

# 中海可转换债券债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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

报告送出日期：2024 年 1 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 18 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	中海可转债债券
基金主代码	000003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 20 日
报告期末基金份额总额	64,834,667.78 份
投资目标	本基金以可转换债券为主要投资目标，在严格控制投资组合风险的基础上，充分把握可转换债券兼具股性和债性的风险收益特征，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、整体资产配置策略</p> <p>在严格风控基础上，通过对国内外宏观经济形势、证券市场估值水平、财政及货币政策以及信用风险情况等因素的综合研判，预测各大类资产（可转债、股票、债券等）在不同经济周期阶段内的风险收益特征，进而在大类资产之间进行整体动态配置，力争为基金资产获取持续稳健回报。</p> <p>2、可转换债券投资策略</p> <p>（1）一级市场</p> <p>将积极参与公司基本面优秀、发行条款较好、申购预期收益较高的可转债一级市场申购，上市后根据个券即时市场价格等因素做出持有或卖出的决策。</p> <p>（2）二级市场</p> <p>将结合历史估值情景，综合运用基本面分析、理论定价分析、相对价值分析等方法，在严格控制风险的前提下，把握可转换债券的价值走向，精选个券，力争实现更高</p>

	<p>的投资收益。同时，由于可转债一般还设置提前赎回权、向下修正权、提前回售权等条款，因此，还需要详细分析各条款本身的潜在价值，力争抓住每一次条款博弈投资机会。另外，由于可转债和标的股票之间可能存在风险相对较小的套利机会，因此，还需要密切关注相应投资机会。</p> <p>3、普通债券投资策略 将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值目标。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略 对中小企业私募债的投资主要以信用品种投资策略为基础，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，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对中小企业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。</p> <p>5、股票投资策略 (1) 一级市场 作为固定收益类产品，将充分依靠公司研究平台和股票估值体系，深入研究首次发行 (IPO) 股票的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。</p> <p>(2) 二级市场 本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方法，优先选择具有相对比较优势的同时估值水平相对较低的优质上市公司进行投资。定性分析主要包括：公司治理结构、自主知识产权、品牌影响力、市场定价能力、成本控制能力等。定量分析主要包括：估值水平指标、资产质量指标、各种财务指标等。</p>	
业绩比较基准	$\text{中信标普可转债指数收益率} \times 70\% + \text{中证综合债券指数收益率} \times 20\% + \text{上证红利指数} \times 10\%$	
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险、中低预期收益品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。</p>	
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	
下属分级基金的基金简称	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
下属分级基金的交易代码	000003	000004
报告期末下属分级基金的份额总额	36,490,393.34 份	28,344,274.44 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
1. 本期已实现收益	-229,079.14	-211,337.61
2. 本期利润	-444,027.99	-424,205.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0134	-0.0147
4. 期末基金资产净值	29,292,395.50	22,394,239.52
5. 期末基金份额净值	0.803	0.790

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

中海可转债债券 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	-1.71%	0.59%	-2.38%	0.32%	0.67%	0.27%
过去六个月	-4.06%	0.55%	-2.44%	0.29%	-1.62%	0.26%
过去一年	-1.95%	0.52%	1.10%	0.31%	-3.05%	0.21%
过去三年	-13.84%	0.70%	9.62%	0.45%	-23.46%	0.25%
过去五年	26.86%	1.01%	37.86%	0.51%	-11.00%	0.50%
自基金合同生效起至今	-5.59%	1.22%	50.07%	0.90%	-55.66%	0.32%

中海可转债债券 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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-1.86%	0.57%	-2.38%	0.32%	0.52%	0.25%
过去六个月	-4.36%	0.54%	-2.44%	0.29%	-1.92%	0.25%
过去一年	-2.35%	0.52%	1.10%	0.31%	-3.45%	0.21%
过去三年	-14.96%	0.70%	9.62%	0.45%	-24.58%	0.25%
过去五年	24.80%	1.01%	37.86%	0.51%	-13.06%	0.50%
自基金合同生效起至今	-7.12%	1.22%	50.07%	0.90%	-57.19%	0.32%

### 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率变动的比较

中海可转债债券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





## §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		
章俊	本基金基金经理、中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理、中海海颐混合型证券投资基金基金经理	2021年9月4日	-	11年	章俊女士，上海海事大学国际贸易学专业硕士。历任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信用评级分析师、长生人寿保险有限公司信用评估经理。2016年10月进入本公司工作，曾任债券研究员、高级债券研究员、高级债券研究员兼基金经理助理，现任基金经理。2021年2月至2021年6月任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2021年9月至2022年11月任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理，2021年9月至2022年11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，2021年9月至2022年11月任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2021年2月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2021年9月至今任中海可转债债券型证券投资基金基金经理，2021年11月至今任中海海颐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

2023 年四季度海外方面，全球经济放缓，美国经济先有较强韧性，而后亦有所放缓，通胀水

平从高点降至偏高水平，欧美央行加息周期结束，美联储初现“鸽派”态度，市场开始交易明年降息预期，美债利率快速下降，美股震荡上涨，美元指数走弱，人民币汇率转而升值。

国内方面，经济继续低位徘徊，内需整体仍然偏弱，通胀延续负增长。10月，生产端低位改善，规模以上工业增加值同比增长超预期，或与库存低有关，需求端地产继续拖累，基建高位走弱，制造业平稳略放缓，社零数据虽超预期但增速动能放缓。11月低基数推升经济同比指标，国内生产相对平稳，但剔除基数效应后的消费、投资和出口等环比增速均处于近年来较低水平。12月 PMI 延续回落，制造业动能放缓，经济或仍在低位徘徊。政策方面，经济弱现实背景下，政策逆周期调控力度打开，但调控力度相对温和。货币政策方面，总基调维持精准有力，强调信贷结构调整。财政政策进一步发力，四季度地方一揽子化债方案逐渐落地，10月底1万亿增发国债重启发行。12月，重磅会议中央召开经济工作会召开，会议强调“以进促稳、先立后破”，凸显了防风险的底线思维，经济求进的方向主要在转型，经济的长期目标旨在高质量发展。

金融市场方面，股市延续下跌，债市震荡上涨。尽管国内方面政策持续发力，地产、财政等需求端刺激政策不断发力，海外方面美债利率下行，全球流动性紧缩预期缓解，但是，四季度国内经济延续低迷，中央经济工作会召开后政策定力较强，权益市场延续下跌走势。其中上证指数累计下跌 4.36%，创业板指累计下跌 5.62%。行业方面，煤炭、电子、农林牧渔、医药生物和公用事业等行业表现尚可，而美容护理、房地产、建筑材料、商贸零售和电力设备等行业表现较差。债市震荡上涨。10月资金偏紧，万亿特别国债发行，稳增长发力，10年期国债收益率上行至 2.72%左右。11月基本面内生动能偏弱，但“房企白名单”等地产融资端利好政策密集出台，债券收益率在 2.64%-2.72%间震荡徘徊。12月央行呵护跨年资金面，中央经济工作会议强刺激信号有限，存款利率下调带动降息预期升温，债市走强，10年期国债收益率下破 2.60%。转债市场方面，受季度内权益指数下行影响，中证转债指数同样震荡下跌，季度内累计涨跌幅为-0.65%。

季度内，本基金整体操作平稳。可转债投资方面，仍然坚持自上而下和自下而上相结合的方式，挑选基本面相对优质且估值合理的标的。股票投资方面，重点配置有长期竞争力和业绩持续性的公司，行业相对均衡。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值 0.803 元（累计净值 1.013 元），报告期内本基金 A 类净值增长率为-1.71%，高于业绩比较基准 0.67 个百分点；本基金 C 类份额净值 0.790 元（累计净值 1.000 元），报告期内本基金 C 类净值增长率为-1.86%，高于业绩比较基准 0.52 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



自 2023 年 10 月 1 日至 11 月 27 日期间, 本基金曾出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## §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	5,627,618.44	10.87
	其中：股票	5,627,618.44	10.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,948,942.26	84.86
	其中：债券	43,948,942.26	84.86
	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	-249.94	-0.00
	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	666,098.72	1.29
8	其他资产	1,545,326.98	2.98
9	合计	51,787,736.46	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,423,422.44	10.49
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	-	-
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	204,196.00	0.40
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	-	-

0	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	5,627,618.44	10.89

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	688012	中微公司	4,669	717,158.40	1.39
2	603986	兆易创新	6,800	628,252.00	1.22
3	600519	贵州茅台	300	517,800.00	1.00
4	300124	汇川技术	7,500	473,550.00	0.92
5	002475	立讯精密	11,600	399,620.00	0.77
6	002415	海康威视	10,400	361,088.00	0.70
7	000100	TCL 科技	69,080	297,044.00	0.57
8	002241	歌尔股份	13,800	289,938.00	0.56
9	688320	禾川科技	6,435	263,835.00	0.51
10	600584	长电科技	8,600	256,796.00	0.50

### 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	2,752,458.41	5.33
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）	41,196,483.85	79.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,948,942.26	85.03

### 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	118018	瑞科转债	28,360	3,233,585.44	6.26
2	019694	23 国债 01	27,000	2,752,458.41	5.33

3	113637	华翔转债	19,160	2,325,485.95	4.50
4	123142	申昊转债	16,540	1,958,281.62	3.79
5	113655	欧 22 转债	16,830	1,771,917.73	3.43

## 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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	7,942.27
2	应收证券清算款	1,533,844.43

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,540.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,545,326.98

#### 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	118018	瑞科转债	3,233,585.44	6.26
2	113637	华翔转债	2,325,485.95	4.50
3	123142	申昊转债	1,958,281.62	3.79
4	113655	欧 22 转债	1,771,917.73	3.43
5	111010	立昂转债	1,738,362.25	3.36
6	113043	财通转债	1,483,775.10	2.87
7	110067	华安转债	1,464,678.31	2.83
8	123124	晶瑞转 2	1,450,021.05	2.81
9	118003	华兴转债	1,173,613.80	2.27
10	113654	永 02 转债	1,170,624.77	2.26
11	127074	麦米转 2	1,163,485.87	2.25
12	123149	通裕转债	1,109,003.73	2.15
13	127032	苏行转债	1,070,281.48	2.07
14	110073	国投转债	1,045,746.98	2.02
15	110079	杭银转债	1,040,354.11	2.01
16	113052	兴业转债	1,020,128.70	1.97
17	113644	艾迪转债	941,363.52	1.82
18	118025	奕瑞转债	936,929.44	1.81
19	123179	立高转债	924,456.33	1.79
20	118012	微芯转债	923,694.22	1.79
21	113659	莱克转债	887,584.58	1.72
22	118023	广大转债	805,322.69	1.56
23	123144	裕兴转债	740,046.79	1.43
24	113045	环旭转债	720,404.47	1.39
25	123119	康泰转 2	715,240.88	1.38
26	113602	景 20 转债	602,630.87	1.17
27	127084	柳工转 2	524,411.97	1.01
28	113060	浙 22 转债	507,931.25	0.98
29	113632	鹤 21 转债	507,517.68	0.98
30	127073	天赐转债	491,281.27	0.95
31	111009	盛泰转债	479,971.23	0.93
32	113629	泉峰转债	467,277.62	0.90

33	127086	恒邦转债	462,024.91	0.89
34	123120	隆华转债	459,972.94	0.89
35	110062	烽火转债	371,004.54	0.72
36	123131	奥飞转债	268,864.59	0.52
37	127071	天箭转债	263,997.48	0.51
38	113662	豪能转债	262,700.14	0.51
39	123100	朗科转债	261,495.90	0.51
40	128131	崇达转 2	257,351.72	0.50
41	118033	华特转债	255,766.26	0.49
42	118027	宏图转债	247,390.23	0.48
43	113062	常银转债	238,282.26	0.46
44	123170	南电转债	238,200.56	0.46
45	123190	道氏转 02	235,516.88	0.46
46	118006	阿拉转债	233,487.76	0.45
47	118034	晶能转债	228,553.93	0.44
48	118032	建龙转债	26,689.15	0.05
49	123172	漱玉转债	18,389.79	0.04

#### 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	中海可转债债券 A	中海可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	31,046,393.07	29,263,830.81
报告期期间基金总申购份额	6,407,844.22	131,818.19
减：报告期期间基金总赎回份额	963,843.95	1,051,374.56
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	36,490,393.34	28,344,274.44

### §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	2023-11-28 至 2023-12-31	7,865,125.15	6,312,189.05	0.00	14,177,314.20	21.8700

#### 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，基金份额持有人将可能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可转换债券债券型证券投资基金的文件
- 2、中海可转换债券债券型证券投资基金基金合同
- 3、中海可转换债券债券型证券投资基金托管协议
- 4、中海可转换债券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 1 月 22 日