

# 中海消费主题精选股票型证券投资基金

## 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 27 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 2014 年 8 月 26 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 2014 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>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	32
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
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	37
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	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
<b>§8 基金份额持有人信息</b>	38

---

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
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 .....	39
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>39</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中海消费主题精选股票型证券投资基金
基金简称	中海消费股票
基金主代码	398061
前端交易代码	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	66,108,989.73 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 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。 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 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。 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 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</p>

	<p>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><b>4、债券投资策略</b></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	本基金是一只主动投资的股票型基金，其预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于较高预期风险、较高预期收益特征的基金品种。

### 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	王莉
	联系电话	021-38429808
	电子邮箱	wangl@zhfund.com
客户服务电话	400-888-9788、 021-38789788	95599
传真	021-68419525	010-63201816
注册地址	上海市浦东新区银城中路 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	北京市西城区复兴门内大街28

	68 号 2905-2908 室及 30 层	号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	黄鹏	蒋超良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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(2014 年 1 月 1 日 – 2014 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-1,817,531.34
本期利润	-42,838.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.05%
本期基金份额净值增长率	1.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2014 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	5,310,052.98
期末可供分配基金份额利润	0.0803
期末基金资产净值	76,775,598.60
期末基金份额净值	1.161
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2014 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	38.66%

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

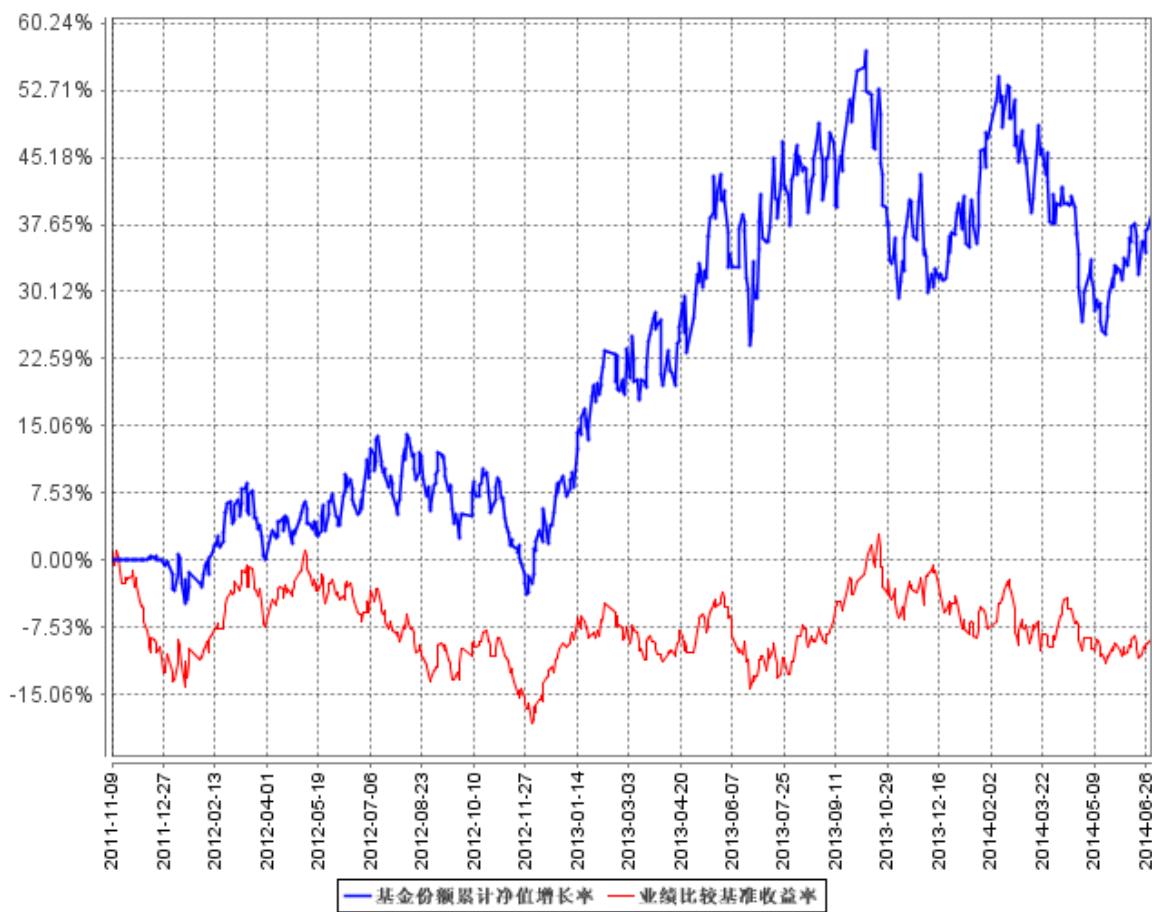
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.31%	1.10%	0.72%	0.68%	3.59%	0.42%
过去三个月	0.69%	1.24%	0.82%	0.79%	-0.13%	0.45%
过去六个月	1.04%	1.47%	-5.01%	0.98%	6.05%	0.49%
过去一年	7.11%	1.63%	4.65%	1.03%	2.46%	0.60%
自基金合同生效日起至今	38.66%	1.48%	-8.90%	1.01%	47.56%	0.47%

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 2014 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 2014 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 20 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		

骆泽斌	投资副总监、本基金基金经理、中海优质成长证券投资基金基金经理	2011年11月9日	-	-	15	骆泽斌先生，南开大学区域经济学专业博士。历任广发证券股份有限公司研究员、基金筹备组研究负责人，广发基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司总监、投资总监，长信基金管理有限公司总监。2010年6月进入本公司工作，曾任研究总监，现任投资副总监。2011年11月至今任中海消费主题精选股票型证券投资基金基金经理，2014年3月至今任中海优质成长证券投资基金基金经理。

					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遵规守信情况的说明

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，由公司风险管理部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，并针对交易占比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，风险管理部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

2014 年以来，市场经历了剧烈的波动，尤其是以创业板为代表的泛成长股表现出了显著的估值压力。报告期内本基金坚持了以成长股为主导的投资思路，遵循自下而上的原则进行选股，集中配置了医药、电子、信息服务、新材料等行业内的业绩增长确定的个股。

尽管预期到随着泛成长股估值水平的显著泡沫化及由此引发的市场风险愈加突出，并认为成长风格的分化将是 2014 年结构性市场的另一道风景，但是以主题投资名义演绎的小市值行情显得非常疯狂。树欲静，风不止，尽管我们始终保持反省的精神，并把风险控制作为今年组合管理的首要任务，但是自觉或不自觉的参与其中，并让我们见识了所谓波动的力量。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值 1.161 元（累计净值 1.371 元）。报告期内本基金净值增长率为 1.04%，高于业绩比较基准 6.05 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

2014 年以来，为了对冲宏观经济的下行风险，宏观管理机构采取了以微刺激为核心的政策组合，增长预期再度强化。展望下半年，随着经济企稳复苏预期的部分强化，同时引入增量资金的政策措施，如沪港通等政策的即将推出，有望打破存量资金博弈的既有均衡，引导市场风格的转变，尽管我们对风格转变的持续性表示怀疑。

根据盈利、流动性与估值的综合分析，预期下半年市场指数依然缺乏趋势性的机会。由于盈利、流动性与估值的变化趋势非常清晰，因此逻辑上判断导致市场波动的主因应该来自于外生变量。综合而言，政策变化所引致的这三个因素边际预期的变化，将主导市场的短期波动，这也是主题投资的主要机会。对于成长股而言，预期存量博弈的结构基本稳定，宏观整体流动性的边际变化将通过引致市场流动性的边际变化而导致市场的结构性变动，从而使得成长投资更多表现为一种主题投资的性质，尤其是在泛成长股的估值水平再次处于高水平后，我们预期这一特征将继续强化。

基于较为谨慎的预期，本基金下半年将采取更加均衡的投资策略，在以确定性增长作为组合管理首要原则的同时，将更加注重稳增长政策的着力点，如铁路、通讯、能源、新能源汽车、物流等领域内出现的新兴投资机会。

## 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 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：中海消费主题精选股票型证券投资基金

报告截止日： 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,643,602.42	9,846,719.81
结算备付金		88,915.94	115,036.40
存出保证金		47,205.38	114,686.00
交易性金融资产	6.4.7.2	67,572,328.73	76,792,606.92
其中：股票投资		67,572,328.73	76,792,606.92
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		1,025,552.28	—
应收利息	6.4.7.5	1,644.51	2,132.09
应收股利		—	—
应收申购款		26,826.90	10,289.86
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		78,406,076.16	86,881,471.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<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		1,303,125.32	468,415.05
应付赎回款		20,115.89	80,581.07
应付管理人报酬		92,571.19	106,891.76
应付托管费		15,428.54	17,815.30
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	101,893.59	83,251.31

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	97, 343. 03	55, 935. 48
负债合计		1, 630, 477. 56	812, 889. 97
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	66, 108, 989. 73	74, 883, 133. 70
未分配利润	6.4.7.10	10, 666, 608. 87	11, 185, 447. 41
所有者权益合计		76, 775, 598. 60	86, 068, 581. 11
负债和所有者权益总计		78, 406, 076. 16	86, 881, 471. 08

注 1：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.161 元，基金份额总额 66,108,989.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中海消费主题精选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
<b>一、收入</b>		1, 212, 198. 55	10, 735, 260. 59
1.利息收入		48, 120. 93	27, 932. 34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48, 120. 93	27, 932. 34
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）		-634, 713. 90	11, 813, 923. 58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-819, 090. 39	11, 577, 647. 12
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	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	184, 376. 49	236, 276. 46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1, 774, 692. 50	-1, 162, 958. 58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24, 099. 02	56, 363. 25
<b>减：二、费用</b>		1, 255, 037. 39	1, 141, 490. 92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	629, 306. 65	469, 041. 96
2. 托管费	6.4.10.2.2	104, 884. 43	78, 173. 65
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	469,391.47	412,476.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	51,454.84	181,798.46
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-42,838.84	9,593,769.67
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-42,838.84	9,593,769.67

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中海消费主题精选股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	74,883,133.70	11,185,447.41	86,068,581.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-42,838.84	-42,838.84
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)	-8,774,143.97	-475,999.70	-9,250,143.67
其中：1.基金申购款	14,068,529.49	2,768,088.02	16,836,617.51
2.基金赎回款	-22,842,673.46	-3,244,087.72	-26,086,761.18
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)	66,108,989.73	10,666,608.87	76,775,598.60
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	52,587,450.20	2,848,182.32	55,435,632.52

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,593,769.67	9,593,769.67
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)	11,995,980.89	3,462,358.30	15,458,339.19
其中：1.基金申购款	50,025,690.84	13,317,782.74	63,343,473.58
2.基金赎回款	-38,029,709.95	-9,855,424.44	-47,885,134.39
四、本期间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)	64,583,431.09	15,904,310.29	80,487,741.38

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：

\_\_\_\_黄鹏\_\_\_\_ 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》核准募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，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；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于2011年11月9日生效，该日的基金份额总额为336,549,461.88份。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日新修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业

实务操作的有关规定编制。

#### **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 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的说明**

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 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**

根据财政部、国家税务总局财税字〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字〔2004〕78号《关于证券投资基金管理政策的通知》、财税〔2005〕11号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税〔2005〕102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔2005〕103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税〔2007〕84号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

##### **6.4.6.1**

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

##### **6.4.6.2**

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

##### **6.4.6.3**

对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对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，暂不征收企业所得税。

##### **6.4.6.4**

基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1%的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

##### **6.4.6.5**

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂

免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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 2014年6月30日
活期存款	9,643,602.42
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	9,643,602.42

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	61,594,418.88	67,572,328.73	5,977,909.85
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	61,594,418.88	67,572,328.73	5,977,909.85

##### 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 2014年6月30日
应收活期存款利息	1, 589. 34
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	36. 00
应收债券利息	-
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	19. 17
合计	1, 644. 51

#### 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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	99, 973. 59
银行间市场应付交易费用	1, 920. 00
合计	101, 893. 59

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	45. 44
其他	11, 642. 25
预提费用	85, 655. 34
合计	97, 343. 03

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	74,883,133.70	74,883,133.70
本期申购	14,068,529.49	14,068,529.49
本期赎回(以"-"号填列)	-22,842,673.46	-22,842,673.46
本期末	66,108,989.73	66,108,989.73

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

#### 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	7,638,400.16	3,547,047.25	11,185,447.41
本期利润	-1,817,531.34	1,774,692.50	-42,838.84
本期基金份额交易产生的变动数	-510,815.84	34,816.14	-475,999.70
其中：基金申购款	1,240,551.23	1,527,536.79	2,768,088.02
基金赎回款	-1,751,367.07	-1,492,720.65	-3,244,087.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,310,052.98	5,356,555.89	10,666,608.87

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	45,817.58
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	1,777.01
其他	526.34
合计	48,120.93

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	157,916,204.23
减：卖出股票成本总额	158,735,294.62
买卖股票差价收入	-819,090.39

### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金在本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.1 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 衍生工具收益

注：本基金在本报告期无衍生工具收益。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	184,376.49
基金投资产生的股利收益	—
合计	184,376.49

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	1,774,692.50
——股票投资	1,774,692.50
——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	—
合计	1,774,692.50

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	20,976.38
转出基金补偿收入	3,122.64

合计	24,099.02
----	-----------

注：根据《中海消费主题精选股票型证券投资基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的 25% 归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	469,391.47
银行间市场交易费用	-
合计	469,391.47

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	21,819.55
信息披露费	19,835.79
上清所 CA 证书费	400.00
银行费用	399.50
账户服务费	9,000.00
合计	51,454.84

#### 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

本基金在本报告期无需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金在本报告期内无需要说明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

农业银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
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

#### 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	11,458,501.12	3.75%	1,963,751.33	0.72%

##### 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。

##### 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。

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	10,431.76	3.77%	2,630.81	2.63%
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日				
关联方名称	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
	1,787.74	0.73%	1,787.74	1.75%

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

深市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	629,306.65	469,041.96
其中：支付销售机构的客户维护费	101,963.25	88,501.78

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	104,884.43	78,173.65

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

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	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	25,567,312.33	38.6700%	25,567,312.33	34.1400%

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	9,643,602.42	45,817.58	4,176,324.24	25,212.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

#### 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

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金在本报告期未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014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

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300166	东方国信	2014年4月9日	重大事项停牌	19.88	2014年7月9日	20.58	261,674	4,929,440.82	5,202,079.12	
300199	翰宇药业	2014年2月20日	重大事项停牌	24.40	2014年8月20日	29.00	189,903	4,003,029.36	4,633,633.20	
300271	华宇软件	2014年6月27日	重大事项停牌	40.30	-	-	76,206	2,079,106.90	3,071,101.80	
002638	勤上光电	2014年6月10日	重大事项停牌	14.15	2014年7月15日	14.75	191,867	2,531,439.20	2,714,918.05	

#### 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《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阀值及内部控制流程，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、风险管理部、监察稽核部、相关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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性极小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **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困难，从而对基金收益造成的不利影响。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。

本基金所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金严格控制现金或者到期日在一年以内的政府债券持有量在基金资产净值中的占比保持在 5%以上的水平。

2014 年 6 月 30 日，本基金股票资产持仓比例为 88.01%，债券持仓比例为 0.00%。以当日股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，除去因停牌而无法计算变现天数的个股之外，本基金的股票资产加权平均变现天数为 0.03 天，其中持仓股票最长变现天数为 0.15 天。

2013 年 12 月 31 日，本基金股票资产持仓比例为 89.22%，债券持仓比例为 0.00%。以当日股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，本基金的股票资产加权平均变现天数为 0.03 天，其中持仓股票最长变现天数为 0.10 天。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人运用多种量化工具对基金市场风险进行定量测定与控制。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

本基金持有的股票资产不计利息。对于计息类交易性金融资产，本基金通过合理搭配其期限结构，从而达到有效降低基金利率风险的目的。

下表分别列示了截止 2014 年 6 月 30 日与 2013 年 12 月 31 日，本基金所面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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
<b>资产</b>							
银行存款	9,643,602.42	-	-	-	-	-	9,643,602.42
结算备付金	88,915.94	-	-	-	-	-	88,915.94
存出保证金	47,205.38	-	-	-	-	-	47,205.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	67,572,328.73	67,572,328.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,025,552.28	1,025,552.28
应收利息	-	-	-	-	-	1,644.51	1,644.51
应收申购款	-	-	-	-	-	26,826.90	26,826.90
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,779,723.74	-	-	-	-	68,626,352.42	78,406,076.16
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,303,125.32	1,303,125.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,115.89	20,115.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	92,571.19	92,571.19
应付托管费	-	-	-	-	-	15,428.54	15,428.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	101,893.59	101,893.59
其他负债	-	-	-	-	-	97,343.03	97,343.03
负债总计	-	-	-	-	-	1,630,477.56	1,630,477.56
利率敏感度缺口	9,779,723.74	-	-	-	-	66,995,874.86	76,775,598.60
上年度末 2013 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
<b>资产</b>							
银行存款	9,846,719.81	-	-	-	-	-	9,846,719.81
结算备付金	115,036.40	-	-	-	-	-	115,036.40

存出保证金	114,686.00	-	-	-	-	-	114,686.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,792,606.92	76,792,606.92
应收利息	-	-	-	-	-	2,132.09	2,132.09
应收申购款	-	-	-	-	-	10,289.86	10,289.86
资产总计	10,076,442.21	-	-	-	-	76,805,028.87	86,881,471.08
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	468,415.05	468,415.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	80,581.07	80,581.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	106,891.76	106,891.76
应付托管费	-	-	-	-	-	17,815.30	17,815.30
应付交易费用	-	-	-	-	-	83,251.31	83,251.31
其他负债	-	-	-	-	-	55,935.48	55,935.48
负债总计	-	-	-	-	-	812,889.97	812,889.97
利率敏感度缺口	10,076,442.21	-	-	-	-	75,992,138.90	86,068,581.11

#### 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经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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( 2014 年 6 月 30 日 )	上年度末 ( 2013 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

本基金没有持有外汇资产及负债，故汇率变化不会对本基金产生重大的影响。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指除利率和汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险，本基金的其他价格风险主要由股票价格变动对基金资产造成损失的可能性。

本基金通过资产优化配置降低股票市场价格风险。此外，本基金管理人定期运用多种定量方法进行风险度量和分析。

#### 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	67,572,328.73	88.01	76,792,606.92	89.22
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	67,572,328.73	88.01	76,792,606.92	89.22

#### 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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）	
	+5%	2,383,913.08	2,748,155.14
	-5%	-2,383,913.08	-2,748,155.14

#### 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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR(%)	2.41	2.77

## § 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	67, 572, 328. 73	86. 18
	其中：股票	67, 572, 328. 73	86. 18
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	9, 732, 518. 36	12. 41
7	其他各项资产	1, 101, 229. 07	1. 40
8	合计	78, 406, 076. 16	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	49, 430, 104. 35	64. 38
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	3, 068, 489. 18	4. 00
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	11, 532, 459. 92	15. 02
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3, 541, 275. 28	4. 61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67, 572, 328. 73	88. 01

### 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	300166	东方国信	261, 674	5, 202, 079. 12	6. 78
2	002450	康得新	203, 700	4, 634, 175. 00	6. 04
3	300199	翰宇药业	189, 903	4, 633, 633. 20	6. 04
4	300177	中海达	253, 426	3, 940, 774. 30	5. 13
5	300015	爱尔眼科	145, 492	3, 541, 275. 28	4. 61
6	300271	华宇软件	76, 206	3, 071, 101. 80	4. 00
7	002262	恩华药业	138, 158	3, 068, 489. 18	4. 00
8	300034	钢研高纳	179, 801	2, 986, 494. 61	3. 89
9	600563	法拉电子	84, 900	2, 822, 925. 00	3. 68
10	300331	苏大维格	85, 400	2, 719, 990. 00	3. 54
11	300026	红日药业	92, 700	2, 716, 110. 00	3. 54
12	002638	勤上光电	191, 867	2, 714, 918. 05	3. 54
13	300030	阳普医疗	213, 813	2, 661, 971. 85	3. 47
14	002108	沧州明珠	183, 300	2, 322, 411. 00	3. 02
15	000823	超声电子	190, 640	2, 312, 463. 20	3. 01
16	600594	益佰制药	54, 375	2, 236, 443. 75	2. 91
17	300115	长盈精密	94, 506	2, 081, 022. 12	2. 71
18	300296	利亚德	116, 500	1, 931, 570. 00	2. 52
19	002465	海格通信	116, 100	1, 849, 473. 00	2. 41
20	300059	东方财富	131, 000	1, 575, 930. 00	2. 05
21	300032	金龙机电	72, 900	1, 334, 070. 00	1. 74
22	600176	中国玻纤	147, 000	1, 140, 720. 00	1. 49
23	300207	欣旺达	38, 000	1, 109, 600. 00	1. 45

24	300300	汉鼎股份	34,000	904,060.00	1.18
25	300273	和佳股份	27,509	844,526.30	1.10
26	601231	环旭电子	27,028	833,543.52	1.09
27	002690	美亚光电	23,535	830,079.45	1.08
28	002474	榕基软件	90,300	779,289.00	1.02
29	300054	鼎龙股份	63,900	773,190.00	1.01

## 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	002241	歌尔声学	5,106,129.86	5.93
2	300166	东方国信	4,929,440.82	5.73
3	002219	恒康医疗	4,695,725.00	5.46
4	002450	康得新	4,239,859.89	4.93
5	600323	瀚蓝环境	3,946,338.83	4.59
6	600718	东软集团	3,900,973.41	4.53
7	600998	九州通	3,804,687.00	4.42
8	002065	东华软件	3,777,080.00	4.39
9	002402	和而泰	3,292,960.00	3.83
10	002474	榕基软件	3,186,766.56	3.70
11	600667	太极实业	2,969,346.00	3.45
12	300039	上海凯宝	2,963,431.84	3.44
13	300273	和佳股份	2,930,883.40	3.41
14	002262	恩华药业	2,870,895.43	3.34
15	600594	益佰制药	2,865,685.00	3.33
16	600563	法拉电子	2,773,458.53	3.22
17	002690	美亚光电	2,724,299.51	3.17
18	300034	钢研高纳	2,641,475.54	3.07
19	300331	苏大维格	2,564,120.00	2.98
20	002638	勤上光电	2,531,439.20	2.94
21	300182	捷成股份	2,475,067.00	2.88
22	300026	红日药业	2,439,625.00	2.83
23	300030	阳普医疗	2,342,370.96	2.72

24	000823	超声电子	2, 251, 627. 80	2. 62
25	002108	沧州明珠	2, 233, 548. 56	2. 60
26	300199	翰宇药业	2, 157, 447. 00	2. 51
27	000938	紫光股份	2, 075, 007. 00	2. 41
28	300015	爱尔眼科	2, 073, 874. 31	2. 41
29	000566	海南海药	2, 049, 391. 75	2. 38
30	002214	大立科技	2, 026, 881. 47	2. 35
31	002008	大族激光	2, 015, 166. 90	2. 34
32	300124	汇川技术	2, 007, 198. 00	2. 33
33	300296	利亚德	1, 908, 094. 92	2. 22
34	600196	复星医药	1, 874, 257. 74	2. 18
35	002185	华天科技	1, 868, 229. 92	2. 17
36	300017	网宿科技	1, 806, 574. 00	2. 10
37	601169	北京银行	1, 769, 464. 00	2. 06
38	300115	长盈精密	1, 759, 770. 69	2. 04
39	300244	迪安诊断	1, 749, 530. 00	2. 03
40	002465	海格通信	1, 743, 604. 19	2. 03

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	002241	歌尔声学	10, 054, 878. 74	11. 68
2	600587	新华医疗	6, 045, 327. 78	7. 02
3	300168	万达信息	5, 326, 131. 20	6. 19
4	002219	恒康医疗	4, 717, 295. 09	5. 48
5	300030	阳普医疗	4, 133, 853. 54	4. 80
6	300058	蓝色光标	3, 832, 595. 55	4. 45
7	600718	东软集团	3, 668, 842. 61	4. 26
8	002223	鱼跃医疗	3, 513, 382. 67	4. 08
9	600998	九州通	3, 358, 512. 92	3. 90
10	600323	瀚蓝环境	3, 324, 154. 80	3. 86
11	002065	东华软件	3, 238, 542. 51	3. 76
12	002400	省广股份	3, 216, 825. 30	3. 74
13	002415	海康威视	3, 151, 401. 01	3. 66

14	600089	特变电工	3, 083, 977. 36	3. 58
15	002618	丹邦科技	3, 042, 895. 38	3. 54
16	300124	汇川技术	2, 944, 760. 60	3. 42
17	600196	复星医药	2, 892, 284. 33	3. 36
18	600667	太极实业	2, 809, 957. 90	3. 26
19	300039	上海凯宝	2, 731, 560. 11	3. 17
20	002402	和而泰	2, 705, 692. 00	3. 14
21	300146	汤臣倍健	2, 408, 541. 80	2. 80
22	300074	华平股份	2, 371, 311. 48	2. 76
23	002474	榕基软件	2, 354, 619. 57	2. 74
24	300020	银江股份	2, 335, 821. 00	2. 71
25	300182	捷成股份	2, 240, 787. 41	2. 60
26	000938	紫光股份	2, 192, 929. 65	2. 55
27	002008	大族激光	2, 111, 578. 00	2. 45
28	002450	康得新	2, 093, 970. 19	2. 43
29	600887	伊利股份	2, 057, 906. 50	2. 39
30	300244	迪安诊断	1, 965, 433. 98	2. 28
31	600804	鹏博士	1, 939, 556. 93	2. 25
32	600703	三安光电	1, 925, 192. 61	2. 24
33	000566	海南海药	1, 847, 215. 17	2. 15
34	002185	华天科技	1, 828, 828. 00	2. 12
35	002049	同方国芯	1, 798, 275. 85	2. 09
36	300217	东方电热	1, 761, 160. 31	2. 05
37	300045	华力创通	1, 726, 249. 98	2. 01

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	147, 740, 323. 93
卖出股票收入（成交）总额	157, 916, 204. 23

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的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**

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

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	47,205.38
2	应收证券清算款	1,025,552.28
3	应收股利	-
4	应收利息	1,644.51
5	应收申购款	26,826.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,101,229.07

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300166	东方国信	5,202,079.12	6.78	重大事项停牌
2	300199	翰宇药业	4,633,633.20	6.04	重大事项停牌
3	300271	华宇软件	3,071,101.80	4.00	重大事项停牌

### 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
4, 794	13, 789. 94	41, 038, 620. 28	62. 08%	25, 070, 369. 45	37. 92%

## 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	140, 009. 22	0. 2118%

## 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	0~10
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	74, 883, 133. 70
本报告期基金总申购份额	14, 068, 529. 49
减：本报告期基金总赎回份额	22, 842, 673. 46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	66, 108, 989. 73

## § 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，本基金管理人免去朱冰峰先生督察长职务；聘请副总经理宋宇先生兼任代理督察长职务。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 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

为本基金审计的会计师事务所为江苏公证天业会计师事务所（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	
银河证券	2	73,137,113.56	23.96%	66,584.23	24.07%	-
民生证券	2	53,476,500.23	17.52%	48,685.16	17.60%	-
华宝证券	1	31,579,816.51	10.35%	28,750.29	10.39%	-
兴业证券	1	28,115,611.90	9.21%	25,596.13	9.25%	-
光大证券	1	22,219,519.62	7.28%	20,228.69	7.31%	-
国信证券	1	20,362,279.65	6.67%	18,537.79	6.70%	-
宏源证券	1	15,605,186.59	5.11%	14,206.98	5.14%	-
国联证券	1	11,458,501.12	3.75%	10,431.76	3.77%	-
招商证券	1	11,056,424.55	3.62%	10,065.83	3.64%	-

长江证券	1	10,394,568.90	3.41%	9,463.32	3.42%	-
中信建投	1	8,476,718.73	2.78%	7,717.19	2.79%	-
国金证券	1	6,677,069.03	2.19%	6,078.71	2.20%	-
川财证券	1	6,218,746.07	2.04%	4,417.81	1.60%	-
国泰君安证券	1	3,853,793.50	1.26%	3,508.56	1.27%	-
中信证券	2	2,576,954.00	0.84%	2,346.06	0.85%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	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；报监察稽核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；退租了中航证券的上海交易单元。

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：本基金在本报告期未租用证券公司交易单元进行债券交易、回购交易及权证交易。

### 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	中海消费主题精选股票型证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报	2014 年 1 月 21 日
2	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 2 月 26 日

3	中海基金管理有限公司关于开展官网直销 e 通宝定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 2 月 26 日
4	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 2 月 28 日
5	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 5 日
6	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并开通基金转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 10 日
7	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与光大证券股份有限公司手机客户端申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 12 日
8	中海基金管理有限公司关于开通工商银行卡网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 18 日
9	中海基金管理有限公司关于开展官网直销基金转换补差费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 28 日
10	中海消费主题精选股票型证券投资基金 2013 年年度报告（正文）	中海基金网站	2014 年 3 月 29 日
11	中海消费主题精选股票型证券投资基金 2013 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报	2014 年 3 月 29 日
12	中海基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 16 日

	部分基金参与华夏银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	券报	
13	中海消费主题精选股票型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 19 日
14	中海基金管理有限公司关于恢复对旗下基金持有的长期停牌股票“新华医疗”进行市价估值的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 22 日
15	中海基金管理有限公司关于恢复对旗下基金持有的长期停牌股票“鱼跃医疗”进行市价估值的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 26 日
16	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 26 日
17	中海基金管理有限公司关于子公司中海恒信资产管理（上海）有限公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 4 月 30 日
18	中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 5 月 10 日
19	中海基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 5 月 24 日
20	中海基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 14 日
21	中海基金管理有限公司关于旗下基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构并开通基金转	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 20 日

	换及定期定额投资业务的公告		
22	中海基金管理有限公司关于旗下基金继续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	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 20 日
23	中海消费主题精选股票型证券投资基金更新招募说明书(2014年第1号)	中海基金网站	2014 年 6 月 21 日
24	中海消费主题精选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要(2014年第1号)	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 21 日
25	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 26 日
26	中海基金管理有限公司关于北京分公司营业场所地址变更的公告	中国证券报、上海证券报	2014 年 6 月 27 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

2014年8月27日