

中海信息产业精选混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 中海信息产业混合 |
| 基金主代码 | 000166 |
| 交易代码 | 000166 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 5 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 56,817,837.94 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于信息产业的上市公司股票，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 信息产业相关行业股票的界定</p> <p>本基金界定的信息产业相关行业或主题上市公司包括：</p> <p>属于传统信息产业的行业：主要包含申万一级行业中的电子、通信、传媒、计算机等一级行业。具体包含：</p> <p>① 电子信息相关行业和公司，包括计算机整机制造、计算机网络设备制造、电子计算机外部设备制造、电子计算机应用产品制造、家庭视听设备、测量仪器、</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>电子工业专用设备、电子元件、电子器件、电子信息机电产品、信息产品专用材料以及雷达等；</p> <p>② 通信设备和软件相关行业和公司，包括通信传输设备制造、通信交换设备制造、通信终端设备制造、移动通信设备制造、软件产品、系统集成制造和软件信息服务等；</p> <p>③ 传媒相关行业和公司，包括平面媒体、广播电视、电影动画、互联网和整合营销等；</p> <p>④ 计算机相关行业和公司，包括计算机制造业和计算机服务业，计算机制造业包含生产各种计算机系统、外围设备终端设备，以及有关装置、元件、器件和材料的制造。计算机服务业包括向用户提供各种技术服务和销售服务等。</p> <p>未来若由于技术进步、经济结构变化、政策环境变化导致本基金对信息产业的相关行业或主题界定范围发生变动的或出现为科学的行业分类标准的，本基金管理人将在审慎研究的基础上，重新界定本基金所覆盖的行业范围，并在更新的招募说明书中进行公告，而无需召开基金持有人大会。</p> <p>(2) 信息产业股票的投资策略</p> <p>本基金主要投资于信息产业相关行业上市公司的股票，投资比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金对信息产业的个股将采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>1) 定量方式</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。</p> <p>本基金考察的成长指标主要包括：主营收入增长率、净利润增长率。</p> <p>本基金考察的财务指标主要包括：净资产收益率、资产负债率。</p> <p>本基金考察的估值指标主要包括：市盈率、市盈率/净利增长率。</p> <p>2) 定性方式</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，在综合考察评估公司核心竞争优势的基础上，侧重对公司成长能力进行研究，重点投资在业内具有明显竞争力和比较优势的公司；公司治理结构完善、经营管理稳定的公司以及在产品、技术、资源等方面具有明显优势并能在快速成长的过程中不断提高市场占有率的公司。坚决规避治理混乱、管理效率低下的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期配置：基于宏观经济趋势性变化，自上而</p> |
|--|--|

下的资产配置。

利用宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析，根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估，最终确定投资组合的久期配置。

（2）期限结构配置：基于数量化模型，自上而下的资产配置。

在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

子弹组合，即使组合的现金流尽量集中分布；

杠铃组合，即使组合的现金流尽量呈两极分布；

梯形组合，即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

（3）债券类别配置/个券选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。

本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债等利率债券，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

个券选择：基于各个投资品种具体情况，自下而上的资产配置。

个券选择应遵循如下原则：

相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低品种。

流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。

4、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。在进行可转换债券筛选时，本基金将首先对可转换债券自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估；最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投

| | |
|---------------|---|
| | <p>资的可转换债券品种。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>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。首先，确定经济周期所处阶段，研究私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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>7、权证投资策略</p> <p>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>8、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，参与股指期货投资。本基金将通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，与现货组合进行匹配，采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将在股指期货套期保值过程中，定期测算投资组合与股指期货的相关性，根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金运作效率，降低投资组合的整体风险。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金是一只混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基</p> |

| | |
|-------|----------------|
| | 金。 |
| 基金管理人 | 中海基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年4月1日—2021年6月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -2,424,114.80 |
| 2. 本期利润 | 1,275,319.40 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0205 |
| 4. 期末基金资产净值 | 87,620,427.05 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.5421 |

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

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

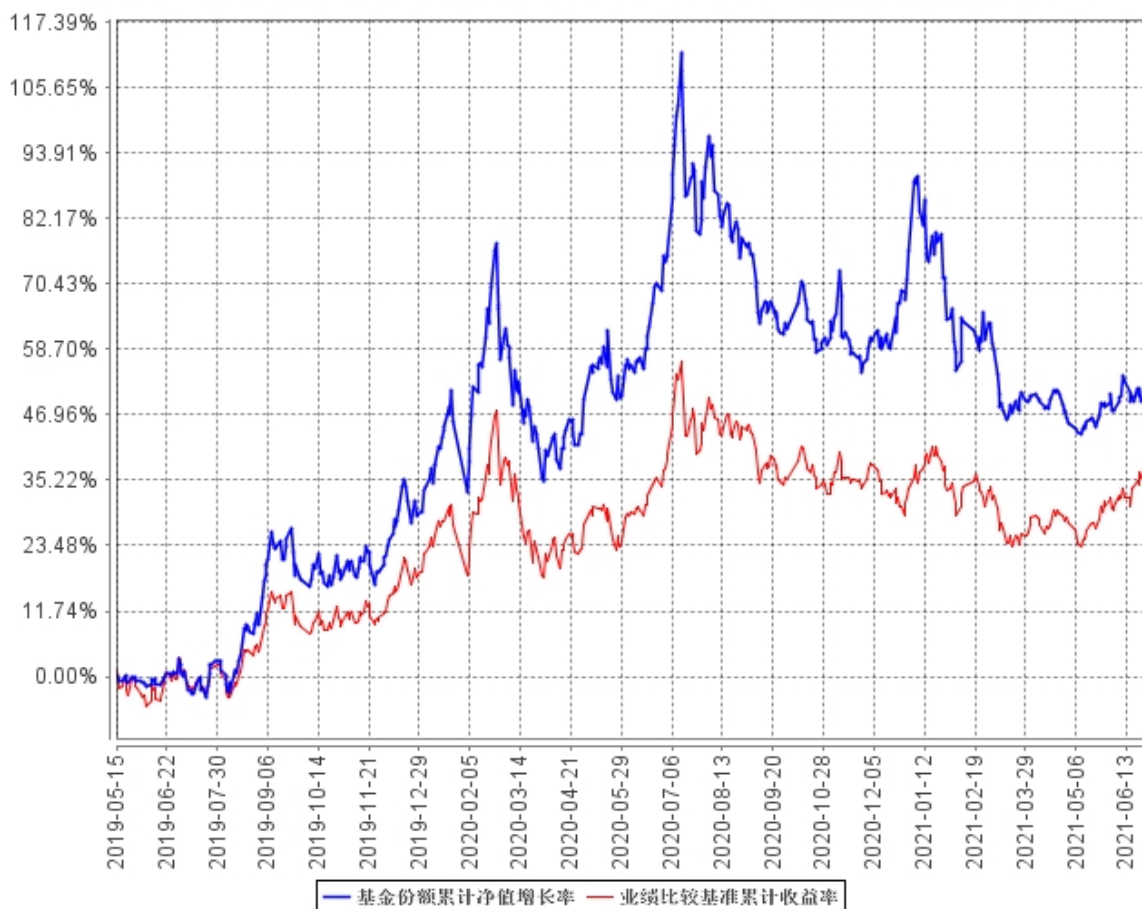
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 1.70% | 0.83% | 9.59% | 0.93% | -7.89% | -0.10% |
| 过去六个月 | -13.83% | 1.54% | 3.02% | 1.06% | -16.85% | 0.48% |
| 过去一年 | -13.35% | 1.70% | 0.78% | 1.21% | -14.13% | 0.49% |
| 自基金合同 生效起至今 | 52.05% | 1.80% | 37.94% | 1.41% | 14.11% | 0.39% |

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

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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-----------------|-----------------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘俊 | 权益投资部权益投资副总监、本基金基金经理、中海积极收益灵活配置混合型证券投资 | 2013 年 7 月 31 日 | 2021 年 6 月 19 日 | 18 年 | 刘俊先生，复旦大学金融学专业博士。历任上海申银万国证券研究所有限公司策略研究部策略分析师、海通证券股份有限公司战略合作与并购部高级项目经理。2007 年 3 月进入本公司工 |

| | | | | | |
|-----|--|----------|---|------|---|
| | <p>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 环保新能 源主题灵 活配置混 合型证 券投资基 金基金经 理、中海 医疗新能 源主题灵 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</p> | | | | <p>作，曾任产品开发总 监，现任权益投资部 权益投资副总监。 2010 年 3 月至 2015 年 8 月任中海稳健收 益债券型证券投资基 金基金经理，2015 年 4 月至 2017 年 6 月任 中海安鑫宝 1 号保本 混合型证券投资基金 基金经理，2012 年 6 月至 2019 年 4 月任 中海优势精选灵活配 置混合型证券投资基 金基金经理，2017 年 4 月至 2021 年 2 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 2021 年 2 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 7 月 至 2021 年 6 月任中 海信息产业精选混合 型证券投资基金基 金经理，2014 年 5 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，2015 年 12 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， 2018 年 6 月至今任 中海环保新能源主 题灵活配置混合 型证券投资基 金基金经理， 2020 年 5 月至今任 中海医疗保健主 题股票型证 券投资基金基 金经理，2021 年 4 月至今任中海海 誉混合型证 券投资基金基 金经理。</p> |
| 姚晨曦 | 本基金基 | 2021 年 6 | - | 14 年 | 姚晨曦先生，复旦大 |

| | | | | |
|--|--|--------|--|---|
| | 金经理、 中海消费 主题精选 混合型证 券投资基 金基金经 理、中海 能源策略 混合型证 券投资基 金基金经 理、中海 沪港深价 值优选灵 活配置混 合型证券 投资基金 基金经理 | 月 19 日 | | 学金融学专业硕士。 曾任上海申银万国证 券研究所二级分析师。 2009 年 5 月进入本公 司工作，历任分析师、 分析师兼基金经理助 理。2015 年 4 月至今 任中海消费主题精选 混合型证券投资基金 基金经理，2015 年 4 月至今任中海能源策 略混合型证券投资基 金基金经理，2016 年 4 月至今任中海沪港 深价值优选灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理，2021 年 6 月至今任中海信息产 业精选混合型证券投 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。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度，虽然新冠疫情在变异病毒快速传播下依然在全球肆虐，但伴随着疫苗接种的持续展开，全球经济继续呈现稳步复苏的局面。同时，疫情下供应链持续失衡叠加货币持续宽松所导致的通胀问题也开始显现，各国央行都不得不严阵以待，流动性拐点成为悬在全球金融市场之上的达摩斯之剑。

国内方面，经济依然保持了相对平稳的态势，出口和工业投资表现相对较好，消费和基建投资则略显低迷。政策方面，虽然紧信用依然延续，但“稳”字当头的货币政策好于市场预期。

由于流动性预期改善，A 股市场在 1 季度调整之后本季度稳步走高，周期、消费和成长股轮番表现，但拉长了看依然是新能源、半导体、医美等行业景气度高涨、公司业绩增速快的细分板块拥有持续的赚钱效应。

本季度内，权益资产最初主要配置为计算机软件行业，后期慢慢往半导体、电子、通信等领域调整、均衡配置。本基金未来定位在以信息行业为主的新兴产业投资，在新一轮科技革命中积极寻找投资机会。下半年，我们会优先配置以半导体、新能源、云服务等为代表的行业景气度高、有业绩兑现的细分领域，同时积极布局未来 1-2 年有望实现爆发的创新领域。

4.5 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 1.5421 元(累计净值 2.2209 元)。报告期内本基金

净值增长率为 1.70%，低于业绩比较基准 7.89 个百分点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 78,840,225.62 | 84.32 |
| | 其中：股票 | 78,840,225.62 | 84.32 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,900.00 | 0.01 |
| | 其中：债券 | 4,900.00 | 0.01 |
| | 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 | 10,136,059.01 | 10.84 |
| 8 | 其他资产 | 4,520,821.32 | 4.83 |
| 9 | 合计 | 93,502,005.95 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 52,405,005.76 | 59.81 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,662.00 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 11,014.44 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 23,826,463.42 | 27.19 |
| 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 | 2,593,080.00 | 2.96 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 78,840,225.62 | 89.98 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002624 | 完美世界 | 171,710 | 4,105,586.10 | 4.69 |
| 2 | 002230 | 科大讯飞 | 52,900 | 3,574,982.00 | 4.08 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 111,100 | 3,560,755.00 | 4.06 |
| 4 | 600418 | 江淮汽车 | 277,600 | 3,450,568.00 | 3.94 |
| 5 | 688036 | 传音控股 | 16,118 | 3,376,721.00 | 3.85 |
| 6 | 300219 | 鸿利智汇 | 253,600 | 3,347,520.00 | 3.82 |
| 7 | 603986 | 兆易创新 | 14,400 | 2,705,760.00 | 3.09 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 41,900 | 2,702,550.00 | 3.08 |
| 9 | 300413 | 芒果超媒 | 37,800 | 2,593,080.00 | 2.96 |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 9,300 | 2,579,634.00 | 2.94 |

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金在本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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） | 4,900.00 | 0.01 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,900.00 | 0.01 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|----------|--------------|
| 1 | 127038 | 国微转债 | 49 | 4,900.00 | 0.01 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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除江淮汽车受到监管处罚外，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。

江淮汽车有限公司于 2021 年 6 月 22 日因生产的部分自卸汽车质量与证书不符、生产场所未认证等违规行为，公司未依法履行职责，受到质量技术监督局处以人民币十万元和十二万元的罚款。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 123,638.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,886,571.66 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,843.18 |
| 5 | 应收申购款 | 505,768.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 4,520,821.32 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 65,420,787.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,063,667.25 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 18,666,616.66 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 56,817,837.94 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海安鑫保本混合型证券投资基金的文件
- 2、中海信息产业精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海信息产业精选混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海信息产业精选混合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

8.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

8.3 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 7 月 21 日