

中海增强收益债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 15 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中海增强收益债券
基金主代码	395011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 23 日
报告期末基金份额总额	115,364,566.31 份
投资目标	在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定收益。
投资策略	<p>1、一级资产配置</p> <p>本基金采取自上而下的分析方法，比较不同市场和金融工具的收益及风险特征，动态确定基金资产在固定收益类资产和权益类资产的配置比例。</p> <p>2、纯债投资策略</p> <p>(1) 久期配置：基于宏观经济周期的变化趋势，预测利率变动的方向。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，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，确定投资组合的久期配置。</p> <p>(2) 期限结构配置：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，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。</p> <p>(3) 债券类别配置/个券选择：个券选择遵循的原则包括：相对价值原则即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。</p>

	<p>(4)其它交易策略: 包括短期资金运用和跨市场套利等。</p> <p>3、可转换债券投资策略 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; 最后确定可投资的品种。</p> <p>4、股票投资策略 本基金股票二级市场投资采用红利精选投资策略, 通过运用分红模型和分红潜力模型, 精选出现金股息率高、分红潜力强并具有成长性的优质上市公司, 结合投研团队的综合判断, 构造股票投资组合。</p> <p>5、权证投资策略 本基金在证监会允许的范围内适度投资权证, 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权证进行适量配置。</p>	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率×90%+上证红利指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金, 为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金, 高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	中海增强收益债券 A	中海增强收益债券 C
下属分级基金的交易代码	395011	395012
报告期末下属分级基金的份额总额	113, 352, 139. 79 份	2, 012, 426. 52 份

§ 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	中海增强收益债券 A	中海增强收益债券 C
1. 本期已实现收益	-57, 095. 20	-2, 964. 25
2. 本期利润	-799, 507. 65	-15, 486. 93
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0071	-0. 0076
4. 期末基金资产净值	127, 366, 897. 50	2, 172, 662. 88
5. 期末基金份额净值	1. 124	1. 080

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

中海增强收益债券 A

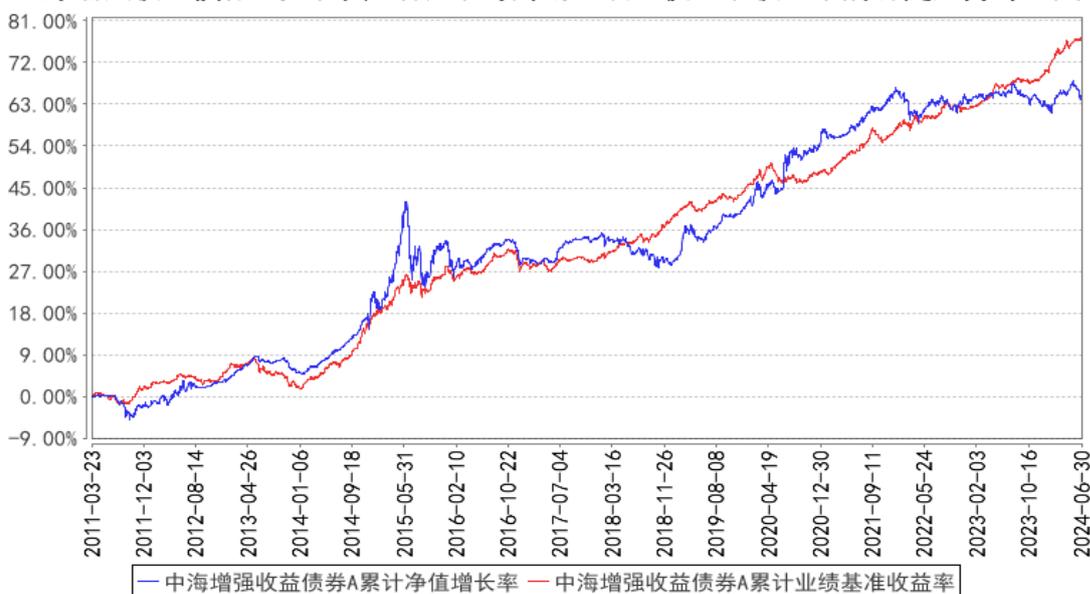
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.62%	0.19%	1.70%	0.12%	-2.32%	0.07%
过去六个月	0.45%	0.20%	4.61%	0.13%	-4.16%	0.07%
过去一年	-0.34%	0.18%	6.35%	0.11%	-6.69%	0.07%
过去三年	3.56%	0.19%	15.93%	0.12%	-12.37%	0.07%
过去五年	21.50%	0.22%	25.46%	0.13%	-3.96%	0.09%
自基金合同生效起至今	64.47%	0.29%	77.41%	0.16%	-12.94%	0.13%

中海增强收益债券 C

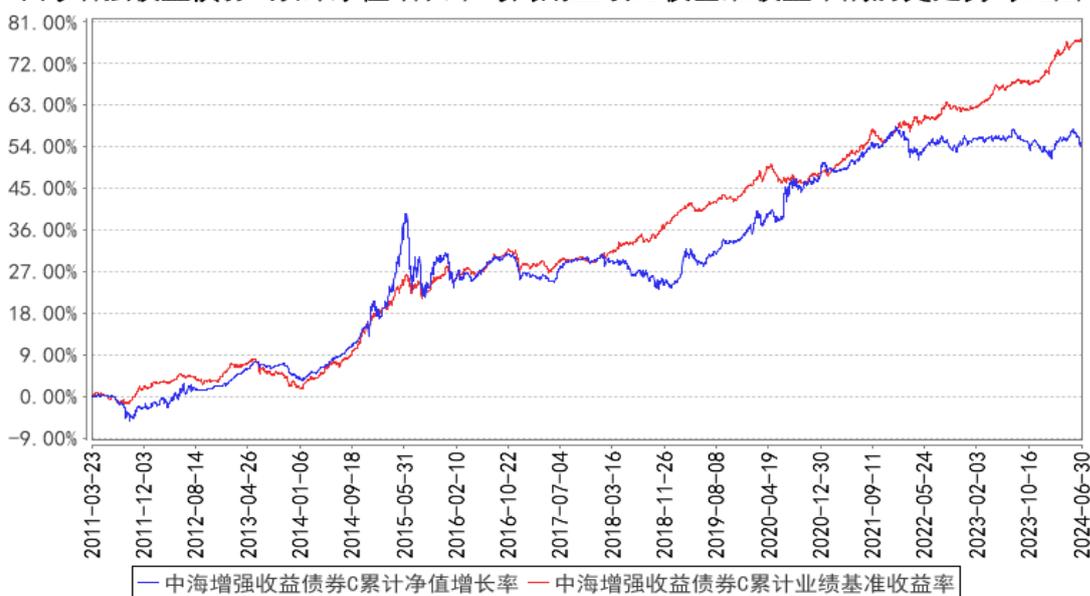
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.64%	0.19%	1.70%	0.12%	-2.34%	0.07%
过去六个月	0.28%	0.20%	4.61%	0.13%	-4.33%	0.07%
过去一年	-0.63%	0.18%	6.35%	0.11%	-6.98%	0.07%
过去三年	2.10%	0.19%	15.93%	0.12%	-13.83%	0.07%
过去五年	18.79%	0.22%	25.46%	0.13%	-6.67%	0.09%
自基金合同生效起至今	54.57%	0.29%	77.41%	0.16%	-22.84%	0.13%

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

中海增强收益债券A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



中海增强收益债券C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		
殷婧	本基金基金经理	2021年11月5日	-	11年	殷婧女士，厦门大学应用经济学(保险学)专业硕士，中级经济师。历任华宝证券股份有限公司资产管理部投资助理、交易主管、固定收益投资经理。2021年9月进入本公司工作，现任基金经理。2021年11月至今任中海增强收益债券型证券投资

					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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年二季度，全球经济增长呈现出较强的韧性，制造业、服务业景气度回升，但整体修复节奏存在分化。美国增长动能小幅弱化，通胀超预期下行，降息预期走鹰；美债利率震荡走高，美元指数先强后弱。欧洲仍处于“弱修复”区间，欧央行率先降息落地，英央行维持利率不变，降息预期升温。日本经济景气度回升，日元汇率保持疲软，日央行延后公布缩债计划，存在加息可能。在产业链重塑及经济转型升级等推动下，新兴市场经济小幅改善。

二季度国内经济仍在修复，结构上有所分化，生产强于需求，其中工业、出口增速显著高于市场预期，消费和投资则低于预期。金融数据方面，需求端恢复速度较慢，叠加“取消手工补息”、“金融数据挤水分”等，信贷、社融数据较为疲软。物价方面，CPI、PPI 虽然有基数效应，但整体修复低于预期，工业企业利润亦缓慢修复。

货币政策新框架正在形成。一季度货币政策执行报告整体延续了“灵活适度，精准有效”的总基调，新增“避免资金沉淀空转”、“防范高息揽储行为”及“促进社会综合融资成本稳中有降”等表述，引导市场淡化对信贷总量的关注，强调“发挥中央银行政策利率引导作用”。6 月陆家嘴论坛上，央行行长提出将继续坚持支持性的货币政策立场，加强逆周期和跨周期调节，逐步淡化对数量目标的关注，转为以价格型调控为主，7 天逆回购利率或将成为主要的政策利率，未来利率走廊的宽度或将缩窄；货币政策后续仍不具备收紧基础，贷款利率下行空间仍在，对长期国债收益率依然以提示风险为主。

债券市场震荡走强，波动幅度收窄。二季度在禁止“手工补息”链条下，非银宽松格局延续，资金面分层阶段性弱化；央行多次提示长债风险，叠加稳地产预期升温 and 超长债供给落地，债市经历短暂调整，收益率曲线总体呈下行趋势；季末各期限品种利差压缩极致，基本面弱修复和央行资金面宽松预期下 10 年和 30 年国债收益率逐步下探直至突破前低。信用债方面，资产荒边际有所缓解，期限利差明显下行，地方政府化债进展顺利，市场对城投债和金融债仍较为青睐。

权益和可转债市场，4 月转债跟随正股市场稳步修复，估值震荡抬升。5 月初，随着地产优化政策持续出台以及业绩负面预期落地，权益市场小幅上涨；随后，正股保持在高位震荡，同时板块轮动加剧，地产、电力、光伏、煤炭等行业相继领涨，但市场缺乏主线，5 月末正股开始回调，但转债呈现出独立行情，6 月权益市场震荡下行，转债跟随下跌，此外，转债跟踪评级陆续出台，部分转债评级调降，退市新政亦带动投资人对转债退市担忧，低价转债带动转债整体补跌。往后看，三中全会定调有望抬升市场预期，助力风险偏好回升，关注政策层面的预期引导，关注中报业绩超预期的标的。

报告期内本基金规模变化不大，组合保持了权益类资产的配置，依然看好权益资产当前阶段

的配置价值，看好美联储加息后周期下人民币汇率和权益资产表现，看好国内持续政策释放后的内在基本面复苏和资产价格的修复。纯债配置以利率债和高等级信用债为主，严控信用风险，组合整体久期略有增加。可转债方面，可转债仓位变动不大，但调整了转债的持仓结构，综合优选转债本身的性价比、信用资质、对应正股的业绩表现和波动率，以及条款博弈等。当前信用利差处于历史较低位置，通过精挑细选部分可转债，用做信用债替代，做好组合的增厚收益。权益方面，指数和估值均处于底部区域，结合外部环境逐步改善、财政政策力促经济回升向好、企业盈利和市场信心修复，权益资产具有一定的性价比，继续持有。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 1.124 元（累计净值 1.576 元），报告期内本基金 A 类净值增长率为-0.62%，低于业绩比较基准 2.32 个百分点；本基金 C 类份额净值 1.080 元（累计净值 1.496 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-0.64%，低于业绩比较基准 2.34 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,083,014.00	12.09
	其中：股票	17,083,014.00	12.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,724,991.24	86.14
	其中：债券	121,724,991.24	86.14
	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	710,061.61	0.50
8	其他资产	1,789,279.41	1.27
9	合计	141,307,346.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	436,480.00	0.34
B	采矿业	114,996.00	0.09
C	制造业	8,512,778.00	6.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	456,400.00	0.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,226,700.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	731,500.00	0.56
J	金融业	3,257,600.00	2.51
K	房地产业	831,600.00	0.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	804,800.00	0.62
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	710,160.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	17,083,014.00	13.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	601318	中国平安	30,000	1,240,800.00	0.96
2	601111	中国国航	140,000	1,033,200.00	0.80
3	600519	贵州茅台	700	1,027,173.00	0.79
4	601688	华泰证券	80,000	991,200.00	0.77
5	002179	中航光电	24,000	913,200.00	0.70
6	000002	万科 A	120,000	831,600.00	0.64
7	000858	五粮液	6,300	806,652.00	0.62
8	300012	华测检测	80,000	804,800.00	0.62
9	300413	芒果超媒	35,000	731,500.00	0.56
10	600309	万华化学	9,000	727,740.00	0.56

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	10,149,542.88	7.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,646,246.15	29.83
	其中：政策性金融债	10,434,904.11	8.06
4	企业债券	41,840,016.71	32.30
5	企业短期融资券	2,013,300.82	1.55
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	29,075,884.68	22.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,724,991.24	93.97

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	092280033	22 宁波银行二级资本债 01	100,000	10,607,121.31	8.19
2	2128025	21 建设银行二级 01	100,000	10,588,836.07	8.17
3	230210	23 国开 10	100,000	10,434,904.11	8.06
4	137729	22 华安 G2	100,000	10,258,096.99	7.92
5	115105	23 海通 06	100,000	10,240,624.66	7.91

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。宁波银行股份有限公司、宁波通商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。海通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

本基金投资上述发行主体的决策流程符合本基金管理人投资管理制度的相关规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,811.08
2	应收证券清算款	1,769,587.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	881.10
6	其他应收款	-
-	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,789,279.41

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	6,065,145.34	4.68
2	110064	建工转债	1,673,754.66	1.29
3	128116	瑞达转债	1,370,308.27	1.06
4	110081	闻泰转债	991,022.47	0.77
5	123179	立高转债	817,613.59	0.63

6	127085	韵达转债	770,707.10	0.59
7	113050	南银转债	752,472.49	0.58
8	110075	南航转债	743,904.82	0.57
9	111010	立昂转债	740,388.72	0.57
10	118003	华兴转债	731,634.25	0.56
11	127034	绿茵转债	683,226.85	0.53
12	113058	友发转债	664,483.57	0.51
13	113675	新 23 转债	615,604.45	0.48
14	113053	隆 22 转债	610,502.14	0.47
15	127069	小熊转债	605,423.84	0.47
16	118022	锂科转债	595,249.32	0.46
17	113060	浙 22 转债	590,483.12	0.46
18	128132	交建转债	582,200.68	0.45
19	123145	药石转债	565,989.04	0.44
20	110076	华海转债	543,011.64	0.42
21	113641	华友转债	507,335.07	0.39
22	118034	晶能转债	488,115.62	0.38
23	128131	崇达转 2	459,929.72	0.36
24	118013	道通转债	456,809.32	0.35
25	110082	宏发转债	446,876.71	0.34
26	111014	李子转债	445,754.63	0.34
27	127046	百润转债	432,810.96	0.33
28	110085	通 22 转债	423,068.05	0.33
29	118005	天奈转债	419,536.85	0.32
30	110087	天业转债	404,722.08	0.31
31	110079	杭银转债	362,301.70	0.28
32	127071	天箭转债	342,467.42	0.26
33	128135	洽洽转债	340,575.21	0.26
34	113056	重银转债	325,377.53	0.25
35	113655	欧 22 转债	324,034.93	0.25
36	113046	金田转债	312,396.16	0.24
37	127049	希望转 2	310,507.73	0.24
38	111009	盛泰转债	237,691.99	0.18
39	123133	佩蒂转债	225,997.26	0.17
40	123154	火星转债	212,423.29	0.16
41	127017	万青转债	211,461.33	0.16
42	113605	大参转债	170,700.00	0.13
43	123174	精锻转债	107,499.04	0.08
44	113661	福 22 转债	106,355.32	0.08
45	113650	博 22 转债	82,280.00	0.06
46	123091	长海转债	68,377.74	0.05
47	123151	康医转债	61,272.00	0.05

48	123076	强力转债	54,648.22	0.04
49	113670	金 23 转债	21,432.44	0.02

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海增强收益债券 A	中海增强收益债券 C
报告期期初基金份额总额	113,316,539.25	2,090,073.53
报告期期间基金总申购份额	44,990.31	40,411.59
减：报告期期间基金总赎回份额	9,389.77	118,058.60
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	113,352,139.79	2,012,426.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内，基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-04-01 至 2024-06-30	80,774,636.51	0.00	0.00	80,774,636.51	70.02
产品特有风险							

1、持有人大会投票权集中的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2、巨额赎回的风险

持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额。

3、基金规模较小导致的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

4、基金净值大幅波动的风险

持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海增强收益债券型证券投资基金的文件
- 2、中海增强收益债券型证券投资基金基金合同
- 3、中海增强收益债券型证券投资基金托管协议
- 4、中海增强收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日