

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（中海沪港深价值优选混合 A 份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 09 月 23 日

送出日期：2024 年 09 月 26 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决策前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中海沪港深价值优选混合	基金代码	002214
下属基金简称	中海沪港深价值优选混合 A	下属基金交易代码	002214
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
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	姚炜	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 07 月 30 日
		证券从业日期	2008 年 07 月 01 日
基金经理	时奕	开始担任本基金基金经理的日期	2024 年 09 月 24 日
		证券从业日期	2017 年 07 月 01 日

注：中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金于 2024 年 1 月 12 日新增 C 类基金份额。

二、基金投资与净值表现

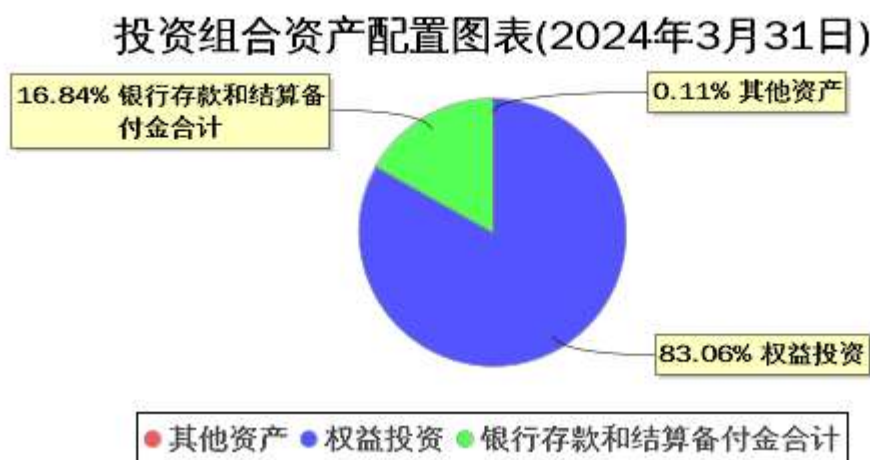
（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金招募说明书的“基金的投资”章节了解详细情况。

投资目标	本基金通过对国家政策导向以及行业发展趋势的研究，在沪深港三地证券市场中优选出具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严格控制投资组合风险的前提下力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券等）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 0-95%（其中投资于国

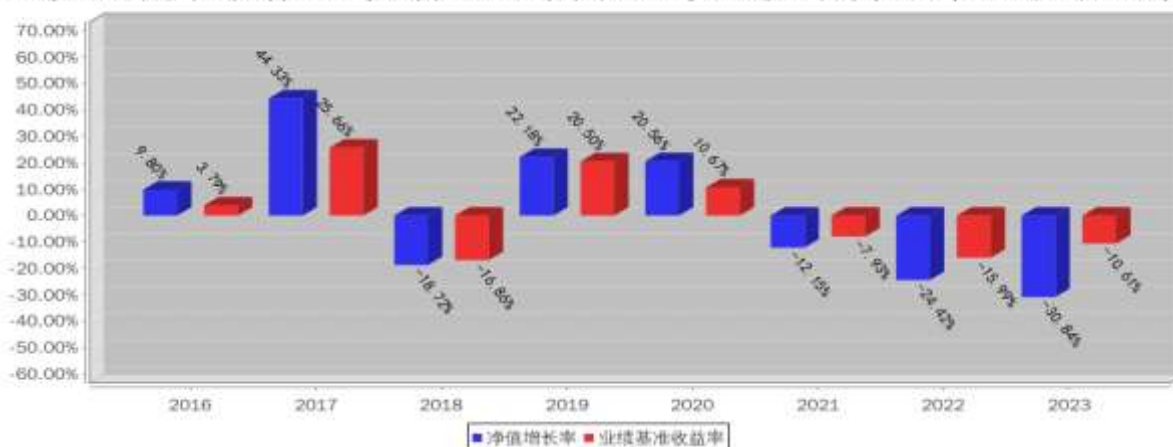
	内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略：（1）A 股投资策略：1）行业精选策略；2）股票精选策略：① 定量方式；② 定性方式；（2）港股投资策略：1）主题及行业发掘；2）股票精选策略；3、债券投资策略：（1）久期配置；（2）期限结构配置；（3）债券类别配置/个券选择；4、资产支持证券投资策略；5、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%+中证全债指数×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

中海沪港深价值优选混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：数据截止日期为 2023 年 12 月 31 日，基金过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	1.50%	非养老金客户
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	1.00%	非养老金客户
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.60%	非养老金客户
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	非养老金客户
	M < 1,000,000	0.60%	养老金客户
	1,000,000 ≤ M < 3,000,000	0.30%	养老金客户
	3,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.12%	养老金客户
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 日	1.50%	-
	7 日 ≤ N < 30 日	0.75%	-
	30 日 ≤ N < 360 日	0.50%	-
	360 日 ≤ N < 720 日	0.25%	-
	N ≥ 720 日	0.00%	-

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	26,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用等费用	相关服务机构

注：上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

中海沪港深价值优选混合 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.59%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金主要风险如下：

1、本基金特有风险

本基金为主动管理灵活配置混合型基金，其投资风格和投资范围决定了本基金具有如下特有风险：

1) 策略风险：本基金根据市场环境的变化，选取相应的投资策略。此分析过程主要是建立在一系列的假设基础和定性及定量指标之上的，评估的结果可能与市场变化的实际发展情况、市场对股票的认知和理解存在差异。

2) 港股通机制下的港股投资风险：本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括港股通机制下允许投资的香港联合交易所（以下简称：“香港联交所”或“联交所”）上市的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险，包括但不限于：

（1）市场联动的风险：

与内地 A 股市场相比，港股市场的资金流动更为自由，而且港股市场对短期内国际资金的流动较为敏感，尤其是国际金融市场发生重大波动时，石油、贵金属等大宗商品和外汇（包括日元套利交易）等市场的剧烈波动均可能导致国际资金流向在短期内发生重大变化，从而使港股走势产生大幅波动。本基金在参与港股市场投资时会面临更多的因国际金融市场剧烈波动而产生的风险。

（2）股价波动的风险：

香港联交所实行 T+0 回转交易制度，即投资者当天买入的股票可以当天卖出，同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金持仓的波动风险可能相对较大。

（3）港股通额度限制带来的投资风险：

现行的港股通规则对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

（4）港股通标的股票调整带来的风险：

现行的港股通规则对本基金允许买卖的港股通标的股票存在一定的范围限制，对于被调出港股通标的股票名单的股票，自调整之日起，港股通投资者将不得再行买入；本基金可能存在因为港股通标的股票的调整影响投资计划进而降低基金收益的风险。

（5）港股通交易日设定的风险：

由于内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，所以存在即使香港联交所开市，本基金也无法进行港股通交易，港股不能及时卖出的情形。这可能导致本基金存在因交易日不连贯所带来的价格波动影响港股投资并给基金利益造成损失的风险。

（6）港股通规则下权益证券存在交易限制的风险：

本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入（上交所另有规定的除外）；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因权益证券的交易限制影响基金利益甚至造成损失的风险。

（7）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险：

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则，在退市制度方面，香港联交所的制度规定与 A 股也并不相同，联交所没有设置风险警示板，香

港交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权。这使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。因此本基金存在可能由于停牌、退市等制度性差异导致所持个股的投资交易受到影响并给基金带来损失的风险。

(8) 港股通规则变动带来的风险:

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资,受港股通规则的限制和影响;本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

3) 汇率风险: 本基金将投资港股通标的股票,在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率,并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终,中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇,将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易,确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

2、市场风险

本基金为混合型证券投资基金,投资组合主要由股票等权益类资产和债券等固定收益类资产组成,证券市场价格受到各种因素的影响,导致基金收益水平变化而产生风险,主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、通货膨胀风险、信用风险和再投资风险。

3、开放式基金共有的风险如合规性风险、管理风险、流动性风险和其他风险。

4、投资科创板股票的特有风险

本基金资产投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

(二) 重要提示

中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2015 年 11 月 25 日证监许可【2015】2745 号文注册募集。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金风险收益特征的表述是代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构及其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价,不同的销售机构采用的评价方法不同,因此销售机构的风险等级评价与本文件中风险收益特征的表述可能存在不同。投资者在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见中海基金官方网站【www.zhfund.com】【客服电话:400-888-9788】

《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料