

B048 信息披露 | Disclosure

(上接B047版)

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
 电话:0755-89460500
 联系人:陈广浩
 客服电话:400-684-0500
 68)北京新浪合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
 联系人:赵芯蕊
 客服电话:010-62675369
 69)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:010-59601366-7024
 联系人:李露平
 客服电话:400-818-8000
 70)珠海盈泰基金销售有限公司
 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
 电话:020-896290994
 联系人:黄敏娟
 客服电话:020-89629066
 71)一路财富(北京)基金销售股份有限公司
 住所:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
 办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
 法定代表人:吴晋秀
 电话:010-88312877-8028
 联系人:程京露
 客服电话:400-001-1966
 72)上海利得基金销售有限公司
 住所:上海市宝山区蕴川路6475号1033室
 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
 法定代表人:李兴春
 客服电话:400-921-7733
 73)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浦项中心B座19层
 法定代表人:齐剑辉
 客服电话:400-623-6060
 74)上海云湾基金销售有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区新金桥27号、明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区
 法定代表人:冯轶明
 电话:021-20530224
 联系人:江辉
 客服电话:400-820-1515
 75)上海联泰基金销售有限公司
 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:上海市市长宁区福泉北路518号8号楼3层
 法定代表人:尹彬彬
 电话:021-52822063
 联系人:兰敏
 客服电话:400-118-1188
 76)北京盈泰基金销售有限公司
 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:北京市朝阳区朝阳门北大街8号富华大厦F12层B3室
 法定代表人:曲馨月
 电话:010-56176118
 联系人:张旭
 客服电话:400-100-3391
 77)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
 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:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE
 法定代表人:高峰
 客服电话:400-804-8688
 78)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:上海市浦东新区福山路33号8楼
 法定代表人:黄伟
 电话:021-51327185
 联系人:徐亚丹
 客服电话:400-799-1888
 79)北京成基基金销售有限公司
 住所:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号
 办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
 法定代表人:王伟刚
 客服电话:400-619-9069
 80)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
 联系人:刘昕霞
 客服电话:400-930-0660
 81)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:北京市海淀区大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
 法定代表人:王苏宁
 客服电话:95118
 82)上海辉腾汇富基金销售有限公司
 住所:北京市东城区朝阳门北大街8号8-2-2-1
 法定代表人:许宁
 电话:010-51455516
 联系人:周雯
 客服电话:400-829-1218
 83)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:张军
 电话:010-5901384
 联系人:王芳芳
 客服电话:010-59013842
 84)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:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
 法定代表人:申健
 电话:021-20219988
 联系人:张妮
 客服电话:021-20292031
 86)和讯信息科技有限公司
 住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王莉
 客服电话:400-920-0022
 86)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:上海市浦东新区银城中路488号的太平金融大厦1503-1504室
 法定代表人:王翔
 电话:021-65370077-209
 联系人:俞申莉
 客服电话:400-820-5369
 87)凤凰金信(海口)基金销售有限公司
 住所:海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园B区4层
 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:张旭
 客服电话:400-810-5919
 88)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
 客服电话:95177
 89)深圳盈信基金销售有限公司
 住所:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
 办公地址:大连市中山区南山1910小区A3-1
 法定代表人:苗宏升
 电话:0411-66661322
 联系人:王清臣
 客服电话:4007-903-688
 90)乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
 住所:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
 办公地址:北京市西城区德胜门外大街合生财富广场1302室
 法定代表人:董云巍
 客服电话:400-088-8080
 91)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:北京市朝阳区创远路34号院融融科技中心C座17层
 法定代表人:钟斐斐
 电话:010-61840688
 联系人:戚晓强
 客服电话:400-159-9288
 92)武汉市伯嘉基金销售有限公司
 住所:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
 办公地址:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
 法定代表人:陶健
 客服电话:400-027-9899
 93)天津润国美基金销售有限公司
 住所:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801
 办公地址:北京市朝阳区霞云路26号鹏润大厦B座9层
 法定代表人:丁东华
 客服电话:400-111-0889
 94)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号
 办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09号
 法定代表人:叶倩
 客服电话:400-066-8566
 95)上海投研基金销售有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元
 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元

法定代表人:吕柳霞
 联系人:毛善波
 电话:021-50810673
 客服电话:400-711-8718
 96)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16层
 法定代表人:毛淮平
 客服电话:400-817-5666
 97)中民财富基金销售(上海)有限公司
 住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
 办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场17层
 法定代表人:张洪军
 客服电话:400-876-5716
 98)深圳信诚基金销售有限公司
 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:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元
 法定代表人:周文
 客服电话:0755-23946579
 99)喜鹊财富基金销售有限公司
 住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
 办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
 法定代表人:陈皓
 客服电话:4006997719
 100)通华财富(上海)基金销售有限公司
 住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
 法定代表人:沈丹尹
 客服电话:4001019301 / 95193
 101)深圳市小牛基金销售有限公司
 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:深圳市福田区彩田路2009号瀚森大厦17楼
 法定代表人:李俊
 客服电话:4006869666
 102)沈阳鹏龙投资顾问有限公司
 住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601
 办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601
 法定代表人:朱东晖
 客服电话:400-003-5811
 103)厦门鑫鼎盛控股有限公司
 住所:厦门思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
 法定代表人:陈洪生
 客服电话:400-918-0908
 104)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
 住所:北京市丰台区东管营14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:侯昊昊
 客服电话:4008-909-998
 105)贵州省贵文文化基金销售有限公司
 住所:贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元5层17号
 办公地址:贵州省贵阳市南明区兴业西路CCDI大楼一楼
 法定代表人:陈成
 客服电话:0851-85407888
 106)济安财富(北京)基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
 办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
 法定代表人:杨健
 电话:010-65309516
 联系人:李海燕
 客服电话:400-673-7010
 107)嘉实财富管理有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海金中心办公楼二期16层5312-15单元
 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
 法定代表人:赵学军
 电话:010-85097570
 联系人:余永健
 客服电话:400-021-8850
 108)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
 住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
 法定代表人:戎兵
 客服电话:400-6099-200
 109)和耕传承基金销售有限公司
 住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房
 办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号国际电子城360大厦A座
 法定代表人:王旋
 客服电话:4000-655-671
 110)民商基金销售(上海)有限公司
 办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼
 法定代表人:龚惠蓉
 客服电话:021-50206003
 111)大阿财富基金销售有限公司
 住所:贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层12号
 法定代表人:王秋
 客服电话:0851-189236678
 112)北京诺基基金销售有限公司
 住所:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室
 法定代表人:樊怀东
 客服电话:4000899100
 113)江苏汇保大基金销售有限公司
 住所:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
 法定代表人:吴言川
 客服电话:025-56663409
 114)海银基金销售有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
 法定代表人:惠晓川
 客服电话:400-808-1016
 115)深圳新华信通基金销售有限公司
 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)
 法定代表人:韩森
 客服电话:400-000-5767
 116)中信期货有限公司
 住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
 法定代表人:张皓
 电话:13718246896/010-60834022
 联系人:刘宏莹
 客服电话:400-990-8826
 117)东海期货有限责任公司
 住所:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
 法定代表人:陈太康
 客服电话:95531/4008888588
 118)阳光人寿保险股份有限公司
 住所:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
 法定代表人:李科
 客服电话:96510
 119)宏元保险代理有限公司
 住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
 法定代表人:马永涛
 客服电话:021-50701082
 基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并在管理人网站上公示。
 二、登记机构
 名称:中融基金管理有限公司
 住所:深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B
 办公地址:北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦17楼
 法定代表人:王耀
 电话:010-56517000
 传真:010-56517001
 联系人:李庆庆
 网址:www.zrfunds.com.cn
 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:韩炯
 电话:021-31358666
 传真:021-31358600
 联系人:安冬
 经办律师:安冬、陆奇
 四、审计基金资产的会计师事务所
 名称:上会会计师事务所(特殊普通合伙)
 住所:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
 办公地址:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
 执行事务合伙人:张晓松(首席合伙人)
 电话:021-52920000
 传真:021-52921369
 经办注册会计师:陈大愚、江嘉伟
 联系人:杨伟平
 中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金
 第五部分 基金类型、运作方式与存续期间
 1. 基金类型:混合型。
 2. 基金的运作方式:契约型开放式。
 3. 基金存续期间:不定期。
 第六部分 基金的投资目标
 本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,以把握中国经济增长以及结构转型带来的消费升级过程中的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。
 第七部分 基金的投资范围
 本基金的投资对象是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(包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准上市)、港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市、的股票、权证、股指期货、国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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)。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。
 股票投资占基金资产的比例范围70%-95%。本基金不低于80%的非现金基金资产投资于港股,本基金投资于大消费主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货

期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当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;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
 股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
 第八部分 基金的投资策略
 1. 大类资产配置
 本基金通过全球宏观经济环境、区域经济发展情况分析,以及内地和香港证券市场走势判断,结合相关类别资产的风险收益水平特征,动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例,构建本基金投资组合。
 2. 股票投资策略
 (1)大消费主题的定义
 本基金所定义的大消费主题包括“衣、食、住、行”各个领域及其相关的消费行业,具体行业包括汽车、建筑装饰、家用电器、农林牧渔、轻工制造、纺织服装、食品饮料、商业贸易,以及电子产品消费(供消费者日常使用的电子产品及软件,如手机、音乐设备、电信运营网络、存储介质U盘、杀毒软件等)、涵盖计算机、电子、通信行业)、金融消费(如养老保险、银行理财、互联网金融等)、涵盖银行、证券、保险行业)、医疗消费(如日常体检、保健食品消费、病症治疗等)、涵盖生物医药行业)、娱乐消费(休闲服务、传媒、综合)等新兴消费行业,以及消费升级引领的住房、基础设施升级改造的相关行业。
 (2)个股投资策略
 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(ODI)境外投资额度进行境外投资。
 本基金在资本市场互联互通、资金双向流动机制下,充分发挥基金管理人的研究优势,挖掘A股市场 and 港股市场的投资机会,重点关注港股通标的股票,优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。
 本基金采用自下而上与自上而下相结合的选股策略,从宏观经济转型消费升级等多个角度出发,通过对境内股票及港股通标的股票的基本面分析和研究,筛选大消费行业中具有长期投资价值的领域,同时从定性和定量的角度,自下而上地分析上市公司的基本面情况和估值水平,精选大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司。
 定量分析
 1)成长性指标:主营业务收入增长率、净利润增长率等;
 2)财务指标:毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等;
 3)估值指标:市盈率(P/E)、市盈率相对盈利增长比率(PEG)、市销率(P/S)和总市值。绝对估值与相对估值相结合。
 定性分析
 1)公司的核心竞争力,体现在行业地位、市场占有率、产品、技术、品牌、营销、资源、渠道等多个方面;
 2)具有良好公司治理能力和治理结构。
 3. 债券投资策略
 通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析,对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪,从而决定其配置比例。固定收益类资产中,本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略,在不同券种之间进行配置。
 4. 股指期货投资策略
 本基金认为在符合一定条件的市场环境中,有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险,降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本基金在股指期货投资中将风险控制为原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,并按照中国金融期货交易所套期保值的有关规定执行。
 5. 中小企业私募债券投资策略
 本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整,适度分散投资来管理组合的风险。
 6. 资产支持证券投资策略
 资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。
 7. 国债期货投资策略
 国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。
 第九部分 基金的业绩比较基准
 沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×40%+上证国债指数收益率×50%
 沪深300指数是由中证指数公司编制发布,表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。其样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。
 恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。
 上证国债指数全称为“上海证券交易所国债指数”,是以上海证券交所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成。其编制方法借鉴了国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点,并充分考虑了国内债券市场发展的现状,具备科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。
 如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须经基金托管人同意,报中国证监会备案并提前公告,而无需召开基金份额持有人大会。
 第十部分 基金的风险收益特征
 本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
 第十一部分 基金的投资组合报告
 本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
 基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金基金合同规定,于2020年6月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
 本报告组合报告所载数据截至2020年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
 1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	55,104,491.59	84.19
	其中:股票	55,104,491.59	84.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	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	7,234,221.59	11.05
8	其他资产	3,113,563.44	4.76
9	合计	65,452,276.62	100.00

 2.报告期末按行业分类的股票投资组合
 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	1,229,800.00	1.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,223,190.00	5.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,542,000.00	2.49
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,994,990.00	9.66

 2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	港股通投资股票行业分类公允价值占基金资产净值比(%)
基础材料	8,392,946.34	13.53
消费者非必需品	14,259,567.68	22.98
消费者常用品	3,142,762.52	5.07
金融	648,727.00	1.05
医疗保健	7,296,990.94	11.76
工业	3,282,010.41	5.29
信息技术	8,612,609.30	13.88
电信服务	3,473,887.40	5.60
合计	49,109,501.59	79.16

 注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。
 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	H03323	中国建材	459,229	3,563,991.14	5.73
2	H00700	腾讯控股	10,000	3,473,887.40	5.60
3	H03690	美团点评-W	40,000	3,422,720.00	5.52
4	H00520	哔哩哔哩	600,000	3,250,944.60	5.24
5	H03888	金山软件	140,000	3,236,325.40	5.22
6	H06186	中国商飞	219,000	2,781,394.17	4.48
7	H00763	中兴通讯	120,000	2,636,938.20	4.25
8	H01211	比亚迪股份	70,000	2,590,339.50	4.18
9	H01093	石药集团	180,000	2,562,512.32	4.11
10	H02013	微盟集团	468,000	2,099,572.96	3.38

 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序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序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序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
 10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 本基金本报告期末未持有国债期货。
 11.投资组合报告附注
 11.1报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。
 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	536,128.43
2	应收证券清算款	2,492,961.08
3	应收股利	-
4	应收利息	5,087.24
5	应收申购款	79,386.69
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,113,563.44

 11.4 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可转换债券。
 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。
 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
 由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计数之间可能存在尾差。
 第十二部分 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。基金业绩数据截止日为2020年3月31日。
 一、本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
 中融沪港深大消费主题A净值表现

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日(2017年11月16日)起至2018年6月30日	-9.72%	1.27%	0.40%	0.56%	-10.12%	0.72%
2018年7月1日至2018年12月31日	-17.76%	1.38%	-4.34%	0.64%	-13.42%	0.74%
2019年1月1日至2019年6月30日	7.18%	1.18%	7.87%	0.51%	-0.69%	0.67%
2019年7月1日至2019年12月31日	8.36%	0.87%	1.50%	0.46%	6.86%	0.42%
2020年1月1日至2020年3月31日	-12.97%	2.49%	-6.47%	0.99%	-6.50%	1.50%

 中融沪港深大消费主题C净值表现

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	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日(2017年11月16日)起至2018年6月30日	-9.92%	1.27%				