(上接B073版)

公司网址:www.myfund.com

(68)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1108

办公地址: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1108

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

(69)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:4006236060

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

(70)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

(71)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

(72)深圳前海微众银行股份有限公司(仅代销C类份额)

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

(73)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

(74)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

(75)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/

(76)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

(77)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

(78)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

(79)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

(80)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

(81)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:北京市海淀区西北旺东路10号院东区3号楼为明大厦C座

法定代表人:赵芯蕊

电话:010-62675768

传真:010-62676582

联系人:赵芯蕊

客户服务电话:010-62675369

公司网址:www.xincai.com

(82)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

(83)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

(84)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

(85)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

(86)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

(87)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

(88)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

(89)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

(90)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/

(91)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

(92)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

(93)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

(94)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

(95)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

(96)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

(97)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:季长军

联系人:何鹏

客户服务电话:400-819-6665

公司网址:www.buyforyou.com.cn

(98)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:赵壁

联系人:徐莉

客户服务电话:400-8010-009

公司网址:http://www.huayihengxin.com

(99)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

(100)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/

(101)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

(102)北京晟视天下基金销售有限公司

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

(103)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

(104)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/

(105)万家财富基金销售(天津)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/

(106)深圳前海财厚基金销售有限公司

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高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室

法定代表人:杨艳平

联系人:胡闻智

客户服务电话:400-128-6800

公司网址:www.caiho.cn

(107)西藏东方财富证券股份有限公司

住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦

法定代表人:陈宏

联系人:付佳

联系电话:021-23586603

客服电话:95357

公司网址:http://www.18.cn

(108)北京百度百盈基金销售有限公司

住所:北京市海淀区上地十街10号百度大厦

办公地址:北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人:张旭阳

联 系 人:孙博超

电　　话:010-61952703

客服电话: 95055-4

公司网址: www.baiyingfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,变更或增减其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

(二)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

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

负责人:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:孙睿

经办律师:黎明、孙睿

(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、蔺育化

四、基金的名称

中海医药健康产业精选灵活配置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

本基金主要投资于医药健康产业上市公司, 在控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

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 (包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票的比例占基金资产的0-95%,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于医药健康产业证券的资产不低于非现金基金资产的80%。

八、基金的投资策略

1、一级资产配置

一级资产配置主要采取自上而下的方式。

本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、医药健康行业发展趋势等分析判断判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征,动态确定基金资产在固定收益类和权益类资产的配置比例。

2、股票投资策略

(1)医药健康产业的界定

本基金所称医药健康产业具体包括以下两类公司:

1)主营业务从事医药健康行业(包括但不限于化学制药、中药、生物制品、医药商业、医疗器械和医疗服务等行业)的公司;

2)当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医药健康产业,且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。

当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述医药健康产业的识别及认定。

(2)医药健康产业股票的投资策略

本基金投资于医药健康产业证券的资产不低于非现金基金资产的80%。本基金对医药健康产业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)定量方式

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势的个股。

本基金考察的财务指标主要包括:净资产收益率、资产负债率。

本基金考察的估值指标主要包括:市盈率和市盈率/净利增长率。

本基金考察的成长指标主要包括:营业收入增长率、净利润增长率。

本基金将结合市场形势综合考虑上市公司在各项指标的综合得分,按照总分的高低在各行业内进行排序,选取各行业内排名靠前的股票。

2)定性方式

本基金主要通过实地调研等方法,综合考察评估公司的核心竞争优势,重点投资具有较高进入壁垒、在行业中具备比较优势的公司,并坚决规避那些公司治理混乱、管理效率低下的公司,以确保最大程度地规避投资风险。

本基金管理人重点考察上市公司的竞争优势包括:公司管理竞争优势、技术或产品竞争优势、品牌竞争优势、规模优势等方面。

3、债券投资策略

(1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。

利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期的属性,即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。

(2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。

在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过优化资产配置模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

子弹组合,即使组合的现金流尽量集中分布;

杠铃组合,即使组合的现金流尽量呈两极分布;

梯形组合,即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

(3)债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。

本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离可转债、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

个券选择:基于各个投资品种具体情况,自下而上的资产配置。

个券选择应遵循如下原则:

相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低的品种。

流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。

4、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析, 评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将运用期权估值模型,根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势,并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

九、基金的投资决策依据和决策程序

(一) 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。

(二) 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等提出个股、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等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、基金的投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金对股票的投资比例占基金资产的0-95%;

(2)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;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部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%;

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8)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,不得超过基金资产净值的10%;

(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(10)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%;

(11)本基金管理人管理的全部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%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(13)基金财产参与股票发行申购,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;

(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(15)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(16)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;

(17)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;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(12)、(16)、(17)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

十一、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

中证医药卫生指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

本基金为混合型基金,股票资产占基金资产的0-95%,从长期看,本基金股票资产平均配置比例为50%,债券资产的平均配置比例为50%。因此,业绩比较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。

中证医药卫生指数是由中证指数有限公司编制并发布。该指数为反映沪深A股医药卫生行业的整体表现,将中证800指数800只样本股中的全部医药卫生行业成份股编制而成,综合反映了A股市场的医药卫生行业整体表现。中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,具有很高的代表性。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素,本基金选用中证医药卫生指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十二、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金, 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。

十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本基金投资组合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。

基金托管人浦东发展银行股份有限公司根据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为截至2019年9月30日报告期末的第三季度报告数据,其中所列财务数据未经审计。

1、基金资产组合情况

截至2019年9月30日, 中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金A类资产净值为679,097,588.35元, 基金份额净值为1.799元,累计基金份额净值为1.959元;C类资产净值为216,211,156.87元, 基金份额净值为1.740元, 累计基金份额净值为1.900元。其资产组合情况如下:

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	833,852,740.21	92.61
	其中:股票	833,852,740.21	92.61
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	59,353,150.29	6.59
8	其他资产	7,160,022.52	0.80
9	合计	900,365,913.02	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	424,086,858.23	47.37
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	105,372,600.00	11.77
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	687,181.98	0.08
J	金融业	71,185,100.00	7.95
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	53,754,000.00	6.00
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	178,767,000.00	19.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	833,852,740.21	93.14

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	002044	美年健康	6,950,000	84,512,000.00	9.44
2	603883	老百姓	1,100,000	83,303,000.00	9.30
3	600763	通策医疗	800,000	82,000,000.00	9.16
4	002007	华兰生物	2,300,000	78,890,000.00	8.81
5	300572	安车检测	1,395,000	72,819,000.00	8.13
6	603259	药明康德	620,000	53,754,000.00	6.00
7	000661	长春高新	133,000	52,449,880.00	5.86
8	688029	南微医学	382,672	50,720,937.12	5.67
9	300326	凯利泰	2,750,000	40,700,000.00	4.55
10	002773	康弘药业	1,220,000	40,638,200.00	4.54

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投资。

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投资。

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名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2019年9月30日,本基金的其他资产项目构成如下:

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	829,201.10
2	应收证券清算款	2,436,348.18
3	应收股利	-
4	应收利息	23,888.37
5	应收申购款	3,870,584.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,160,022.52

(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债。

(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	688029	南微医学	1,171,568.48	0.13	新股流通受限

(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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金A类份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截止日期2019年9月30日):

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.12.17-2014.12.31	1.50%	0.43%	-2.58%	0.67%	4.08%	-0.24%
2015.01.01-2015.12.31	25.52%	2.47%	27.68%	1.30%	-2.16%	1.17%
2016.01.01-2016.12.31	-14.84%	1.58%	-4.15%	0.83%	-10.69%	0.75%
2017.01.01-2017.12.31	33.18%	0.91%	7.14%	0.39%	26.04%	0.52%
2018.01.01-2018.12.31	-9.62%	1.99%	-9.42%	0.84%	-0.20%	1.15%
2019.1.1-2019.6.30	35.36%	1.55%	10.01%	0.85%	25.35%	0.70%
2019.7.1-2019.9.30	11.35%	1.01%	3.47%	0.53%	7.88%	0.48%
自基金合同生效起至今	34.19%	1.76%	30.15%	0.88%	4.04%	0.88%

本基金C类份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截止日期2019年9月30日):

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.12.17-2014.12.31	1.50%	0.43%	-2.58%	0.67%	4.08%	-0.24%
2015.01.01-2015.12.31	23.94%	2.47%	27.68%	1.30%	-3.74%	1.17%
2016.01.01-2016.12.31	-15.58%	1.58%	-4.15%	0.83%	-11.43%	0.75%
2017.01.01-2017.12.31	32.11%	0.91%	7.14%	0.39%	24.97%	0.52%
2018.01.01-2018.12.31	-9.41%	2.00%	-9.42%	0.84%	0.01%	1.16%
2019.1.1-2019.6.30	35.23%	1.55%	10.01%	0.85%	25.22%	0.70%
2019.7.1-2019.9.30	11.09%	1.01%	3.47%	0.53%	7.62%	0.48%
自基金合同生效起至今	33.99%	1.76%	30.15%	0.88%	3.84%	0.88%

注:本基金合同生效日为2014年12月17日,基金的过往业绩并不预示其未来

表现。

十五、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金销售服务费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的开户费用、账户维护费用;

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为1.00%, 销售服务费按前一日C 类基金份额的基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$

H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人, 由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述"(一)基金费用的种类中第4-10项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费、基金托管费和基金销售服务费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2个工作日前在指定媒介上刊登公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、对招募说明书更新部分的说明

(一)在"重要提示"部分,对相关内容进行补充。

(二) 在"绪言"部分,对相关法律法规的名称进行了更新。

(三) 在"释义"部分,对相关释义进行了补充和更新。

(四) 在"基金管理人"部分,对"基金管理人的职责"的相关内容进行了更新。

(五) 在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回场所"、"申购与赎回的数额限制"、"巨额赎回的公告"、"暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告"的相关内容进行了更新。

(六) 在"基金的收益分配"部分,对"收益分配方案的确定、公告与实施"的相关内容进行了更新。

(七) 在"基金的费用与税收"部分,对"基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整"的相关内容进行了更新。

(八) 在"基金的会计与审计"部分,对"基金的年度审计"的相关内容进行了更新。

(九) 在"基金的信息披露"部分,对"信息披露义务人"、"本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息"、"本基金公开披露的信息应采用中文文本"、"公开披露的基金信息"、"信息披露事务管理"、"信息披露文件的存放与查阅"的相关内容进行了更新。

(十) 在"基金合同的变更、终止与基金财产的清算"部分,对"基金合同的变更"、"基金财产的清算"、"基金财产清算的公告"的相关内容进行了更新。

(十一) 在"基金合同的内容摘要"部分,根据最新的《中海医药健康产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行了更新。

(十二) 在"其他应披露的事项"中,披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司

二〇二〇年七月四日