

# 中海消费主题精选混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 8 月 21 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 2019 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51

11.3 查阅方式.....51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海消费主题精选混合型证券投资基金
基金简称	中海消费混合
基金主代码	398061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 9 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	187,197,235.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于消费主题行业及其中的优势上市公司，分享其发展和成长的机会，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。
投资策略	<p>本基金是一只采用主题投资方法的股票型基金产品，主要投资于消费主题行业及其中的优势上市公司。</p> <p>1、消费主题行业范畴的界定</p> <p>本基金采用的行业分类基准是万得资讯发布的行业分类标准。本基金拟投资的消费主题行业主要包括工业、可选消费、日常消费和医疗保健等 8 个一级行业和 19 个二级行业。</p> <p>如果万得资讯调整或停止行业分类，或者基金管理人认为有更适当的消费主题行业划分标准，基金管理人可对消费主题行业的界定方法进行调整。</p> <p>2、大类资产配置</p> <p>大类资产配置主要采取自上而下的方式。在资产配置中，本基金主要考虑如下因素： 宏观经济，政策层面，市场估值，市场情绪。</p> <p>本基金将深入分析上述四方面的情况，通过对各种因素的综合分析，增加该阶段下市场表现优于其他资产类别的资产的配置，减少市场表现相对较差的资产类别的配置，以规避或分散市场风险，提高基金经风险调整后的收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。本基金对消费主题行业内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) 定量分析</p> <p>本基金通过综合考察上市公司的成长优势、财务优势</p>

	<p>和估值优势来进行个股的筛选。</p> <p>本基金综合考察上市公司的成长指标、财务指标和估值指标，通过归一化等量化处理，对入选的上市公司按照其在每项指标的高低顺序进行打分，得到一个标准化的指标分数。再将指标分数进行等权相加，得到一个总分。按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票。</p> <p>(2) 定性分析</p> <p>本基金主要通过实地调研等方法，综合考察评估公司的管理水平，并坚决规避那些管理水平差的公司，以确保最大程度地规避投资风险。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上，采取积极主动的投资策略，投资于国债、金融债、企业债、可转债、央票、短期融资券以及资产证券化产品，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得，谋取超额收益。</p> <p>本基金通过数量分析，在剩余期限、久期、到期收益率基本接近的同类债券之间，确定最优个券。个券选择遵循相对价值原则和流动性原则。</p>
业绩比较基准	中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于中等风险品种。</p> <p>本基金长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p>

### 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	贺倩
	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	杨皓鹏	周慕冰
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金半年度报告备置地点	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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	101,049,725.62
本期利润	123,297,350.12
加权平均基金份额本期利润	0.7349
本期加权平均净值利润率	31.69%
本期基金份额净值增长率	46.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	29,570,840.35
期末可供分配基金份额利润	0.1580
期末基金资产净值	499,143,203.84
期末基金份额净值	2.666
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	218.40%

注 1：以上所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。

注 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	9.49%	1.26%	4.70%	1.07%	4.79%	0.19%
过去三个月	11.59%	2.05%	5.82%	1.43%	5.77%	0.62%
过去六个月	46.97%	1.76%	33.54%	1.37%	13.43%	0.39%
过去一年	19.87%	1.54%	10.25%	1.43%	9.62%	0.11%
过去三年	20.42%	1.38%	53.02%	1.11%	-32.60%	0.27%
自基金合同生效起至今	218.40%	1.82%	88.76%	1.24%	129.64%	0.58%

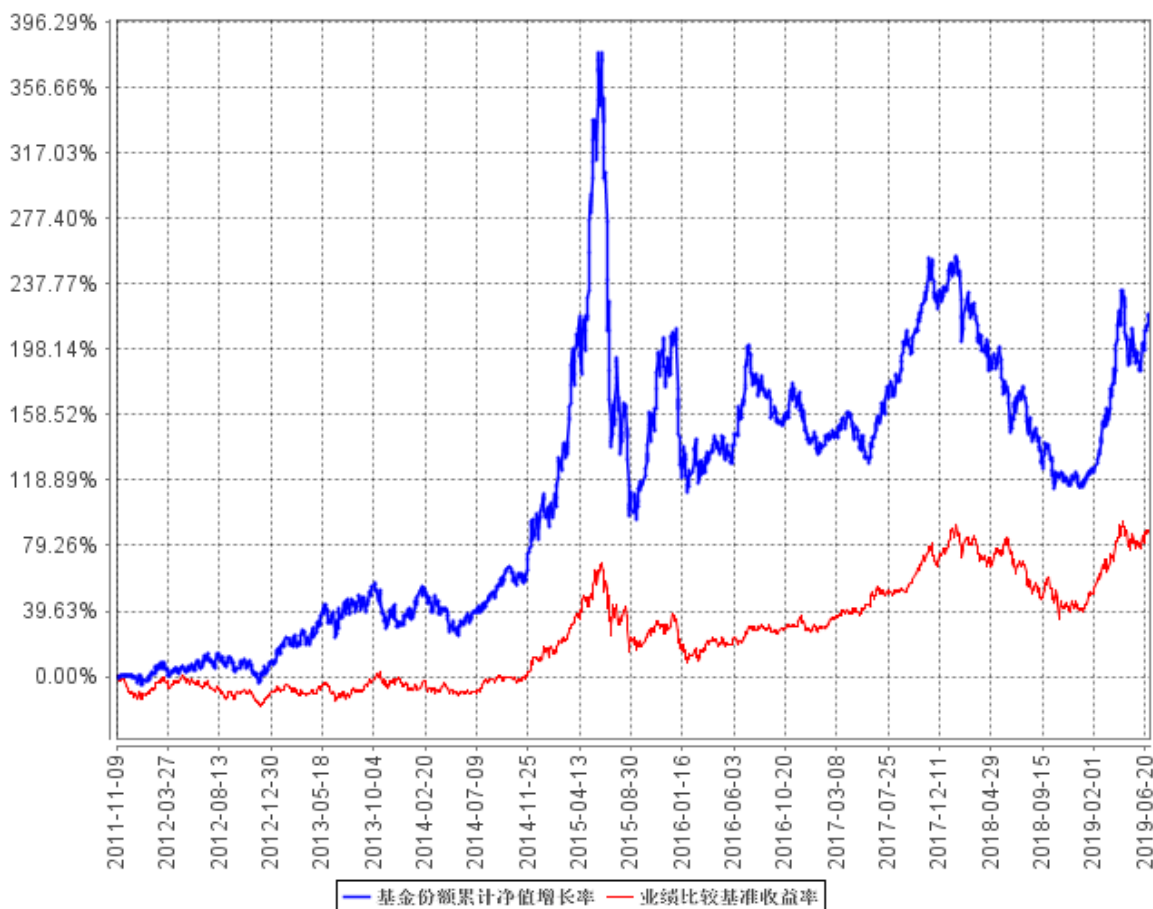
注 1：“自基金合同生效起至今”指 2011 年 11 月 9 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日。

注 2：本基金的业绩比较基准为中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%，由于本基金为消费主题基金，我们选取市场认同度很高的中证内地消费指数、中国债券总指数作

为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 60%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 80%左右，债券投资比例控制在 20%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例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 80%、20%的比例对基础指数进行再平衡，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

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 2019 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 31 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		
姚晨曦	本基金基金经理、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	2015 年 4 月 17 日	-	12 年	姚晨曦先生，复旦大学金融学专业硕士。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。

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 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

熬过了 2018 年的内外交困，今年上半年中国的发展环境虽然并未显著改善，但整体经济处于稳步发展和调整的节奏中。内部方面，需求不足导致制造业投资依然低迷，但数据尚可的房地产投资和积极推动的基建投资支撑着经济的相对平稳。虽然步伐有所放缓、节奏有所调整，但维稳的大背景下供给侧改革、金融去杠杆、房地产调控等经济调整政策依然在向前推进，支撑经济转型的“科创板”也顺利开板起航。外部方面，川普政府的反反复复虽然使得中美贸易战跌宕起伏，但是坚持自我、不为所动的策略也使谈判的天平慢慢向我们倾斜，中美蜜月期已经一去不复返，如何“竞合”将是彼此需要长期探求的问题。

就全球经济而言，本轮复苏周期已经走向尾声，即便是表现最好的美国也出现增长放缓的迹

象。全球货币政策进入拐点，在目前已经较低利率的环境下如何进一步放松货币成为大部分央行需要面临的挑战。全球金融市场尤其是权益市场也将进入新一轮动荡期。

A 股市场上半年呈现冲高回落的走势。年初在中美贸易谈判改善、经济企稳复苏的预期下再次出现了春季躁动，市场整体反弹明显。五一之后，伴随预期的落空，上证指数重新回到了 3000 点下方。在此过程中，以消费、医药和部分制造龙头企业为代表的核心资产板块，因其稳定增长的业绩以及外资的持续配置成为资金首选、表现突出。

本基金年初配置更多集中看好的氢能源板块和黄金板块，5 月之后伴随市场风险偏好的持续下滑逐步切换到消费板块。目前的配置结构以消费类核心资产为主，在积极把握交易性机会的同时耐心等待下半年市场风险偏好的再次提升。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值 2.666 元（累计净值 2.876 元）。报告期内本基金净值增长率为 46.97%，高于业绩比较基准 13.43 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

下半年，在政府宏观政策的推动下，国内经济有望保持相对平稳，结构转型持续推进。但需求的相对低迷以及贸易战的不确定性将依然制约企业的收入增长和盈利复苏。海外方面，伴随美国经济的显著放缓，全球资金的风险偏好将再次下降，金融市场恐将出现剧烈波动。

A 股方面，虽然我们认为指数大概率还是以区间震荡为主，更多是结构性的投资机会，海外市场的影响将是最大的不确定性。我们会维持稳健谨慎的投资策略，积极寻找各类投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险控制总监、监察稽核负责人、基金会计负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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遵规守信、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《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 托管人对本半年度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《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半年度报告中的财务指标、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，未发现有关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：中海消费主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	45,447,232.84	80,551,973.75
结算备付金		930,423.25	864,767.57
存出保证金		208,689.23	229,889.91
交易性金融资产	6.4.7.2	457,933,731.56	205,422,279.72
其中：股票投资		457,933,731.56	205,422,279.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	10,975.79	17,377.88
应收股利		-	-
应收申购款		866,863.30	23,859.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		505,397,915.97	287,110,148.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		2,494,527.39	-
应付赎回款		2,188,388.85	34,401.52
应付管理人报酬		582,270.20	367,434.84
应付托管费		97,045.01	61,239.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	790,656.64	709,545.36
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	101,824.04	66,682.40
负债合计		6,254,712.13	1,239,303.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	187,197,235.41	157,558,251.47
未分配利润	6.4.7.10	311,945,968.43	128,312,593.63
所有者权益合计		499,143,203.84	285,870,845.10
负债和所有者权益总计		505,397,915.97	287,110,148.36

注 1：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.666 元，基金份额总额 187,197,235.41 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海消费主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		128,759,819.54	-85,801,244.53
1.利息收入		196,968.81	210,775.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	196,968.81	210,775.59
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		106,035,378.09	-67,343,154.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	101,509,275.65	-68,971,667.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,526,102.44	1,628,513.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,247,624.50	-18,782,706.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	279,848.14	113,840.81
<b>减：二、费用</b>		5,462,469.42	7,117,726.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,887,128.13	3,156,687.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	481,188.03	526,114.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	2,006,834.83	3,256,339.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	87,318.43	178,584.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		123,297,350.12	-92,918,970.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		123,297,350.12	-92,918,970.59

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海消费主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	157,558,251.47	128,312,593.63	285,870,845.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123,297,350.12	123,297,350.12
三、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）	29,638,983.94	60,336,024.68	89,975,008.62
其中：1.基金申购款	100,003,542.34	161,888,813.50	261,892,355.84
2.基金赎回款	-70,364,558.40	-101,552,788.82	-171,917,347.22
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	187,197,235.41	311,945,968.43	499,143,203.84
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	180,015,534.84	324,435,672.26	504,451,207.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-92,918,970.59	-92,918,970.59
三、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)	-20,929,510.90	-36,822,770.92	-57,752,281.82
其中：1.基金申购款	24,574,810.28	41,601,044.62	66,175,854.90
2.基金赎回款	-45,504,321.18	-78,423,815.54	-123,928,136.72
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	159,086,023.94	194,693,930.75	353,779,954.69

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：

          杨皓鹏  宋宇  周琳            
 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

中海消费主题精选混合型证券投资基金(原名为中海消费主题精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)由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许可[2011]1112号《关于核准中海消费主题精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,于2011年10月10日至2011年11月4日向社会公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币336,478,373.07元,经江苏公证天业会计师事务所(特殊普通合伙)苏公W[2011]B105号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同》于2011年11月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为336,549,461.88份基金份额,其中认购资金利息折合71,088.81份基金份额。本基金的基金管理人为中海基金管

理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，中海消费主题精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为中海消费主题精选混合型证券投资基金。

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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及法律、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的相关规定）。本基金业绩比较基准为：中证内地消费指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%。

#### 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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 2 号《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〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

#### 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品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发展费附加的单位外）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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	45,447,232.84

定期存款	-
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	-
合计：	45,447,232.84

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	442,660,318.20	457,933,731.56	15,273,413.36
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	442,660,318.20	457,933,731.56	15,273,413.36

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,514.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	376.83
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	84.51
合计	10,975.79

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	790,656.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	790,656.64

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,526.74
预提费用	83,655.05
其他	11,642.25
合计	101,824.04

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	157,558,251.47	157,558,251.47
本期申购	100,003,542.34	100,003,542.34
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-70,364,558.40	-70,364,558.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-	-
本期末	187,197,235.41	187,197,235.41

#### 6.4.7.10 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	-71,009,300.36	199,321,893.99	128,312,593.63
本期利润	101,049,725.62	22,247,624.50	123,297,350.12
本期基金份额交易产生的变动数	-469,584.91	60,805,609.59	60,336,024.68
其中：基金申购款	-3,850,773.39	165,739,586.89	161,888,813.50
基金赎回款	3,381,188.48	-104,933,977.30	-101,552,788.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,570,840.35	282,375,128.08	311,945,968.43

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	184,648.08
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	10,688.45
其他	1,632.28
合计	196,968.81

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	653,792,382.79
减：卖出股票成本总额	552,283,107.14
买卖股票差价收入	101,509,275.65

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.13.4 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。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 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。

#### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.14.4 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。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 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。

**6.4.7.15.2 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。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,526,102.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,526,102.44

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	22,247,624.50
——股票投资	22,247,624.50
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	22,247,624.50

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	268,095.57
转出基金补偿收入	11,752.57

合计	279,848.14
----	------------

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,006,834.83
银行间市场交易费用	-
合计	2,006,834.83

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	58,859.86
银行费用	3,663.38
合计	87,318.43

### 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

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 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、直销机构
中国农业银行股份有限公司	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

中海信托股份有限公司	基金管理人的股东
------------	----------

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	9,386,064.52	0.65%	228,326,267.51	10.39%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

###### 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 2019年1月1日至2019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	8,741.36	0.71%	8,741.36	1.11%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	212,639.64	11.10%	-	-

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

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,887,128.13	3,156,687.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,314,145.38	1,442,434.80

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	481,188.03	526,114.62

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。

### 6.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联 方名	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
----------	-------------------	---------------------

称	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中海信托股份有限公司	11,107,312.33	5.9300%	11,107,312.33	7.0500%

注：本基金已按照招募说明书上列示的费率对关联方收取了基金投资的相关费用。

#### 6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国农业银行股份有限公司	45,447,232.84	184,648.08	98,717,451.76	191,299.27

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，2019 半年度获得的利息收入为人民币 10,688.45 元(2018 半年度：人民币 15,812.39 元)，2019 年 6 月末结算备付金余额为人民币 930,423.25 元(2018 年 6 月末：人民币 308,742.05 元)。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26	2019年7月	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

		日	5 日							
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 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

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。

#### 6.4.13 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基金信用债业务运作管理办法》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、风控合规部门、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,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。

#### **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 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 2019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	45,447,232.84	-	-	-	-	-	45,447,232.84
结算备付金	930,423.25	-	-	-	-	-	930,423.25
存出保证金	208,689.23	-	-	-	-	-	208,689.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	457,933,731.56	457,933,731.56
应收利息	-	-	-	-	-	10,975.79	10,975.79
应收申购款	-	-	-	-	-	866,863.30	866,863.30
资产总计	46,586,345.32	-	-	-	-	458,811,570.65	505,397,915.97
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,494,527.39	2,494,527.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,188,388.85	2,188,388.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	582,270.20	582,270.20
应付托管费	-	-	-	-	-	97,045.01	97,045.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	790,656.64	790,656.64
其他负债	-	-	-	-	-	101,824.04	101,824.04
负债总计	-	-	-	-	-	6,254,712.13	6,254,712.13
利率敏感度缺口	46,586,345.32	-	-	-	-	452,556,858.52	499,143,203.84
上年度末 2018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	80,551,973.75	-	-	-	-	-	80,551,973.75

结算备付金	864,767.57	-	-	-	-	864,767.57
存出保证金	229,889.91	-	-	-	-	229,889.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-205,422,279.72	205,422,279.72
应收利息	-	-	-	-	17,377.88	17,377.88
应收申购款	-	-	-	-	23,859.53	23,859.53
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	81,646,631.23	-	-	-	-205,463,517.13	287,110,148.36
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	34,401.52	34,401.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	367,434.84	367,434.84
应付托管费	-	-	-	-	61,239.14	61,239.14
应付交易费用	-	-	-	-	709,545.36	709,545.36
其他负债	-	-	-	-	66,682.40	66,682.40
负债总计	-	-	-	-	1,239,303.26	1,239,303.26
利率敏感度缺口	81,646,631.23	-	-	-	-204,224,213.87	285,870,845.10

#### 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。		
分析	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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	0.00	0.00
	利率上升 25 个基点	0.00	0.00

#### 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。股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-35%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，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%。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。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 2019年6月30日		上年度末 2018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	457,933,731.56	91.74	205,422,279.72	71.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	457,933,731.56	91.74	205,422,279.72	71.86

#### 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。		
分析	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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	+5%	21,737,121.15	7,379,866.83
	-5%	-21,737,121.15	-7,379,866.83

#### 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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR(%)	2.78	2.26
	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。

## § 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	457,933,731.56	90.61
	其中：股票	457,933,731.56	90.61
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	46,377,656.09	9.18
8	其他各项资产	1,086,528.32	0.21
9	合计	505,397,915.97	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	417,254,378.26	83.59
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	25,184,268.00	5.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,398,505.00	3.08
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	457,933,731.56	91.74

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	45,900	45,165,600.00	9.05
2	603517	绝味食品	856,240	33,316,298.40	6.67
3	603345	安井食品	610,408	31,374,971.20	6.29
4	600887	伊利股份	799,510	26,711,629.10	5.35
5	600009	上海机场	300,600	25,184,268.00	5.05
6	000858	五粮液	208,419	24,583,021.05	4.93
7	000568	泸州老窖	303,000	24,491,490.00	4.91
8	603429	集友股份	812,030	20,787,968.00	4.16
9	000651	格力电器	373,200	20,526,000.00	4.11
10	000538	云南白药	242,400	20,221,008.00	4.05
11	002191	劲嘉股份	1,596,000	19,806,360.00	3.97
12	000333	美的集团	305,700	15,853,602.00	3.18
13	601888	中国国旅	173,700	15,398,505.00	3.08
14	600298	安琪酵母	470,305	14,875,747.15	2.98
15	002925	盈趣科技	354,700	13,836,847.00	2.77
16	000338	潍柴动力	1,056,600	12,985,614.00	2.60
17	601515	东风股份	1,513,740	11,701,210.20	2.34
18	600166	福田汽车	4,683,500	11,099,895.00	2.22
19	002449	国星光电	830,671	11,031,310.88	2.21
20	002594	比亚迪	215,700	10,940,304.00	2.19
21	600104	上汽集团	426,500	10,875,750.00	2.18
22	600195	中牧股份	729,100	10,098,035.00	2.02
23	000957	中通客车	1,157,800	8,683,500.00	1.74
24	600733	北汽蓝谷	1,031,500	8,520,190.00	1.71
25	600201	生物股份	310,200	4,867,038.00	0.98
26	300241	瑞丰光电	795,300	4,724,082.00	0.95
27	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
28	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01

29	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
30	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
31	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
32	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
33	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

## 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	600519	贵州茅台	46,832,304.41	16.38
2	603345	安井食品	30,532,248.27	10.68
3	002481	双塔食品	29,699,866.00	10.39
4	600273	嘉化能源	28,652,556.00	10.02
5	603517	绝味食品	26,215,918.37	9.17
6	603429	集友股份	23,588,661.50	8.25
7	002191	劲嘉股份	22,695,749.72	7.94
8	000538	云南白药	22,573,967.72	7.90
9	000651	格力电器	22,383,983.69	7.83
10	000568	泸州老窖	21,994,471.70	7.69
11	000858	五粮液	21,237,732.25	7.43
12	600009	上海机场	19,347,753.31	6.77
13	002925	盈趣科技	18,742,152.13	6.56
14	002733	雄韬股份	18,468,358.64	6.46
15	000723	美锦能源	17,097,611.00	5.98
16	600887	伊利股份	16,878,362.80	5.90
17	601515	东风股份	15,824,765.80	5.54
18	000333	美的集团	15,772,794.15	5.52
19	002639	雪人股份	14,852,396.79	5.20
20	300017	网宿科技	14,448,368.14	5.05
21	600733	北汽蓝谷	14,256,761.25	4.99
22	600298	安琪酵母	13,935,026.20	4.87
23	601888	中国国旅	13,118,603.00	4.59
24	600166	福田汽车	12,019,342.00	4.20



25	002624	完美世界	12,009,311.00	4.20
26	002249	大洋电机	11,877,305.98	4.15
27	000338	潍柴动力	11,730,762.00	4.10
28	600104	上汽集团	11,713,153.58	4.10
29	601678	滨化股份	11,250,852.80	3.94
30	002594	比亚迪	11,194,288.00	3.92
31	002449	国星光电	10,928,778.74	3.82
32	000957	中通客车	10,661,509.00	3.73
33	002002	鸿达兴业	10,293,201.00	3.60
34	600195	中牧股份	9,909,884.60	3.47
35	600860	京城股份	9,574,719.00	3.35
36	000811	冰轮环境	9,550,661.00	3.34
37	601233	桐昆股份	8,766,374.32	3.07
38	600570	恒生电子	8,683,179.00	3.04
39	300228	富瑞特装	8,116,542.00	2.84
40	002493	荣盛石化	8,100,263.00	2.83
41	000703	恒逸石化	7,757,134.50	2.71
42	601318	中国平安	7,608,817.00	2.66
43	600066	宇通客车	6,877,754.70	2.41
44	600036	招商银行	6,690,230.00	2.34
45	600192	长城电工	6,561,062.00	2.30
46	002198	嘉应制药	6,124,922.00	2.14

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	000723	美锦能源	50,748,631.45	17.75
2	002481	双塔食品	48,825,288.10	17.08
3	002733	雄韬股份	24,357,211.87	8.52
4	601138	工业富联	23,247,399.17	8.13
5	600547	山东黄金	22,211,514.00	7.77
6	002639	雪人股份	21,336,388.77	7.46
7	600489	中金黄金	20,157,206.68	7.05
8	002648	卫星石化	20,021,839.78	7.00

9	600273	嘉化能源	19,882,518.00	6.96
10	001979	招商蛇口	16,909,561.95	5.92
11	300017	网宿科技	16,471,459.02	5.76
12	000002	万科A	15,774,440.12	5.52
13	600048	保利地产	15,046,370.51	5.26
14	600519	贵州茅台	14,420,058.70	5.04
15	002249	大洋电机	13,337,555.72	4.67
16	000001	平安银行	12,241,285.46	4.28
17	600383	金地集团	12,133,661.96	4.24
18	600570	恒生电子	11,599,679.65	4.06
19	601678	滨化股份	11,467,800.38	4.01
20	601233	桐昆股份	11,300,587.00	3.95
21	600026	中远海能	11,298,951.62	3.95
22	002624	完美世界	11,167,758.99	3.91
23	002002	鸿达兴业	10,863,841.31	3.80
24	600860	京城股份	10,632,778.69	3.72
25	603288	海天味业	9,769,675.84	3.42
26	000975	银泰资源	9,627,473.40	3.37
27	002493	荣盛石化	9,292,724.33	3.25
28	000811	冰轮环境	9,223,184.00	3.23
29	600036	招商银行	9,219,257.71	3.22
30	002352	顺丰控股	9,002,841.24	3.15
31	300228	富瑞特装	8,945,508.00	3.13
32	000703	恒逸石化	8,698,268.00	3.04
33	300413	芒果超媒	8,605,570.26	3.01
34	601318	中国平安	8,122,078.34	2.84
35	600192	长城电工	7,343,569.17	2.57
36	600637	东方明珠	6,957,900.46	2.43
37	000671	阳光城	6,941,761.00	2.43
38	600066	宇通客车	6,349,534.30	2.22
39	002198	嘉应制药	6,225,775.00	2.18
40	002938	鹏鼎控股	6,201,800.60	2.17
41	600009	上海机场	6,165,585.45	2.16
42	600104	上汽集团	6,125,722.78	2.14

注：本报告期内，累计卖出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。

### 7.4.3 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	782,546,934.48
卖出股票收入（成交）总额	653,792,382.79

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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 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。

#### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 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	208,689.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,975.79
5	应收申购款	866,863.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,086,528.32

### 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换债券。

### 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

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。

## § 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
31,108	6,017.66	11,953,224.70	6.39%	175,244,010.71	93.61%

### 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	19,450.81	0.0104%

### 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的情况

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、基金投资和研究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（2011年11月9日）基金份额总额	336,549,461.88
本报告期期初基金份额总额	157,558,251.47
本报告期期间基金总申购份额	100,003,542.34
减：本报告期期间基金总赎回份额	70,364,558.40
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	187,197,235.41

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，本基金管理人无重大人事变动。  
2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。  
2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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

为本基金进行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

本报告期内本基金管理人、托管机构及其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	

华创证券	1	450,228,456.38	31.38%	419,296.99	34.21%	-
渤海证券	1	243,570,058.82	16.98%	178,122.98	14.53%	-
西南证券	1	202,625,014.49	14.12%	148,179.72	12.09%	-
东兴证券	1	133,108,271.50	9.28%	123,963.63	10.11%	-
光大证券	1	94,927,953.60	6.62%	88,406.37	7.21%	-
银河证券	2	74,406,440.74	5.19%	69,294.90	5.65%	-
浙商证券	1	70,584,979.31	4.92%	51,618.87	4.21%	-
中泰证券	1	60,548,093.70	4.22%	56,390.11	4.60%	-
国信证券	1	52,037,184.16	3.63%	48,462.29	3.95%	-
兴业证券	2	22,115,859.29	1.54%	16,173.36	1.32%	-
方正证券	1	12,346,286.08	0.86%	9,028.49	0.74%	-
国联证券	1	9,386,064.52	0.65%	8,741.36	0.71%	-
国泰君安	1	6,208,777.89	0.43%	5,782.17	0.47%	-
民生证券	2	2,494,306.00	0.17%	2,322.85	0.19%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

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。

注 2：本报告期内没有新增交易单元；退租了中信证券、海通证券、华宝证券的深圳交易单元。



注 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。

注 4：以上数据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

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	中海消费主题精选混合型证券投资基金年度最后一日净值公告	上证报	2019 年 1 月 1 日
2	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	上证报	2019 年 1 月 22 日
3	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	上证报	2019 年 1 月 28 日
4	中海基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	上证报	2019 年 1 月 30 日
5	中海基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	上证报	2019 年 2 月 1 日
6	中海基金关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	上证报	2019 年 2 月 15 日
7	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信证券股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 3 月 4 日
8	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 3 月 28 日
9	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2018 年年度报告	公司官网	2019 年 3 月 28 日
10	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	上证报	2019 年 3 月 28 日
11	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个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 4 月 1 日
12	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳前海财厚基金销	上证报	2019 年 4 月 4 日

	售有限公司开通定期定额申购业务并参与基金定投申购费率优惠活动的公告		
13	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在徽商期货有限责任公司开通定期定额申购业务并参与基金定投申购费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 4 月 4 日
14	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构的公告	上证报	2019 年 4 月 8 日
15	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行 股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 4 月 12 日
16	中海消费主题精选混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上证报	2019 年 4 月 18 日
17	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司调整定期定额投资起点金额的公告	上证报	2019 年 5 月 6 日
18	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	上证报	2019 年 6 月 13 日
19	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	上证报	2019 年 6 月 21 日
20	中海消费主题精选混合型证券投资基金更新招募说明书（2019 年第 1 号）	公司官网	2019 年 6 月 22 日
21	中海消费主题精选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2019 年第 1 号）	上证报	2019 年 6 月 22 日
22	中海基金关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	上证报	2019 年 6 月 26 日
23	中海基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中国银行股份有限公司基金定投申购费率优惠标准的公告	上证报	2019 年 6 月 26 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海消费主题精选股票型证券投资基金的文件
- 2、中海消费主题精选股票型证券投资基金基金合同
- 3、中海消费主题精选股票型证券投资基金托管协议
- 4、中海消费主题精选股票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

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

### 11.3 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

2019 年 8 月 26 日