

(上接B079版)

办公地址 上海市静安区中山西路318号23楼12层-23层, 23-201室, 23-202室, 400616

(100) 方正证券股份有限公司
住所 湖南省长沙芙蓉中路二段80号华远国际中心22-24层

(101) 长城证券股份有限公司
住所 深圳市福田区深南大道9008号特区报业大厦14、16、17层

(102) 光大证券股份有限公司
住所 上海市静安区威海路158号

(103) 广州证券股份有限公司
住所 广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州国际金融中心19、20楼

(104) 东北证券股份有限公司
住所 长春市净月区净月大街6666号

(105) 华安证券股份有限公司
住所 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

(106) 财富证券有限责任公司
住所 湖南省长沙市芙蓉中路二段80号华远国际中心22-24层

(107) 华西证券股份有限公司
住所 成都市高新区天府一街198号华西证券大厦

(108) 申万宏源西部证券有限公司
住所 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼

(109) 中泰证券股份有限公司
住所 山东省济南市市中区经七路86号

(110) 世纪证券有限责任公司
住所 深圳市福田区福田街道福安社区世纪证券大厦401-402层

(111) 第一创业证券股份有限公司
住所 深圳市福田区福强路111号投行大厦10-20楼

(112) 中航证券有限公司
住所 南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号中航国际大厦411楼

(113) 华信证券有限责任公司
住所 福州市五四路157号新天地大厦7层

(114) 中国国际金融股份有限公司
住所 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

(115) 联讯证券股份有限公司
住所 广东省惠州市惠城区江北东江三路65号广播电视新闻中心西面一层大厦

(116) 英大证券有限责任公司
住所 深圳市福田区滨河街道华能大厦三十一、三十一层

(117) 宏信证券股份有限公司
住所 成都市人民南路二段10号川信大厦10楼

(118) 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楼

(119) 东海证券股份有限公司
住所 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号

(120) 长江证券股份有限公司
住所 湖北省武汉市新华路特号长江证券大厦

(121) 西南证券股份有限公司
住所 重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

(122) 湘财证券股份有限公司
住所 湖南省长沙市天心区湘府中路198号湘财证券中心A座11楼

(123) 万联证券股份有限公司
住所 广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18楼、19楼

(124) 民生证券股份有限公司
住所 北京市东城区建国门内大街2号民生证券大厦16-18层

(125) 国元证券股份有限公司
住所 安徽省合肥市寿县路179号

住所 安徽省合肥市寿县路179号
办公地址 安徽省合肥市寿县路179号

(126) 渤海证券股份有限公司
住所 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼1013室

(127) 山西证券股份有限公司
住所 太原市晋源区晋源西街山西国际经贸中心东塔楼

(128) 东兴证券股份有限公司
住所 北京市西城区金融大街5号新盛大厦12-15层

(129) 东吴证券股份有限公司
住所 苏州工业园区星阳街2号

(130) 信达证券股份有限公司
住所 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

(131) 南京证券股份有限公司
住所 南京市江东中路389号

(132) 上海证券有限责任公司
住所 上海市四川中路213号上海证券大厦7楼

(133) 大同证券有限责任公司
住所 山西省大同市城区迎宾街15号山西世贸中心A座12、13层

(134) 国联证券股份有限公司
住所 无锡市太湖新城金融一街8号

(135) 浙商证券股份有限公司
住所 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座7楼

(136) 平安证券股份有限公司
住所 深圳市福田区中心区金田路4036号平安大厦16-20层

(137) 国海证券股份有限公司
住所 广西桂林市辅政路13号

(138) 东莞证券股份有限公司
住所 东莞市莞城区运河东一路111号运河东1号11楼

(139) 中原证券股份有限公司
住所 郑州市郑东新区商务外环路10号

(140) 国都证券股份有限公司
住所 北京市东城区东直门南大街3号国都证券大厦9层

(141) 东海证券股份有限公司
住所 江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼

(142) 中银国际证券股份有限公司
住所 上海市浦东新区银城中路201号中银大厦39层

(143) 恒泰证券股份有限公司
住所 内蒙古自治区呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东塔楼D座光大银行办公楼14层

(144) 国盛证券有限责任公司
住所 江西省南昌市北京西路88号

(145) 金元证券股份有限公司
住所 海口市南沙路10号金元证券大厦4楼

(146) 德邦证券股份有限公司
住所 上海市浦东新区世纪大道1500号德邦大楼

(147) 西部证券股份有限公司
住所 陕西省西安市东大街222号光大大厦16-17层

(148) 华龙证券股份有限公司
住所 甘肃省兰州市城关区东岗西路308号兰州财富中心2楼

(149) 财通证券股份有限公司
住所 杭州市西湖区天目山路191号财通证券中心

(150) 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1500号环球金融中心9楼

(151) 华鑫证券有限责任公司
住所 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01及B1单元

住所 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01及B1单元

(152) 瑞银证券有限责任公司
住所 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼1013室

(153) 中山证券有限责任公司
住所 广东省深圳市福田区福田街道江苏路15层

(154) 国融证券股份有限公司
住所 呼和浩特市新城区锡林南路18号

(155) 江海证券有限公司
住所 哈尔滨市北京街109号

(156) 国金证券股份有限公司
住所 四川省成都市青羊区东城根上街95号

(157) 中国民族证券有限责任公司
住所 北京市朝阳区北三环北路46号大成大厦9层

(158) 华宝证券有限责任公司
住所 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心47层

(159) 长城国瑞证券有限公司
住所 厦门市莲厝西路2号莲厝大厦十七楼

(160) 爱建证券有限责任公司
住所 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

(161) 华融证券股份有限公司
住所 北京市西城区金融大街8号

(162) 天风证券股份有限公司
住所 湖北省武汉市武昌区东湖路99号保利广场A座27楼

(163) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋101层1016室

(164) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
住所 浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1202室

(165) 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118号11018室

(166) 北京新浪石基基金销售有限公司
住所 北京市海淀区北四环西路96号理想国际大厦B06室

(167) 上海万得基金销售有限公司
住所 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1101号1102室

(168) 凤凰信银(北京)基金销售有限公司
住所 北京市朝阳区金凤路两院商务区万寿路142号1402室

(169) 和耕传承基金销售有限公司
住所 郑州市郑东新区东风东路商汇广场2号楼B2202室

(170) 北京肯特瑞基金销售有限公司
住所 北京市西城区中关村南路9号1号楼2202室

(171) 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9号楼2单元21层22207

(172) 嘉实基金销售有限公司
住所 北京市朝阳区望京东二街10号嘉实大厦3层

(173) 基金业协会
住所 北京市西城区金融大街19号

(174) 会计师事务所和经办注册会计师
住所 中华人民共和国境内

(175) 基金业协会
住所 北京市西城区金融大街19号

(176) 基金业协会
住所 北京市西城区金融大街19号

(177) 基金业协会
住所 北京市西城区金融大街19号

(1) 宏观因素: 宏观面关注基本面的重要经济数据以及货币和财政政策的变化

(2) 市场因素: 市场方面我们关注流动性的变化对市场的影

(3) 估值因素: 估值方面我们不仅关注股票市场的绝对估值因素

在前期股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时

本基金秉持自上而下的投资策略,在股票投资策略中,优先进行行业配置

(1) 行业及主题选择策略
在个股选择上,采用对基本面的深度研究为主

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在股票资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

本基金在债券资产配置方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

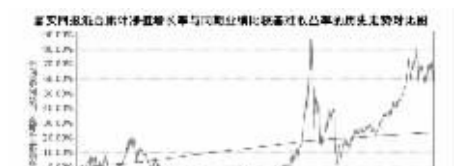


图:嘉实回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:根据本基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期

十二、费用概览
(一)与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;

3. 因基金的证券交易或结算而产生的费用
4. 基金合同生效以来的信息披露费用;

5. 基金合同生效以来的会计师费用和审计费;
6. 按照国家有关基金法律法规规定可以列入的其他费用;

7. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

8. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

9. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

10. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

11. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

12. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

13. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

14. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

15. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

16. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

17. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

18. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

19. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

20. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

21. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

22. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

23. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

24. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

25. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

26. 基金管理人履行基金合同约定的义务所发生的费用等不列入基金费用

11