

(上接B102版)

办公地址：上海市西藏中路336号
法定代表人：龚德雄
电话：021-61539888
传真：021-65217206
联系人：张雄
网址：www.962518.com
客户服务电话：400-891-8918
(71) 新时代证券股份有限公司
住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：叶卫刚
电话：010-83561146
传真：010-83561094
联系人：田芳芳
网址：www.xsdzj.com
客户服务电话：96399
(72) 大同证券有限责任公司
住所：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人：董泽
电话：0351-4130322
传真：0351-41192003
联系人：薛萍
网址：www.dtsbc.com.cn
客户服务电话：400-712-1212
(73) 国联证券股份有限公司
住所：无锡太湖新城金融一街8号国联金融大厦
办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦
法定代表人：姚志勇
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：祁斌
网址：www.glsc.com.cn
客户服务电话：96570
(74) 浙商证券股份有限公司
住所：杭州市江干区五星路201号
办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼
法定代表人：吴建敏
电话：0571-87901053
传真：0571-87901933
联系人：胡柏桦
网址：www.stocke.com.cn
客户服务电话：96345
(75) 平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
电话：021-38631117
传真：021-3830395
联系人：石静璇
网址：www.pingan.com
客户服务电话：95511-8
(76) 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
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：章宏韬
电话：0651-65161666
传真：0651-65161600
联系人：范程
网址：www.haazq.com
客户服务电话：95318
(77) 东莞证券股份有限公司
住所：东莞市莞城区可园南路1号金源中心
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运芳
电话：0769-22117112、0769-22119348
传真：0769-22119423
联系人：李荣、孙旭
网址：www.dgjqz.com.cn
客户服务电话：18-329
(78) 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
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：程广军
电话：0371-69098882
传真：0371-66568890
联系人：程月艳、李勤勤、党静
网址：www.ccnew.com
客户服务电话：95377
(79) 国都证券股份有限公司
住所：北京市东城区东直门南大街5号国华投资大厦9层、10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
电话：010-84183389
传真：010-84183311-3389
联系人：黄静
网址：www.guodu.com
客户服务电话：400-818-8118
(80) 东海证券股份有限公司
住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
电话：021-20333333
传真：021-20498825
联系人：王一彦
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：95631、400-888-8888
(81) 国盛证券有限责任公司
住所：南昌市西湖区红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼
电话：0791-86283372、15170012175
传真：0791-96281305
联系人：古文尧
网址：www.gsazq.com
客户服务电话：400-822-2111
(82) 华西证券股份有限公司
住所：四川省成都市高新区天府二街198号
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人：杨炯洋
电话：010-52722773
传真：028-86150400
联系人：谢国梅
网址：www.hx1688.com
客户服务电话：400-888-8818
(83) 中万宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(830002)
办公地址：新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(830002)
电话：0991-2307105
传真：0991-2301927
联系人：王怀春
网址：www.hysec.com
客户服务电话：400-800-0662
(84) 齐鲁证券股份有限公司
住所：山东省济南市市中区经七路66号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
电话：021-20315290
传真：021-20315125
联系人：许晔华
网址：www.zts.com.cn
客户服务电话：96538
(85) 首创证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区福源路12号中冠时代广场B座25、26层
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
电话：0755-28381754
传真：0755-28383750
联系人：毛诗琦
网址：www.ftistapital.com.cn
客户服务电话：95358
(86) 金元证券股份有限公司
住所：海口市南滨路66号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：陆涛
电话：0755-83025022
传真：0755-83025625
联系人：马贤清
网址：www.jyzq.cn
客户服务电话：96372
(87) 西部证券股份有限公司
住所：陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址：陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼
法定代表人：刘建武
电话：029-87471129
传真：029-87424426
联系人：刘雯
网址：www.westsecu.com
客户服务电话：96882
(88) 华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7、10层
法定代表人：黄金晶
电话：0691-87383623
传真：0691-87383610
联系人：张勇
网址：www.hfzq.com.cn
客户服务电话：95547
(89) 华龙证券股份有限公司
住所：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人：李勇
电话：0931-4890100
联系人：李智田
网址：www.hlzqgs.com
客户服务电话：96388、400-488-8888(全国)
(90) 中国国际金融股份有限公司
住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：金立群
电话：010-65051166
传真：010-65050065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010-65051166
(91) 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1100号环球金融中心
办公地址：上海市黄浦区南京路399号明阳广场2号楼
法定代表人：陈灿辉
电话：021-63894427
传真：021-68776377-8427
联系人：徐琳
网址：www.shhxzq.com
客户服务电话：400-400-8008、95532
(94) 中山证券有限责任公司
住所：深圳市南山区科技一路西华强高新研发大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技一路西华强高新研发大楼7层、8层
法定代表人：杨锦庆
电话：0755-82570506
传真：0755-82560582
联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com
客户服务电话：95329
(95) 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惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：陈刚
电话：0755-83331195
联系人：彭鑫
网址：www.lxsec.com
客户服务电话：95654
(96) 江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
电话：0451-85863719
传真：0451-82287211
联系人：刘爽
网址：www.jhzq.com.cn
客户服务电话：400-666-2288
(97) 国金证券股份有限公司
住所：成都市青羊区东城根上街96号
办公地址：成都市青羊区东城根上街96号
法定代表人：冉云
电话：028-86690057、028-86690058
传真：028-86690126
联系人：刘婧璇、张静
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95310
(98) 华宝证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人：陈林
电话：021-50122128
传真：021-50122398
联系人：徐芳芳
网址：www.huabao.com.cn
客户服务电话：400-820-9888
(99) 长城国瑞证券有限公司
住所：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
办公地址：福建省厦门市莲前西路46号深田国际大厦19-20楼
法定代表人：王勇
电话：0592-2079259
传真：0592-2079620
联系人：邱露露
网址：www.wqsg.com
客户服务电话：400-0099-896
(100) 爱建证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人：钱华
电话：021-32229888
传真：021-62878783
联系人：王薇
网址：www.wajzq.com
客户服务电话：400-196-2502
(101) 华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人寿保险大厦
电话：010-85656048
传真：010-85656088
联系人：孙燕薇
网址：www.hfsec.com.cn
客户服务电话：96308
(102) 天风证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
电话：027-87181882
传真：027-87618863
联系人：董耀
网址：www.tfzq.com
客户服务电话：400-800-5000
(103) 宏信证券有限责任公司
住所：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉坤
电话：028-86199278
传真：028-86199382
联系人：郝俊杰
网址：www.hxzq.cn
客户服务电话：400-836-6366
(104) 太平洋证券股份有限公司
住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：北京市西城区北城根9号华远企业中心D座30A单元
法定代表人：李长伟
电话：010-88321717、18500506235
传真：010-88321763
联系人：唐昌田
网址：www.tpyzq.com
客户服务电话：400-665-0999
(105) 上海华夏理财投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号一幢二楼268室
办公地址：上海市西城区金融大街33号通泰大厦B8层
法定代表人：李一梅
电话：010-88066332
传真：010-88066214
联系人：仲伙明
网址：www.amcfuture.com
客户服务电话：400-817-5666
3.场内销售机构
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：毛瑞宁
电话：010-58153000
传真：010-58188298
联系人：徐皓
经办注册会计师：陈伟、王珊珊

四、基金的名称

本基金名称：华夏睿泰混合型证券投资基金（LOF）（原华夏睿泰定期开放混合型证券投资基金（LOF））

五、基金的类型

本基金类型：契约型、定期开放式基金（转型后）；契约型开放式基金（转型后）。

六、基金的投资目标

把握市场发展趋势，在控制风险的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于普通上市型开放式基金（LOF）后，本基金的投资范围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公司）、债券（包括国内依法发行并在二级市场交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可分离债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、期货市场工具（含期货合约）以及法律法规和中国证监会允许基金投资的金融工具。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为70%-90%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，保持不低于基金资产净值6%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

(一) 资产配置策略
本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理配置基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。

(二) 股票投资策略
本基金可通过直接参与和增项目以获得稳健收益，还可通过在定增项目周期内适时参与与定增事件相关股票投资提供收益，并辅以基本面选股和股票投资策略。

本基金基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，通过对非公开发行股票上市的公司进行基本面的分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度参与参与定向增发的预期中签情况，预期损益和风险评估，积极参与风险相对较低的一年期定向增发项目。在定向增发股票预期收益结束后，本基金将根据对股票在投资价值和对成长性判断，结合股票市场环境分析，选择适当的时机卖出。

2、与定向增发事件相关的股票投资策略
本基金积极利用量化分析模式，深入、细致分析受益于事件驱动标的的股票，在充分评估风险和收益特征的情况下，审慎选择事件性投资机会，包括但不限于增发预案发布、股东大会通过定向增发决议、证监会核准发行等，力求获得稳健超额收益。

3、基本面选股策略
本基金将采用定性定量相结合的方式，精选优质个股进行重点投资。定性分析主要从公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面进行分析。定量分析主要从公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行分析。

(三) 债券投资策略
在对未来利率走势预期、运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

(四) 中小企业私募债券投资策略
在严格控制风险的前提下，通过严谨的研究，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，并与其信用评级和发行主体、选择具有相对优势的优质私募债券品种进行投资。同时，通过期限和品种的分散投资降低基金中小企业私募债券的投资风险、利率风险和流动性风险。

(五) 权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用成本模型定价分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

(六) 股指期货和股票期权投资策略
本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货、股票期权投资。通过对现货市场和期货、股票期权市场运行趋势的研究，结合基金投资组合的实际情况及对股指期货、股票期权的估值水平、基本水平、流动性等因素进行分析，选择合理的期货、股票期权合约规模进行投资，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。本基金还将利用股指期货、股票期权作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的组合交易效率。

本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

七、股指期货投资策略
本基金将根据股指期货的原则，充分考虑股指期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与股指期货投资。

未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

九、基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率*30%+上证综指收益率*70%。

如中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证综指指数的编制及发布、或沪深300指数或上证综指指数由其他指数替代、或由指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证综指指数不再继续作为基准指数，或市场有其他更具代表性、更切合投资目标的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人利益的原则，取得基金托管人同意后，变更本基金的基准指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金2018年第3季度报告：

5.1.1 华夏睿泰混合型证券投资基金（LOF）

（报告期末为2018年9月30日，报告期间为2018年7月17日至2018年9月30日）

5.1.1.1 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组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.2.1 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	-	-
B	采矿业	1,022,119.43	2.94
C	制造业	5,310,923.33	13.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	448,056.02	1.12
E	建筑业	296,224.91	0.74
F	批发和零售业	303,049.84	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	262,364.80	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,318,056.79	3.30
J	金融业	483,676.59	1.21
K	房地产业	222,626.66	0.81
L	租赁和商务服务业	620,620.77	1.56
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		10,487,960.39	26.26

5.1.3 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	000068	岳阳纸业	50,148	698,060.16	1.76
2	002057	洽洽食品	32,897	587,102.22	1.42
3	601318	中国平安	7,061	483,676.59	1.21
4	601727	上海电气	88,899	468,497.73	1.17
5	000009	长江电力	27,384	448,056.02	1.12
6	600519	贵州茅台	588	438,540.89	1.08
7	600104	上汽集团	12,524	416,798.72	1.04
8	002024	苏宁电器	20,158	393,040.84	0.98
9	002027	分众传媒	46,469	386,056.00	0.97
10	600388	海南发展	36,828	378,960.12	0.95

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	4,100,300.00	10.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,488,600.00	46.30
4	其他：政策性金融债	18,488,600.00	46.30
4	企业债券	60,320.00	0.13
5	全部可转换债券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)	1,546,167.00	3.87
8	短期融资券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,185,967.00	60.36

5.1.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180206	18国债06	100,000	10,469,000.00	26.19
2	010107	21国债07	40,000	4,100,300.00	10.27
3	090002	国开0901	40,000	4,026,000.00	10.02
4	010007	国开0901	40,000	4,052,000.00	10.02
5	120014	18中债01B	14,910	1,546,167.00	3.87

5.1.6 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142568	PR康盛A3	40,000	724,400.00	1.81
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.1.9.2 本基金股指期货投资的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.1.9.3 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.9.3.1 本期国债期货投资的投资政策

5.1.9.3.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.1.9.3.3 报告期末本基金投资的国债期货投资的投资政策

5.1.11 报告期间内，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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.12 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票范围。

5.1.13 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,233.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	443,262.30
5	应收申购款	990.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	469,574.62

5.1.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在误差。

5.2 华夏睿泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）

（报告期末为2018年7月16日，报告期间为2018年7月1日至2018年7月16日）

5.2.1 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	18,990,650.07	25.38
其中：股票		18,990,650.07	25.38
2	固定收益投资	41,571,500.00	56.87
其中：债券		40,471,500.00	54.06
3	贵金属投资	1,100,400.00	1.47
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和拆借资金合计	11,475,520.63	15.34
7	其他资产	2,780,571.56	3.72
8	合计	74,816,671.36	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	311,893.06	0.56
B	采矿业	1,795,800.00	3.15
C	制造业	9,431,626.94	18.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	506,126.04	1.07
E	建筑业	464,120.59	0.83
F	批发和零售业	581,108.18	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	486,630.00	0.73
H	住宿和餐饮业	1,890,190.00	3.32
I	信息技术、软件和信息技术服务业	3,899,065.14	7.16
J	金融业	547,613.25	0.98
K	房地产业	1,234,567.22	2.22
L	租赁和商务服务业	639,065.14	1.16
M	科学研究和技术服务业	-	-