（上接 C1 版）

公司网址：www.dtfunds.com
（82）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
法定代表人：陈继武
联系人：高皓辉
联系电话：021-63333389
传真：021-63333390
客服电话：4006-433-389
公司网址：www.vstonewealth.com
（83）珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
联系电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
（84）奕丰基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
联系电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn
（85）安粮期货股份有限公司
住所：安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层
办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路 168 号同济大厦 10-11 层（总部）
法定代表人：朱中文
联系人：梁蕾
联系电话：0551-62870125
传真：0551-62870131
客服电话：400 626 9988
公司网址：http://www.alqh.com/
（86）上海联泰资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
联系电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服电话：4000-466-788
公司网址：www.66zichan.com
（87）北京钱景基金销售有限公司
住所：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱 soho10 层
法定代表人：赵荣春
联系人：陈剑炜
联系电话：010-57418813
客服电话：400-893-6885
公司网址：www.qianjing.com
（88）北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人：闫振杰
电话：010-59601366
传真：010-62020355
联系人：翟文
客户服务电话：4008188000
公司网址：www.myfund.com
（89）深圳市金斧子基金销售有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼
法定代表人：赖任军
电话：0755-29330513
传真：0755-26920530
联系人：刘昕霞
客户服务电话：400-930-0660
公司网址：www.jfzinv.com
（90）北京广源达信基金销售有限公司
住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层
法定代表人：齐剑辉
电话：400626060
传真：010-82055860
联系人：王英俊
客户服务电话：400-623-6060
公司网址：www.niuniufund.com
（91）上海中正达广基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
法定代表人：黄欣
电话：021-33768132
传真：021-33768132-802
联系人：戴珉微
客户服务电话：4006767523
公司网址：www.zhongzhengfund.com
（92）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
住所：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：王兴吉
联系人：高雪超
联系电话：18601207732
传真：010-82057741
客服电话：4000888080
公司网址：www.qiandaojr.com
（93）深圳前海微众银行股份有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座
法定代表人：顾敏
电话：0755-89462447
传真：0755-86700688
联系人：罗曦
客户服务电话：400-999-8877
公司网址：www.webank.com
（94）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室
法定代表人：王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn
（95）北京懒猫金融信息服务有限公司
住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119
办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号
法定代表人：许现良
电话：010-57649619
传真：010-57649620
联系人：朱翔宇
客户服务电话：010-57649619
公司网址：www.lanmao.com
（96）一路财富（北京）信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
法定代表人：吴雪秀
电话：+86(10)88312877
传真：+86(10)88312877
联系人：徐越
客户服务电话：400-001-1566
公司网址：http://www.yilucaifu.com/
（97）南京苏宁基金销售有限公司
住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人：王锋
电话：025-66996699-887226
传真：025-66008800-887226
联系人：张慧
客户服务电话：95177
公司网址：www.snjijin.com
（98）北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：钟斐斐
电话：010-61840688
传真：010-61840699
联系人：吴季林
客户服务电话：4000618518
公司网址：https://danjuanapp.com
（99）上海景谷基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 402k
法定代表人：袁飞
电话：61621602
传真：61621602*819
联系人：袁振荣
客户服务电话：61621602
公司网址：www.g-fund.com.cn
（100）北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
法定代表人：王伟刚
电话：010-56251471
传真：010-62680827
联系人：熊小满
客户服务电话：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com
（101）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼
办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼
法定代表人：陈洪生
电话：0592-3122672
传真：0592-3122701
联系人：梁云波
客户服务电话：400-9180808
公司网址：www.xds.com.cn
（102）上海攀赢基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 6 楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 488 号太平金融大厦 6 楼
法定代表人：田为奇
联系人：沈捷睿
电话：13816320097
传真：021-68889283
客户服务电话：021-68889082
公司网址：http://www.pytz.cn/
（103）北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
法定代表人：李昭琛
电话：010-62676405
传真：8610-62675979
联系人：付文红
客户服务电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com
（104）天津国美基金销售有限公司
住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-1 室
办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层
法定代表人：丁东华
电话：010-59287984
传真：010-59287825
联系人：郭宝亮
客服电话：400-111-0889
公司网址：www.gomefund.com
（105）上海华信证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼
法定代表人：郭林
电话：021-63898427
传真：021-68776977-8427
联系人：徐璐
客户服务电话：400-820-5999
公司网址：www.shhxzq.com
（106）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402
办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼
法定代表人：程刚
电话：010-58160168
传真：010-58160173
联系人：张旭
客户服务电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com
（107）上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼
法定代表人：戴新装
电话：021-20538888
传真：021-20538999
联系人：江辉
客户服务电话：400-820-1515
公司网址：www.zhengtongfunds.com
（108）南京途牛基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号
办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号
法定代表人：宋时琳
联系人：张士帅
联系电话：025-86853969
客服电话：4007-999-999
公司网址：http://jr.tuniu.com
（109）上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
联系电话：021-51327185
传真：021-50710161
客服电话：400-821-0203
公司网址：www.520fund.com.cn
（110）杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室
办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼
法定代表人：陈刚
联系人：张丽琼
联系电话：0571-85262700
传真：0571-85269200
客服电话：0571-86915761
公司网址：www.cd121.com
（111）北京植信基金销售有限公司
住所：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室 -67
办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号
法定代表人：杨纪锋
联系人：吴鹏
电话：010-56075718
传真：010-67767615
客服电话：400-680-2123
网址：www.zhixin-inv.com
（112）北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座
法定代表人：江卉
联系人：赵德赛
电话：4000988511/ 4000888816
传真：010-89188000
客服电话：95118
网址：http://fund.jd.com/
（113）上海朝阳永续基金销售有限公司
住所：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室
办公地址：上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人：廖冰
联系人：郑秋月
联系电话：021-802348888-6694
传真：021-80234898
客服电话：4006991888
公司网址：www.998fund.com
（114）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法定代表人：钱昊旻
联系人：徐英
电话：010-59336539
传真：010-59336500
客服电话：4008-909-998
（115）上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人：毛淮平
联系人：仲秋玥
电话：010-88066632
传真：010-63136184
客服电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com
（116）武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第七幢 23 层 1 号 4 号
法定代表人：陶捷
联系人：陆锋
客户服务电话：4000279899
公司网址：www.buyfunds.cn
（117）和耕传承基金销售有限公司
住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人：李淑慧
联系人：罗聪
客户服务电话：0371-85518396
公司网址：www.hgccpb.com
（118）徽商期货有限责任公司
住所：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层
办公地址：安徽省合肥市芜湖路 258 号 3 号楼 4、6、7 层，6 号楼 1、2 层
法定代表人：吴国华
联系人：申倩倩
客户服务电话：4008878707
公司网址：www.hsqh.net
（119）北京微动利基金销售有限公司
住所：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341?
办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341
法定代表人：梁洪军
联系人：季长军
客户服务电话：400-819-6665?
公司网址：www.buyforyou.com.cn?
（120）成都华羿恒信基金销售有限公司
住所：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号
办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路 88 号 1 号楼 32 楼 2 号
法定代表人：赵璧
联系人：徐莉
客户服务电话：400-8010-009
公司网址：http://www.huayihengxin.com
（121）上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
法定代表人：冷飞
联系人：李娟
联系电话：021-50810687
客服电话：021-50810673
公司网址：www.wacaijijin.com
（122）上海大智慧基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
法定代表人：申健
联系人：宋楠
联系电话：021-20219988
客服电话：021-20292031
网址：https://www.wg.com.cn/
（123）北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法定代表人：徐福星
联系人：李美
电话：010-68292940
传真：010-68292964
客户服务电话：400-600-0030
网址：www.bzfunds.com
（124）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层 &28 层
法定代表人：蒋煜
联系人：刘聪慧 / 徐晓荣
电话：010-58170905/010-58170876
传真：010-58100800
客户服务电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com.cn
（125）北京格上富信基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人：李悦章
联系人：曹庆展
客户服务电话：400-066-8586
公司网址：www.igesafe.com
（126）北京电盈基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人：程刚
联系人：赵立芳
客户服务电话：400-100-3391
公司网址：http://www.dianyingfund.com/
（127）天津万家财富资产管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层
法定代表人：李修辞
联系人：邵玉磊
客户服务电话：010-59013825
公司网址：http://www.wanjiawealth.com/
（128）深圳前海财厚资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址：深圳市南山区南山大道 1088 号南园枫叶大厦 15 层 15K 室
法定代表人：孙方厚
联系人：顾梦婷
客户服务电话：400-699-0071
公司网址：www.caiho.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中海基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层
法定代表人：杨皓鹏
总经理：杨皓鹏
成立日期：2004 年 3 月 18 日
电话：021-38429808
传真：021-68419328
联系人：周琳

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
法定代表人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
执行事务合伙人：毛鞍宁
联系电话：010-58153000
传真：010-58153000
联系人：徐艳
经办会计师：徐艳、朱昀

四、基金的名称

中海消费主题精选混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资范围

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）。

本基金投资组合的资产配置：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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金 80%以上的股票资产投资于消费主题类股票。

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。

八、基金的投资理念

本基金根据未来经济增长主驱动力向消费驱动转变的情况，以消费主题行业的上市公司股票作为资产配置与构建投资组合的基础，进行主动的投资组合管理。

本基金认可的消费主题，包括与个人需求紧密相关的“衣（穿着）、食（饮食）、住（居住）、行（交通与沟通）、康（健康）、乐（休闲娱乐）”六大产业，以及为国民经济向消费驱动型经济发展方式转型而提供相关配套支持与服务的相关上市公司。

消费主题的识别是一个动态的过程，本基金将不断对新的消费需求进行跟踪，及时调整消费主题的识别和认定。

九、基金的投资策略

本基金是一只采用主题投资方法的混合型基金产品，主要投资于消费主题行业及其中的优势上市公司。

1、消费主题行业范畴的界定

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。目前，WIND 行业划分包括 10 个一级行业，24 个二级行业，62 个三级行业和 135 个四级行业。

本基金拟投资的消费主题行业主要包括 8 个一级行业和 19 个二级行业。详见下表。

一级行业	二级行业	三级行业
工业	运输	航空货运与物流
		航空
		海运
		公路与铁路运输
		交通基础设施
可选消费	汽车与汽车零部件	汽车零部件
		汽车
	耐用消费品与服装	家庭耐用消费品
		休闲设备与用品
		纺织品、服装与奢侈品
	消费者服务	酒店、餐馆与休闲
		综合消费者服务
	媒体	媒体
	零售业	消费品经销商
		互联网与售货目录零售
		多元化零售
		专营零售
日常消费	食品与主要用品零售	食品与主要用品零售
	食品、饮料与烟草	饮料
		食品
		烟草
	家庭与个人用品	家庭用品
		个人用品
医疗保健	医疗保健设备与服务	医疗保健设备与用品
		医疗保健提供商与服务
		医疗保健技术
	制药、生物科技与生命科学	生物科技
		制药
		生命科学工具与服务
金融	银行	商业银行
		互助储蓄银行与抵押信贷
	多元金融	多元金融服务
		消费信贷
		资本市场
	保险	保险
	房地产	房地产投资信托
		房地产管理与开发
信息技术	软件与服务	互联网软件与服务
		信息技术服务
		软件
	技术硬件与设备	通信设备
		电脑与外围设备
		电子设备、仪器和元件
		办公电子设备
电信服务	电信服务	多元电信服务
		无线电信服务
公用事业	公用事业	电力
		燃气
		复合型公用事业
		水务
		独立电力生产商与能源贸易商

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。

2、大类资产配置

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，包括国际经济和国内经济等，判断经济周期是否处于衰退、复苏、过热和滞胀阶段，通过投资时钟，确定阶段性较优资产。

政策层面，包括宏观政策（货币和财政政策）松紧、区域经济扶持政策力度、资本市场相关政策和消费主题行业政策等。

市场估值，包括市场的资金供求状况、估值水平、不同类资产的预期收益率水平和相对吸引力等。

市场情绪，包括市场成交量、股票账户新增开户数、持仓账户数及其他反映投资者情绪的技术指标。

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。

3、股票投资策略

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。

（1）定量分析

本基金通过综合考察上市公司的成长优势、财务优势和估值优势来进行个股的筛选。

本基金考察的成长指标包括：总资产增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、销售毛利率变化率、净利润增长率、存货周转率。

本基金考察的财务指标包括：净资产收益率、销售毛利率、总资产周转率、利息保障比率、经营活动净收益 / 利润总额、经营活动产生现金流量 / 营业收入。

本基金考察的估值指标包括：企业价值 / 销售收入、企业价值 / 息税折旧摊销前利润、自由现金流、市盈率、市净率、市盈率 / 增长率等。

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。

（2）定性分析

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。

本基金管理人将主要通过以下六个方面对上市公司管理水平进行评估：

1）长期战略规划和管理目标是否符合行业发展趋势和国家扶持政策；

2）盈利模式的正确性和管理层的执行力，是否能够通过有效措施保持市场份额的稳固和提升；

3）大股东、管理层与股东利益的一致性，激励机制的落实情况；

4）内部控制与权利制衡，诚信与透明度；

5）前瞻性和创新能力；

6）与上游供应商和下游客户的关系的和谐度。

4、债券投资策略

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。

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。个券选择遵循以下原则：

（1）相对价值原则

属性相近的单个债券，选择收益率较高的券种；在收益率相同的情况下，选择风险（久期）较低的券种。对二者都相近的券种，根据凸性，选择凸性较大的券种。

（2）流动性原则

收益率、剩余期限、久期和凸性基本类似的券种，市场表现有时差别明显。在一般情况下，避免波动性过大的券种，选择流动性较好的券种。

十、基金的投资决策依据和决策程序

（1）投资决策依据

1、依据投资研究人员对国内宏观经济、政策、行业和上市公司的综合分析研究进行决策；

2、依据对国内证券市场的阶段表现、活跃程度和发展趋势的判断进行决策；

3、依据国家有关法律、法规和《基金合同》的规定进行决策；

4、风险控制贯穿投资过程各环节。

（2）投资决策流程

为明确投资各环节的业务职责，防范投资风险，基金管理人建立规范的投资流程。

1、投资决策委员会定期召开会议确定股票 / 债券资产投资比例，形成基金投资的投资决议。

2、研究部和金融工程部提出个股、行业选择、数量化投资方案，为基金经理和投资决策委员会提供投资参考依据。

3、基金经理根据投资决策委员会的决议，在研究部和金融工程部提出的方案的基础上构建投资组合。

4、交易部依据基金经理的指令，执行交易，交易进行过程中，交易员及时反馈市场信息。

5、风险管理部对基金投资组合的风险进行跟踪、评估、控制，对投资组合的绩效进行分析。

十一、基金的投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%。债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（4）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（5）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（6）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；

（8）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（9）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（10）本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

（11）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述（1）-（3）、（6）、（7）、（10）项规定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

十二、基金的业绩比较基准

本基金的业绩基准为：中证内地消费指数涨跌幅 ×80%+ 中国债券总指数涨跌幅 ×20%。

本基金的股票资产占基金资产的 60%-95%，债券资产占基金资产的 0%-35%，从长期看，本基金股票资产平均配置比例为 80%，债券资产的平均配置比例为 20%。因此，业绩基准中的资产配置比例基本可反映出本基金的风险收益特征。

本基金股票部分主要投资于消费主题行业股票，组合的业绩基准采用中证内地消费指数，债券组合的业绩基准采用中国债券总指数。

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人与基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十三、基金的风险收益特征

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。

十四、基金投资组合报告

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，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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至 2018 年 9 月 30 日，中海消费主题精选混合型证券投资基金资产净值为 313,375,908.59 元，基金份额净值为 2.009 元，累计基金份额净值为 2.219 元。其资产组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	290,209,457.64	92.19
	其中：股票	290,209,457.64	92.19
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	24,286,634.45	7.72
8	其他资产	300,860.03	0.10
9	合计	314,796,952.12	100.00

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	14,532,441.00	4.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	187,741,359.64	59.91
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	974,797.00	0.31
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	-	-
J	金融业	55,680,211.00	17.77
K	房地产业	31,280,649.00	9.98
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	290,209,457.64	92.61

3、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	601138	工业富联	1,348,976	19,180,945.12	6.12
2	600019	宝钢股份	2,063,700	16,200,045.00	5.17
3	600309	万华化学	318,800	13,539,436.00	4.32
4	000002	万 科 A	470,200	11,425,860.00	3.65
5	600585	海螺水泥	306,100	11,261,419.00	3.59
6	600801	华新水泥	556,100	11,199,854.00	3.57
7	600048	保利地产	888,000	10,806,960.00	3.45
8	000401	冀东水泥	929,900	10,042,920.00	3.20
9	001979	招商蛇口	484,100	9,047,829.00	2.89
10	600036	招商银行	293,200	8,998,308.00	2.87

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

（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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

（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。

11、投资组合报告附注

（1）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。

（2）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。

（3）截至 2018 年 9 月 30 日，本基金的其他资产项目构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	220,529.71
2	应收证券清算款	4,365.20
3	应收股利	-
4	应收利息	7,353.48
5	应收申购款	68,611.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	300,860.03

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	221,809.12	0.07	新股锁定

十五、基金的业绩

基