

# 中海分红增利混合型证券投资基金 2023 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	42

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 .....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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情况 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海分红增利混合型证券投资基金
基金简称	中海分红增利混合
基金主代码	398011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 6 月 16 日
基金管理人	中海基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	305,323,590.90 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，主要通过投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行上市的各项债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取高比例分红收益和资本相对增值的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金采用现金股利精选的投资策略，即：通过公司开发的 DM 模型和 POD 模型筛选出现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司。</p> <p>1、股票选择策略</p> <p>股票投资组合构建通过以下三个阶段进行：</p> <p>第一阶段：历史上分红能力强股票筛选</p> <p>本基金运用本公司开发的 DM 模型对所有上市公司（投资决策委员会禁止投资的股票除外）进行过去分红能力筛选。主要通过现金股息率、3 年平均分红额等 6 项指标进行综合评价以反应上市公司过去分红强度、持续性、稳定性及分红投资回报。初步筛选出除上证红利指数 50 家成份股外的 150 家左右的上市公司，连同上证红利指数成份股 50 家，共 200 家左右股票作为中海分红增利基金股票备选库（I）。</p> <p>第二阶段：分红潜力股票精选</p> <p>针对第一阶段筛选的股票备选库（I），本基金运用 POD 模型对其分红潜力进行精选。</p> <p>中海 POD 模型由 3 个大的指标分析单元和 5 个量化的核心指标构成。</p> <p>模型所用数据全部为上市公司公布的历史数据，以保证客观性。中海 POD 模型 3 个大的分析单元分别是：企业盈利能力，财务健康状况及资产管理能力。通过企业盈利能力的分析，判断企业分红能力的基础是否坚实，未来分红潜力是否大；通过企业短期、长期负债等财务健康指标的分析，判断企业分红意愿；资产管理能力高的企业表明公司的经营效率高，管理层能力很强，有较好的核心竞争力。</p> <p>中海 POD 模型对备选库（I）中的股票进行进一步精选，形成 100</p>

	<p>家左右上市公司的股票作为本基金股票备选库（II）。</p> <p>第三阶段：股票投资组合构造。</p> <p>基金经理小组依据市场、行业景气度及内、外部研究报告，特别是研究员的实地调研报告，确定 50 只左右分红类股票。依据投资决策委员会确定的资产配置，完成股票资产投资组合的构造。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金可投资国债、金融债和企业债（包括可转债）。根据基金资产总体配置计划，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>运用 B-S 模型、二叉树模型、隐含波动率等方法对权证估值进行测算，通过权证交易来锁定风险。通过承担适量风险，进行主动投资以获取超额收益。</p>
业绩比较基准	上证红利指数×70% + 上证国债指数×25% + 银行一年期定期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属证券投资基金中的中等风险品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄乐军	秦一楠
	联系电话	021-38429808	010-66060069
	电子邮箱	huanglejun@zhfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	95599
传真		021-68419525	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200120	100031
法定代表人		曾杰	谷澍

### 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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-14,506,420.07
本期利润	-1,261,723.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0041
本期加权平均净值利润率	-0.54%
本期基金份额净值增长率	-0.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-75,768,565.32
期末可供分配基金份额利润	-0.2482
期末基金资产净值	229,555,025.58
期末基金份额净值	0.7518
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	268.57%

注：1：以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购、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	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	-3.73%	2.48%	-2.36%	0.57%	-1.37%	1.91%
过去三个月	-4.40%	2.30%	-0.48%	0.66%	-3.92%	1.64%
过去六个月	-0.74%	1.85%	4.17%	0.56%	-4.91%	1.29%
过去一年	-15.43%	1.83%	0.83%	0.68%	-16.26%	1.15%
过去三年	-13.23%	1.89%	18.01%	0.80%	-31.24%	1.09%
自基金合同生效起至今	268.57%	1.72%	219.84%	1.16%	48.73%	0.56%

注：1：“自基金合同生效起至今”指 2005 年 6 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

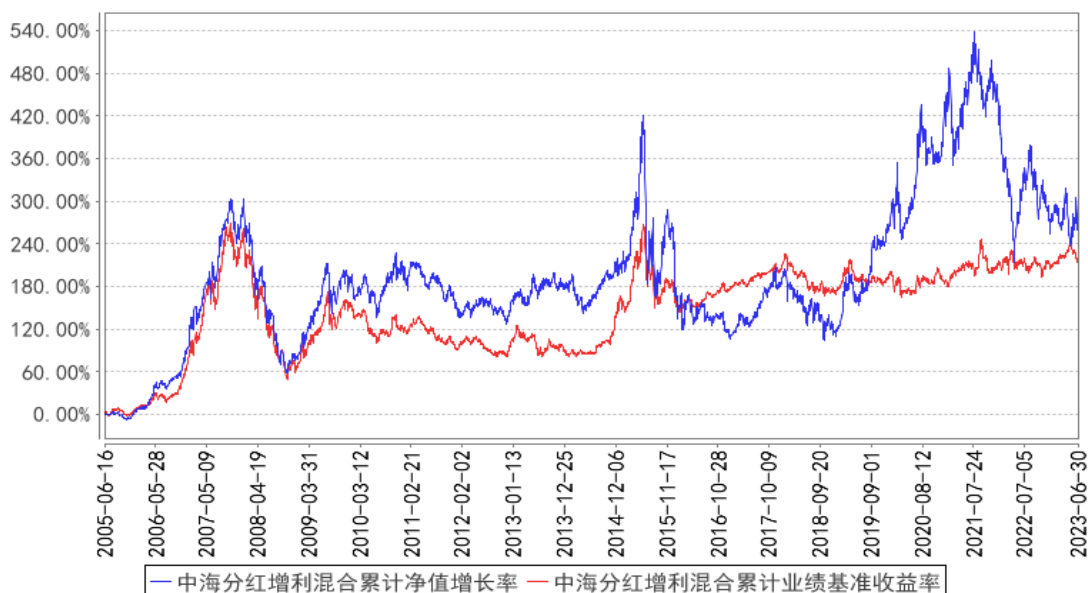
2：本基金的业绩比较基准为上证红利指数\*70%+上证国债指数\*25%+银行一年期定期存款利率\*5%，本基金主要投资于中国证券市场中现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公

开发行上市的各种债券。因此，我们选取市场认同度很高的上证红利指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数，同时考虑分红基金的特点，加入了一年定期存款利率作为业绩比较基准的一部分。在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 70%左右，债券及现金的投资比例控制在 30%左右，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例和最新的一年定期存款利率，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 70%、25%、5%的比例对基础指数和一年定期存款利率进行再平衡，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

中海分红增利混合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 2023 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 33 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		
邱红丽	研究部总经理、本基金基金经理、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海海誉混合型证券投资基金基金经理	2014 年 11 月 18 日	-	14 年	邱红丽女士，英国纽卡斯尔大学跨文化交流与国际管理专业硕士。历任大连龙日木制品有限公司会计，交通银行大连开发区分行会计主管，上海康时信息系统有限公司财务总监，尊龙实业（香港）有限公司财务总监。2009 年 4 月进入本公司工作，历任定量财务分析师、分析师、高级分析师、高级分析师兼基金经理助理、研究副总监、研究部副总经理，现任研究部总经理、基金经理。2015 年 11 月至 2021 年 7 月任中海混改红利主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月至 2023 年 5 月任中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014 年 11 月至今任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月至今任中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月至今任中海顺鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 7 月至今任中海海誉混合型证券投资基金基金经理。

注：1：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

#### 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

2023 年上半年证券市场呈现先扬后抑的震荡走势，年初影响市场的主要因素是国内经济复苏强度不及预期和海外美联储持续加息，使市场产生较大波动。到了 3 月份，因 ChatGPT 划时代的出现，TMT 板块强势上涨，与 AI 相关的通信和传媒板块出现了 40% 以上的大幅上涨，TMT 板块的成交额占 A 股总成交额比重一度突破了 50%。5 月份以后，一方面统计局陆续公布了 4 月的 PMI、CPI、信贷和房地产数据，这些数据还是略低于市场预期，另一方面 AI 相关板块短期涨幅较大出现调整，使得整体市场开始振荡调整。从整个上半年来看，在中央经济会议给出了明确的发展经济的方向、货币政策以及财政政策的方针后，在货币政策持续宽松的背景下，市场风险偏好比较稳定，市场仍然呈现出比较明显的板块结构性行情特征。

本基金在 23 年上半年一直坚持蓝筹+成长的配置策略，在配置了能够保持持续增长的蓝筹股的前提下，增加配置了一些科技成长股，板块配置方面比较均衡。相对重点的配置了半导体、通信和计算机板块。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值 0.7518 元（累计净值 2.4998 元）。报告期内本基金净值增长率为-0.74%，低于业绩比较基准 4.91 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

展望下半年，国内方面：预计我国的经济整体情况会稳中向好。政策方面，将继续关注财政

政策稳增长和央行货币政策的节奏和力度。另外经济结构调整与转型仍然是社会关注的主题。国际方面：关注海外经济体特别是美国的经济恢复情况，以及其货币政策变化预期情况，加之中美贸易关系的发展和变化情况，另外俄乌冲突的实时变化情况，这些情况将会对国内以及全球经济发展和格局产生持续重要的影响。

对于证券市场，我们认为中国经济本身存在很大韧性的前提下，货币政策持续稳健宽松和政策对市场呵护的双重背景下，以及资产配置荒的大环境下，我们认为市场继续还会受益于流动性的宽松，所以我们对市场中长期走势不悲观。同时我们认为后市板块和各股走势分化上还会比较严重。

2023 年下半年预计市场投资机会较大的行业会是在国家经济结构转型一直倡导和扶持的科技产业中（如 AI、机器人、电子、半导体等科技板块），和国家战略发展的规划布局中（如医疗养老、消费、新能源等）。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中海基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，中海基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，中海基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：中海分红增利混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,021,316.91	18,566,047.03
结算备付金		498,491.81	686,020.39
存出保证金		85,099.13	134,015.49
交易性金融资产	6.4.7.2	210,217,164.64	215,759,057.51
其中：股票投资		210,217,164.64	215,759,057.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		214,453.44	59,682.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		231,036,525.93	235,204,823.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		1,222.95	-
应付赎回款		27,340.99	84,891.43
应付管理人报酬		290,400.65	303,724.63
应付托管费		48,400.12	50,620.77
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,114,135.64	1,190,061.26
负债合计		1,481,500.35	1,629,298.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	305,323,590.90	308,392,617.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-75,768,565.32	-74,817,091.87
净资产合计		229,555,025.58	233,575,525.28
负债和净资产总计		231,036,525.93	235,204,823.37

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7518 元，基金份额总额 305,323,590.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		882,416.65	-81,353,733.54
1. 利息收入		76,851.54	88,039.04
其中：存款利息收入	6.4.7.13	76,851.54	88,039.04
债券利息收入		-	-
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）		-12,458,328.62	-87,729,578.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-12,879,474.58	-88,236,283.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	33,974.56
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	421,145.96	472,730.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	13,244,697.02	6,256,010.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	19,196.71	31,795.87
<b>减：二、营业总支出</b>		2,144,139.70	2,503,474.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,755,651.80	2,057,703.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	292,608.70	342,950.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	95,879.20	102,820.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,261,723.05	-83,857,208.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,261,723.05	-83,857,208.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,261,723.05	-83,857,208.49

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中海分红增利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	308,392,617.15	-	-74,817,091.87	233,575,525.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	308,392,617.15	-	-74,817,091.87	233,575,525.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,069,026.25	-	-951,473.45	-4,020,499.70
（一）、综合收益总额	-	-	-1,261,723.05	-1,261,723.05
（二）、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）	-3,069,026.25	-	310,249.60	-2,758,776.65
其中：1. 基金申购款	19,688,801.59	-	-4,776,391.13	14,912,410.46
2. 基金赎回	-22,757,827.84	-	5,086,640.73	-17,671,187.11

回款				
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	305,323,590.90	-	-75,768,565.32	229,555,025.58
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	318,663,017.00	-	48,427,358.39	367,090,375.39
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	318,663,017.00	-	48,427,358.39	367,090,375.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,322,229.60	-	-83,086,210.57	-89,408,440.17
(一)、综合收益总额	-	-	-83,857,208.49	-83,857,208.49
(二)、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)	-6,322,229.60	-	770,997.92	-5,551,231.68
其中: 1. 基金申购款	29,256,571.35	-	-3,883,774.73	25,372,796.62
2. 基金赎回款	-35,578,800.95	-	4,654,772.65	-30,924,028.30
(三)、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)	-	-	-	-



(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	312,340,787.40	-	-34,658,852.18	277,681,935.22

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：

<u>曾杰</u>	<u>李俊</u>	<u>周琳</u>
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

中海分红增利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，原名“国联分红增利混合型证券投资基金”）由国联基金管理有限公司（现已更名为“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【2005】67号《关于同意国联分红增利混合型证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会 2006 年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定，并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号“关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复”批准，名称变更为中海基金管理有限公司；另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过，并经各基金托管人同意及中国证券监督管理委员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原“国联分红增利混合型证券投资基金”更名为“中海分红增利混合型证券投资基金”。

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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司；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 2005 年 6 月 16 日生效，该日的基金份额总额为 603,405,465.83 份，经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公 W[2005]BS074 号验资报告予以验证。

本基金为混合型基金，主要通过投资于中国证券市场中那些现金股息率高、分红稳定的高品质上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券。本基金的业绩比较基准为：上证红利指数×70%+上证国债指数×25%+银行一年期定期存款利率×5%。

### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》《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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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的说明

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

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	20,021,316.91
等于：本金	20,017,943.41
加：应计利息	3,373.50
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	20,021,316.91

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	187,671,502.21	-	210,217,164.64	22,545,662.43
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	187,671,502.21	-	210,217,164.64	22,545,662.43

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金在本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金在本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金在本报告期末无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金在本报告期无债权投资，不需计提减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金在本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金在本报告期无其他债权投资，不需计提减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	220.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	361,209.07
其中：交易所市场	361,209.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,802.56
其他	163,903.82
合计	1,114,135.64

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	308,392,617.15	308,392,617.15
本期申购	19,688,801.59	19,688,801.59
本期赎回（以“-”号填列）	-22,757,827.84	-22,757,827.84
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	305,323,590.90	305,323,590.90

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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金在本报告期末无其他综合收益。

## 6.4.7.12 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	89,449,902.01	-164,266,993.88	-74,817,091.87
本期利润	-14,506,420.07	13,244,697.02	-1,261,723.05
本期基金份额交易产生的变动数	-803,270.50	1,113,520.10	310,249.60
其中：基金申购款	5,672,998.81	-10,449,389.94	-4,776,391.13
基金赎回款	-6,476,269.31	11,562,910.04	5,086,640.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,140,211.44	-149,908,776.76	-75,768,565.32

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	70,911.03
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	5,101.32	
其他	839.19	
合计	76,851.54	

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,879,474.58
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	-12,879,474.58

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	478,539,717.26
减：卖出股票成本总额	490,037,474.70
减：交易费用	1,381,717.14
买卖股票差价收入	-12,879,474.58

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：注：本基金在本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 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。

##### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。



**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 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。

**6.4.7.17.3 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。

**6.4.7.17.4 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。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 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。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	421,145.96
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	421,145.96

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	13,244,697.02
股票投资	13,244,697.02
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	13,244,697.02

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	16,938.71
基金转换费收入	2,258.00
合计	19,196.71

注：根据《中海分红增利混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的 25% 归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,576.64
账户维护费	9,000.00
合计	95,879.20

### 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

根据《中海基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 24 日起，本基金管理费率由 1.50%/年调整为 1.20%/年，本基金托管费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

### 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、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	85,621,454.37	8.41

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	378,982.50	100.00

## 6.4.10.1.3 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。

## 6.4.10.1.4 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 2023年1月1日至2023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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	79,737.40	8.86	-	-

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,755,651.80	2,057,703.64
其中：支付销售机构的客户维护费	451,137.16	524,477.71

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	292,608.70	342,950.59

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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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：本基金在本报告期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：本基金在本报告期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固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固有资金投资本基金。

**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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
农业银行	20,021,316.91	70,911.03	19,475,526.47	78,398.18

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，2023年半年度获得的利息收入为人民币5101.32元(2022年半年度：人民币7797.74元)，2023年6月末结算备付金余额为人民币498491.81元(2022年6月末：人民币479791.77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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：

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。

#### 6.4.12 期末（2023 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

注：本基金在本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

注：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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

##### 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 2023 年 6 月 30 日止，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公募基金投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司研究部管理办法》、《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投资组合信用业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》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、风险管理部门、监察稽核部门、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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

### **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 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **6.4.13.3.2 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、结算备付金及存出保证金等。

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 2023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	20,021,316.91	-	-	-	-	-	20,021,316.91
结算备付金	498,491.81	-	-	-	-	-	498,491.81
存出保证金	85,099.13	-	-	-	-	-	85,099.13



交易性金融资产	-	-	-	-	-	-210,217,164.64	210,217,164.64
应收申购款	-	-	-	-	-	214,453.44	214,453.44
资产总计	20,604,907.85	-	-	-	-	-210,431,618.08	231,036,525.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,340.99	27,340.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	290,400.65	290,400.65
应付托管费	-	-	-	-	-	48,400.12	48,400.12
应付清算款	-	-	-	-	-	1,222.95	1,222.95
其他负债	-	-	-	-	-	1,114,135.64	1,114,135.64
负债总计	-	-	-	-	-	1,481,500.35	1,481,500.35
利率敏感度缺口	20,604,907.85	-	-	-	-	-208,950,117.73	229,555,025.58
上年度末 2022 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	18,566,047.03	-	-	-	-	-	18,566,047.03
结算备付金	686,020.39	-	-	-	-	-	686,020.39
存出保证金	134,015.49	-	-	-	-	-	134,015.49
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-215,759,057.51	215,759,057.51
应收申购款	-	-	-	-	-	59,682.95	59,682.95
资产总计	19,386,082.91	-	-	-	-	-215,818,740.46	235,204,823.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	84,891.43	84,891.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	303,724.63	303,724.63
应付托管费	-	-	-	-	-	50,620.77	50,620.77
其他负债	-	-	-	-	-	1,190,061.26	1,190,061.26
负债总计	-	-	-	-	-	1,629,298.09	1,629,298.09
利率敏感度缺口	19,386,082.91	-	-	-	-	-214,189,442.37	233,575,525.28

#### 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。
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	利率下降 25 个基点	-	-
	利率上升 25 个基点	-	-

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日同），银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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投资比例为基金总资产的 30-95%，债券和现金的投资比例为 5-65%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	210,217,164.64	91.58	215,759,057.51	92.37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	210,217,164.64	91.58	215,759,057.51	92.37

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。		
	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	+5%	12,618,379.57	5,280,836.92
	-5%	-12,618,379.57	-5,280,836.92

#### 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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	收益率绝对 VaR (%)	3.24	3.25
	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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定: 第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价; 第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值; 第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	210,217,164.64	215,621,212.48
第二层次	-	-
第三层次	-	137,845.03
合计	210,217,164.64	215,759,057.51

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资, 若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次, 并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次, 确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 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	210,217,164.64	90.99
	其中：股票	210,217,164.64	90.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,519,808.72	8.88
8	其他各项资产	299,552.57	0.13
9	合计	231,036,525.93	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,141,744.88	68.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,319,085.00	1.45
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	43,121,304.76	18.78

J	金融业	-	-
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	-	-
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	5,635,030.00	2.45
S	综合	-	-
	合计	210,217,164.64	91.58

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	45,770	13,044,450.00	5.68
2	688153	唯捷创芯	162,279	11,872,331.64	5.17
3	688099	晶晨股份	126,694	10,682,838.08	4.65
4	600079	人福医药	337,700	9,097,638.00	3.96
5	301308	江波龙	88,500	9,005,760.00	3.92
6	601138	工业富联	341,600	8,608,320.00	3.75
7	688110	东芯股份	211,748	7,644,102.80	3.33
8	688332	中科蓝讯	89,388	7,479,987.84	3.26
9	000021	深科技	363,300	7,262,367.00	3.16
10	688766	普冉股份	65,514	6,998,205.48	3.05
11	688256	寒武纪	32,509	6,111,692.00	2.66
12	688111	金山办公	12,653	5,974,999.66	2.60
13	300576	容大感光	122,473	5,574,970.96	2.43
14	300308	中际旭创	37,100	5,470,395.00	2.38
15	688416	恒烁股份	64,695	5,078,557.50	2.21
16	300394	天孚通信	45,700	4,882,131.00	2.13
17	688012	中微公司	30,492	4,770,473.40	2.08
18	688048	长光华芯	47,972	4,534,313.44	1.98
19	300223	北京君正	51,100	4,512,641.00	1.97
20	300570	太辰光	79,700	4,360,387.00	1.90
21	688525	佰维存储	54,122	4,323,806.58	1.88
22	002156	通富微电	188,600	4,262,360.00	1.86
23	600602	云赛智联	266,100	4,007,466.00	1.75
24	002230	科大讯飞	57,000	3,873,720.00	1.69
25	000938	紫光股份	116,100	3,697,785.00	1.61

26	600584	长电科技	118,600	3,696,762.00	1.61
27	300042	朗科科技	96,100	3,678,708.00	1.60
28	688036	传音控股	24,839	3,651,333.00	1.59
29	001309	德明利	38,400	3,571,200.00	1.56
30	000977	浪潮信息	71,800	3,482,300.00	1.52
31	300475	香农芯创	129,500	3,319,085.00	1.45
32	300620	光库科技	53,400	3,272,352.00	1.43
33	300634	彩讯股份	122,300	3,228,720.00	1.41
34	601900	南方传媒	154,000	3,158,540.00	1.38
35	300002	神州泰岳	181,900	2,546,600.00	1.11
36	002602	世纪华通	308,400	2,340,756.00	1.02
37	688008	澜起科技	36,242	2,081,015.64	0.91
38	300494	盛天网络	53,280	1,320,811.20	0.58
39	300654	世纪天鸿	95,000	1,246,400.00	0.54
40	601801	皖新传媒	131,000	1,230,090.00	0.54
41	002837	英维克	37,290	1,116,462.60	0.49
42	603258	电魂网络	25,800	1,096,758.00	0.48
43	300638	广和通	47,400	1,075,032.00	0.47
44	688018	乐鑫科技	7,701	999,743.82	0.44
45	300624	万兴科技	8,000	937,200.00	0.41
46	300896	爱美客	80	35,596.00	0.02

## 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	600602	云赛智联	13,193,891.93	5.65
2	688048	长光华芯	12,686,962.74	5.43
3	300223	北京君正	10,582,283.00	4.53
4	688256	寒武纪	10,294,642.94	4.41
5	000032	深桑达 A	9,416,504.00	4.03
6	688153	唯捷创芯	9,307,192.01	3.98
7	000100	TCL 科技	8,319,363.00	3.56
8	300782	卓胜微	8,261,188.00	3.54
9	601138	工业富联	7,690,854.00	3.29
10	688766	普冉股份	7,627,821.02	3.27
11	000021	深科技	7,257,067.00	3.11
12	688110	东芯股份	7,231,450.02	3.10
13	301308	江波龙	7,229,620.00	3.10
14	688150	莱特光电	7,175,663.65	3.07
15	603986	兆易创新	7,129,749.00	3.05
16	688045	必易微	7,128,644.24	3.05
17	688325	赛微微电	7,119,646.78	3.05

18	002050	三花智控	7,070,628.00	3.03
19	002446	盛路通信	6,869,666.00	2.94
20	688111	金山办公	6,143,302.40	2.63
21	688798	艾为电子	6,109,089.14	2.62
22	688521	芯原股份	6,079,807.47	2.60
23	688368	晶丰明源	6,038,121.66	2.59
24	603893	瑞芯微	6,012,631.00	2.57
25	000977	浪潮信息	6,000,377.60	2.57
26	688498	源杰科技	5,988,423.18	2.56
27	688595	芯海科技	5,925,659.67	2.54
28	300308	中际旭创	5,924,854.00	2.54
29	600536	中国软件	5,917,228.10	2.53
30	603283	赛腾股份	5,856,893.00	2.51
31	688332	中科蓝讯	5,800,246.14	2.48
32	002156	通富微电	5,385,960.00	2.31
33	300820	英杰电气	5,051,439.00	2.16
34	300075	数字政通	5,020,935.00	2.15
35	688012	中微公司	4,940,256.16	2.12
36	000725	京东方 A	4,855,909.00	2.08
37	600416	湘电股份	4,827,739.00	2.07
38	002484	江海股份	4,745,158.00	2.03
39	300042	朗科科技	4,718,827.00	2.02
40	002230	科大讯飞	4,703,890.00	2.01

注：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	688008	澜起科技	17,753,292.84	7.60
2	688123	聚辰股份	16,185,143.68	6.93
3	002472	双环传动	12,832,413.00	5.49
4	000032	深桑达 A	11,254,375.66	4.82
5	002446	盛路通信	10,176,227.08	4.36
6	603688	石英股份	9,416,761.00	4.03
7	600602	云赛智联	9,143,750.14	3.91
8	002389	航天彩虹	8,614,558.98	3.69
9	000100	TCL 科技	8,474,382.00	3.63
10	688048	长光华芯	8,311,441.80	3.56
11	002049	紫光国微	8,196,158.00	3.51
12	688239	航宇科技	7,875,093.03	3.37
13	300034	钢研高纳	7,588,105.00	3.25



14	603986	兆易创新	7,126,510.00	3.05
15	600536	中国软件	7,126,359.00	3.05
16	688045	必易微	6,533,899.79	2.80
17	688150	莱特光电	6,518,010.28	2.79
18	688297	中无人机	6,462,474.12	2.77
19	002050	三花智控	6,444,053.20	2.76
20	688325	赛微微电	6,303,119.02	2.70
21	300782	卓胜微	6,267,226.00	2.68
22	603893	瑞芯微	5,825,420.00	2.49
23	688508	芯朋微	5,689,534.80	2.44
24	688521	芯原股份	5,598,020.09	2.40
25	688368	晶丰明源	5,511,019.10	2.36
26	300223	北京君正	5,257,958.67	2.25
27	603283	赛腾股份	5,255,872.50	2.25
28	688595	芯海科技	5,106,467.18	2.19
29	000725	京东方 A	5,061,762.00	2.17
30	300327	中颖电子	4,982,884.80	2.13
31	000568	泸州老窖	4,760,887.00	2.04
32	300075	数字政通	4,733,800.00	2.03
33	002484	江海股份	4,680,156.17	2.00

注：本报告期内，累计卖出股票金额以股票成交金额（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	471,250,884.81
卖出股票收入（成交）总额	478,539,717.26

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都以股票成交金额（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

注：

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 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 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 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。

**7.12.2 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。

**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	85,099.13
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	214,453.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	299,552.57

**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债。

**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

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 (%)
22,180	13,765.72	170,083.21	0.06	305,153,507.69	99.94

### 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	7,303.36	0.0024

### 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、基金投资和研发部门 负责人持有本开放式基金	0
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 (2005 年 6 月 16 日) 基金份额总额	603,405,465.83
本报告期期初基金份额总额	308,392,617.15
本报告期基金总申购份额	19,688,801.59
减：本报告期基金总赎回份额	22,757,827.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	305,323,590.90

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、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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内本基金管理人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
中泰证券	1	142,865,674.88	15.04	133,049.20	16.06	-
民生证券	2	142,595,010.25	15.01	132,799.14	16.03	-
长江证券	1	127,624,992.99	13.44	118,856.84	14.35	-
中信建投	1	107,573,331.14	11.33	100,182.62	12.09	-
招商证券	1	94,291,155.56	9.93	87,813.83	10.60	-
浙商证券	1	86,942,301.26	9.15	63,580.84	7.67	-
华福证券	2	82,396,681.00	8.68	60,256.01	7.27	-

东北证券	1	59,750,192.18	6.29	43,695.83	5.27	-
国泰君安	1	41,330,811.49	4.35	38,492.50	4.65	-
兴业证券	2	34,032,662.17	3.58	24,888.22	3.00	-
天风证券	1	17,016,058.74	1.79	12,443.85	1.50	-
华创证券	1	10,803,894.45	1.14	10,061.67	1.21	-
东兴证券	1	2,112,106.42	0.22	1,967.20	0.24	-
方正证券	1	455,729.54	0.05	333.26	0.04	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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。

2：本报告期内新增了国海证券的上海、深圳交易单元，以及天风证券的深圳交易单元；退租了光大证券的深圳交易单元。

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。

4：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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证	-	-	-	-	-	-

券						
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

注：注：本基金未租用证券公司交易单元进行除股票交易之外的其他证券投资。

## 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	中海分红增利混合型证券投资基金年度最后一日净值公告	证券时报	2023-1-1
2	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海证券有限责任公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	证券时报	2023-1-11
3	中海分红增利混合 2022 年第 4 季度报告	公司网站	2023-1-20
4	中海分红增利混合 2022 年年度报告	公司网站	2023-3-30
5	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司（银银平台）为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告	证券时报	2023-3-31
6	中海分红增利混合 2023 年第 1 季度报告	公司网站	2023-4-22
7	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	证券时报	2023-5-30
8	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	证券时报	2023-6-30

	申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告		
--	----------------------	--	--

## § 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中海基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》自 2023 年 8 月 24 日起，本基金管理费率由 1.50%/年调整为 1.20%/年，本基金托管费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海分红增利混合型证券投资基金的文件
- 2、中海分红增利混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海分红增利混合型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准国联基金管理有限公司更名为中海基金管理有限公司的文件
- 5、中海分红增利混合型证券投资基金证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 12.3 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 8 月 31 日