50	6.53
5	601878	浙商证券	2,169,229	28,373,515.32	6.27
6	601658	邮储银行	4,913,400	24,665,268.00	5.45
7	601166	兴业银行	1,180,600	24,261,330.00	5.36
8	601108	财通证券	2,231,800	23,411,582.00	5.17
9	600036	招商银行	430,900	23,350,471.00	5.16
10	000001	平安银行	885,000	20,018,700.00	4.42
11	002142	宁波银行	478,700	18,654,939.00	4.12
12	300059	东方财富	566,827	18,586,257.33	4.10
13	601788	光大证券	1,018,871	18,227,602.19	4.03
14	601211	国泰君安	1,003,900	17,206,846.00	3.80
15	000783	长江证券	2,237,615	16,379,341.80	3.62
16	000728	国元证券	2,051,634	16,351,522.98	3.61
17	601688	华泰证券	968,189	15,297,386.20	3.38
18	601555	东吴证券	1,805,920	15,061,372.80	3.33
19	002926	华西证券	1,513,800	14,577,894.00	3.22
20	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.14
21	688425	铁建重工	63,505	301,648.75	0.07
22	300896	爱美客	275	216,942.00	0.05
23	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.04
24	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.04
25	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.03
26	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.03
27	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
28	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
29	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01

30	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
31	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
32	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
33	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
34	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
35	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
36	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
37	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
38	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
39	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
40	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
41	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
42	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
43	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
44	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
45	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
46	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
47	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
48	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
49	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
50	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
51	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
52	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
53	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
54	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
55	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
56	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
57	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
58	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
59	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
60	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
61	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
62	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
63	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
64	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
65	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
66	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
67	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
68	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

69	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
70	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 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	601658	邮储银行	30,340,832.00	4.97
2	600999	招商证券	20,658,792.10	3.39
3	600030	中信证券	19,160,707.11	3.14
4	601377	兴业证券	13,541,990.00	2.22
5	601878	浙商证券	11,968,217.51	1.96
6	600926	杭州银行	11,655,344.76	1.91
7	601166	兴业银行	9,088,287.00	1.49
8	601108	财通证券	7,771,349.00	1.27
9	002044	美年健康	3,631,853.50	0.60
10	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.56
11	300059	东方财富	3,064,661.00	0.50
12	600036	招商银行	2,976,552.00	0.49
13	002142	宁波银行	2,194,131.00	0.36
14	600362	江西铜业	1,943,717.00	0.32
15	601788	光大证券	1,179,503.00	0.19
16	601818	光大银行	1,150,506.00	0.19
17	601111	中国国航	556,600.00	0.09
18	600019	宝钢股份	556,407.00	0.09
19	601088	中国神华	554,847.00	0.09
20	601211	国泰君安	452,959.00	0.07

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	300059	东方财富	45,404,454.39	7.44

2	601128	常熟银行	24,659,510.86	4.04
3	601818	光大银行	23,842,706.96	3.91
4	600837	海通证券	19,975,326.00	3.27
5	601162	天风证券	19,850,645.00	3.25
6	600958	东方证券	18,725,263.00	3.07
7	600999	招商证券	12,167,091.66	1.99
8	000001	平安银行	10,714,458.00	1.76
9	002142	宁波银行	10,658,588.00	1.75
10	600036	招商银行	8,112,449.00	1.33
11	601166	兴业银行	8,060,583.00	1.32
12	601377	兴业证券	6,655,531.00	1.09
13	600030	中信证券	6,431,788.08	1.05
14	601788	光大证券	5,937,015.80	0.97
15	601211	国泰君安	5,863,987.00	0.96
16	601555	东吴证券	5,464,247.00	0.90
17	601688	华泰证券	5,220,142.00	0.86
18	000728	国元证券	5,053,506.00	0.83
19	600926	杭州银行	4,979,183.00	0.82
20	000783	长江证券	4,951,036.98	0.81

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	151,917,863.02
卖出股票收入（成交）总额	296,942,446.72

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,462,177.30	5.18
	其中：政策性金融债	23,462,177.30	5.18
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	23,462,177.30	5.18

## 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	108604	国开 1805	233,990	23,462,177.30	5.18

## 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股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 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 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。

### 7.11.3 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。



## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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除中信证券受到监管处罚外，其他发行主体未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。

中信证券于 2021 年 2 月 10 日因私募托管业务内控不完善、个别首次公开发行保荐项目质量不高、个别资管产品不合规等违规行为受到证监会地方监管机构责令改正的监管管理措施。且于 2020 年 12 月 31 日因投行类业务内控不规范、廉洁从业风险防控机制不完善等行为，受到中国证监会采取责令改正的行政监督管理措施。

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，认为该事件对上述发行主体投资价值未产生实质性影响。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	59,725.09
2	应收证券清算款	8,820,280.51
3	应收股利	-
4	应收利息	707,000.85
5	应收申购款	2,505,538.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,092,544.67

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

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
48,098	5,472.60	14,787,247.77	5.62%	248,434,096.01	94.38%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	36,801.15	0.0140%

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年6月24日）基金份额总额	1,646,387,741.58
本报告期期初基金份额总额	348,493,191.52
本报告期基金总申购份额	156,675,889.77
减：本报告期基金总赎回份额	241,947,737.51
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	263,221,343.78

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 2021 年 1 月 23 日发布公告，因杨皓鹏总经理离任，由本公司督察长黄乐军先生代为履行本公司总经理一职。

本基金管理人于 2021 年 4 月 23 日发布公告，本公司督察长黄乐军先生不再代为履行总经理职务，由曾杰先生担任本公司总经理。

本报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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

为本基金进行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、托管机构及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
西藏东方财富证券	2	109,627,260.45	24.93%	80,170.15	21.35%	-
长江证券	1	94,245,786.13	21.43%	87,768.22	23.37%	-
海通证券	2	56,994,161.40	12.96%	47,643.00	12.69%	-
国泰君安	2	45,113,524.09	10.26%	42,014.25	11.19%	-

中泰证券	1	24,336,025.94	5.53%	22,664.32	6.04%	-
天风证券	2	22,279,350.33	5.07%	16,292.60	4.34%	-
东吴证券	1	18,311,558.25	4.16%	17,053.59	4.54%	-
东方证券	2	17,897,218.56	4.07%	16,655.46	4.44%	-
广发证券	1	17,420,766.87	3.96%	16,223.97	4.32%	-
上海证券	1	15,569,916.73	3.54%	14,500.17	3.86%	-
光大证券	1	4,294,508.95	0.98%	3,999.50	1.06%	-
西部证券	1	3,958,878.36	0.90%	2,895.12	0.77%	-
信达证券	2	3,670,843.05	0.83%	2,684.49	0.71%	-
方正证券	1	3,309,755.32	0.75%	2,420.47	0.64%	-
国信证券	1	2,406,985.80	0.55%	2,241.57	0.60%	-
东北证券	2	330,786.39	0.08%	308.07	0.08%	-
中信建投	2	12,964.08	0.00%	9.48	0.00%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中山证券	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：本报告期内新增信达证券、上海证券的上海交易单元，和信达证券的深圳交易单元。

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
西藏东方财富证券	-	-	88,400,000.00	4.82%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	4,427,025.00	29.83%	646,300,000.00	35.28%	-	-
国泰君安	-	-	124,300,000.00	6.78%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	45,000,000.00	2.46%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	11,000,000.00	0.60%	-	-
广发证券	-	-	248,940,000.00	13.59%	-	-
上海证券	6,233,004.61	42.00%	294,800,000.00	16.09%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	127,500,000.00	6.96%	-	-
信达证券	-	-	11,500,000.00	0.63%	-	-
方正证券	-	-	137,800,000.00	7.52%	-	-
国信证券	4,180,020.00	28.17%	-	-	-	-
东北证券	-	-	65,900,000.00	3.60%	-	-
中信建投	-	-	30,700,000.00	1.68%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-

## 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	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司部分渠道申购费率和全渠道定投申购费率折扣标准的公告	证券时报	2021 年 1 月 4 日
2	中海量化策略混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
3	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司基金费率优惠活动的公告	证券时报	2021 年 1 月 26 日
4	中海基金管理有限公司关于华夏银行股份有限公司暂停本公司旗下部分基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告	证券时报	2021 年 3 月 11 日
5	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与长城国瑞证券有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告	证券时报	2021 年 3 月 11 日
6	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司基金申购业务（包括定期定额投资）费率优惠的公告	证券时报	2021 年 3 月 24 日
7	中海量化策略混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站	2021 年 3 月 30 日

8	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司部分渠道申购费率和全渠道定投申购费率折扣标准的公告	证券时报	2021 年 3 月 31 日
9	中海量化策略混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
10	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及相关费率优惠活动的公告	证券时报	2021 年 5 月 12 日
11	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	证券时报	2021 年 6 月 30 日
12	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司基金费率优惠活动的公告	证券时报	2021 年 6 月 30 日



## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海量化策略股票型证券投资基金的文件
- 2、中海量化策略股票型证券投资基金基金合同
- 3、中海量化策略股票型证券投资基金托管协议
- 4、中海量化策略股票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

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 11.3 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 8 月 31 日