（上接B009版）

法定代表人：–
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
（101）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：021–50498825
联系人：王一彦
网址：www.longone.com.cn
客户服务电话：95531、400–888–8588
（102）中银国际证券股份有限公司
住所：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：宁敏
电话：021–20328000
传真：021–50372474
联系人：王炜哲
网址：www.bocichina.com.cn
客户服务电话：400–620–8888
（103）国盛证券有限责任公司
住所：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
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
法定代表人：徐丽峰
电话：0791–86283372、15170012175
传真：0791–86281305
联系人：占文驰
网址：www.gszq.com
客户服务电话：400–822–2111
（104）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：010–52723273
传真：028–86150040
联系人：谢国梅
网址：www.hx168.com.cn
客户服务电话：400–888–8818
（105）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2005室
办公地址：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2005室（830002）
法定代表人：韩志谦
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：400–800–0562
（106）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
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：许曼华
网址：www.ztsi.com.cn
客户服务电话：95538
（107）世纪证券有限责任公司
住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40–42楼
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40–42楼
法定代表人：姜昧军
客户服务电话：400–832–3000
传真：0755–83199511
联系人：王雯
网址：www.csco.com.cn
（108）第一创业证券股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场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：0755–25831754
传真：0755–23838750
联系人：毛诗莉
网址：www.firstcapital.com.cn
客户服务电话：95358
（109）金元证券股份有限公司
住所：海口市南宝路36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：95372
（110）中航证券有限公司
住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人：王宜四
电话：0791–86768681
传真：0791–86770178
联系人：戴蕾
网址：www.avicsec.com
客户服务电话：95335
（111）西部证券股份有限公司
住所：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16–17楼
办公地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16–17楼
法定代表人：刘建武
电话：029–87417129
传真：029–87424426
联系人：刘莹
网址：www.westsecu.com
客户服务电话：95582
（112）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至10层
法定代表人：黄金琳
电话：0591–87383623
传真：0591–87383610
联系人：张腾
网址：www.hfzq.com.cn
客户服务电话：95547
（113）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：李晓安
电话：0931–4890100
联系人：李昕田
网址：www.hlzqgs.com
客户服务电话：95368、400–468–8888（全国）
（114）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：010–65058065
联系人：罗春蓉、武明明
网址：www.cicc.com.cn
客户服务电话：010–65051166
（115）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
办公地址：上海市黄埔区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人：陈灿辉
电话：021–63898427
传真：021–68776977–8427
联系人：徐鹏
网址：www.shhxzq.com
客户服务电话：400–820–5999
（116）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（b）单元
办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人：俞洋
电话：021–54967552
传真：021–54967032
联系人：杨莉娟
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：95323、400–109–9918
（117）中国中投证券有限责任公司
住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层–21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：高涛
电话：0755–88320851
传真：0755–82026942
联系人：胡芷境
网址：www.china–invs.cn
客户服务电话：400–600–8008、95532
（118）中山证券有限责任公司
住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人：黄扬录
电话：0755–82570586
传真：0755–82960582
联系人：罗艺琳
网址：www.zszq.com
客户服务电话：95329
（119）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：徐刚
电话：0755–83331195
联系人：彭莲
网址：www.lxsec.com
客户服务电话：95564
（120）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
（121）国金证券股份有限公司
住所：成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：028–86690057、028–86690058
传真：028–86690126
联系人：刘婧漪、贾鹏
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95310
（122）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.ajzq.com
客户服务电话：400–196–2502
（123）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号中国人保寿险大厦
法定代表人：祝献忠
电话：010–85556048
传真：010–85556088
联系人：孙燕波
网址：www.hrsec.com.cn
客户服务电话：95390
（124）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：027–87618882
传真：027–87618863
联系人：翟璟
网址：www.tfzq.com
客户服务电话：400–800–5000
（125）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：吴玉明
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
（126）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：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元
法定代表人：李长伟
电话：010–88321717、18500505235
传真：010–88321763
联系人：唐昌田
网址：www.tpyzq.com
客户服务电话：400–665–0999
（127）开源证券股份有限公司
住所：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
电话：029–88447611
传真：029–88447611
联系人：曹欣
网址：www.kysec.cn
客户服务电话：95325、400–860–8866
（128）华瑞保险销售有限公司
住所：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址：上海市浦东新区银城中路501号上海中心大厦32层
法定代表人：路昊
电话：021–61058785
传真：021–61098515
联系人：薛勇强
网址：www.huaruisales.com
客户服务电话：400–111–5818
（129）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号一幢二楼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：李一梅
电话：010–80066632
传真：010–88066214
联系人：仲秋玥
网址：www.amcfortune.com
客户服务电话：400–817–5666

3、基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

（二）登记机构

名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区
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：杨明辉
客户服务电话：400–818–6666
传真：010–63136700
联系人：朱威
（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人：朱小辉
联系电话：010–57763888
传真：010–57763777
联系人：李晗
经办律师：吴冠雄、李晗
（四）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
执行事务合伙人：毛鞍宁
联系电话：010–58153000
传真：010–85188298
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、王珊珊

## 四、基金的名称

本基金名称：华夏新起点灵活配置混合型证券投资基金。

## 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式基金。

## 六、基金的投资目标

在控制风险的前提下，把握市场机会，追求资产的稳健增值。

## 七、基金的投资方向

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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府支持机构债券、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、资产支持证券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、期权等）、货币市场工具（含回业存单）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。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%–95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%–3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

## 八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用“自上而下”的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。

（二）股票投资策略

本基金将主要采取自下而上的个股精选策略，投资于具备稳定内生增长、能给股东创造经济价值的股票。基金主要通过定性分析和定量分析相结合的方式来考察和筛选具有比较优势的个股。定性分析包括公司在行业中的地位、竞争优势、经营理念及战略、公司治理等。定量分析包括盈利能力分析、财务能力分析、估值分析等。

（三）固定收益品种投资策略

本基金将在分析和判断国际、国内宏观经济形势、资金供求曲线、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的配置结构，精选债券，获取收益。

1、类属配置策略

类属配置是指对各市场及各种类的固定收益类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。具体包括市场配置和品种选择两个层面。

在市场配置层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场等市场债券类金融工具的到期收益率变化、流动性变化和市场规模等情况，相机调整不同市场中债券类金融工具所占的投资比例。

在品种选择层面，本基金将在控制信用风险的前提下，基于各品种债券类金融工具收益率水平的变化特征、宏观经济预期分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。

2、久期调整策略

债券投资利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期，达到增加收益或减少损失的目的。

当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

3、收益率曲线配置策略

本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素，确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。

4、可转换公司债券投资策略

本基金将着重对可转债对应的基础股票的分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择，并在对应可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。

5、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，并与其他投资品种进行对比后，选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时，通过期限和品种的分散投资降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。

6、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、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基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。

（四）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，在采用数量化模型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。

（五）股指期货和期权投资策略

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、期权投资。通过对现货市场和期货、期权市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货、期权的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货、期权合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货、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，提高基金的建仓或变现效率。

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

（六）国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

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、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%＋上证国债指数收益率×50%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布、或沪深300指数或上证国债指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数、或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

## 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 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 | 106,767,934.73 | 82.83 |
| | 其中：股票 | 106,767,934.73 | 82.83 |
| 2 | 固定收益投资 | 13,929,849.60 | 10.81 |
| | 其中：债券 | 13,132,729.60 | 10.19 |
| | 资产支持证券 | 797,120.00 | 0.62 |
| 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 | 2,905,984.13 | 2.25 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,293,780.74 | 4.11 |
| 8 | 合计 | 128,897,549.20 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 2,506,382.00 | 1.96 |
| B | 采矿业 | 3,374,376.94 | 2.64 |
| C | 制造业 | 53,657,587.17 | 42.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 634,106.00 | 0.50 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | 3,235,692.46 | 2.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | – | – |
| H | 住宿和餐饮业 | 711,672.50 | 0.56 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,210,878.90 | 6.43 |
| J | 金融业 | 25,022,566.76 | 19.59 |
| K | 房地产业 | 8,560,713.00 | 6.70 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | 525,525.00 | 0.41 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 328,475.00 | 0.26 |
| 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 | 106,767,934.73 | 83.58 |

5.3 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 | 600036 | 招商银行 | 130,136 | 3,993,873.84 | 3.13 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 50,900 | 3,486,650.00 | 2.73 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 4,751 | 3,468,230.00 | 2.72 |
| 4 | 000963 | 华东医药 | 77,077 | 3,235,692.46 | 2.53 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 267,000 | 2,950,350.00 | 2.31 |
| 6 | 600498 | 烽火通信 | 96,800 | 2,888,512.00 | 2.26 |
| 7 | 601288 | 工商银行 | 485,996 | 2,804,196.92 | 2.20 |
| 8 | 002273 | 千方科技 | 242,900 | 2,732,625.00 | 2.14 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 220,800 | 2,687,136.00 | 2.10 |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 704,600 | 2,621,112.00 | 2.05 |

5.4 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 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 8,591,568.00 | 6.72 |
| | 其中：政策性金融债 | 8,591,568.00 | 6.72 |
| 4 | 企业债券 | 4,536,560.00 | 3.55 |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,611.60 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 13,132,729.60 | 10.28 |

5.5 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 | 018002 | 国开1302 | 85,200 | 8,591,568.00 | 6.72 |
| 2 | 122437 | 15远洋01 | 40,000 | 4,023,600.00 | 3.15 |
| 3 | 122940 | 09城投投 | 5,000 | 512,950.00 | 0.40 |
| 4 | 123006 | 东时转债 | 40 | 4,611.60 | 0.00 |
| 5 | – | – | – | – | – |

5.6 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 | 142297 | PR一A2 | 32,000.00 | 797,120.00 | 0.62 |
| 2 | – | – | – | – | – |
| 3 | – | – | – | – | – |
| 4 | – | – | – | – | – |
| 5 | – | – | – | – | – |
| 6 | – | – | – | – | – |
| 7 | – | – | – | – | – |
| 8 | – | – | – | – | – |
| 9 | – | – | – | – | – |
| 10 | – | – | – | – | – |

5.7 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。

5.8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。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 151,754.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,740,970.04 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 399,214.79 |
| 5 | 应收申购款 | 7,840.96 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 5,293,780.74 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 123006 | 东时转债 | 4,611.60 | 0.00 |

5.11.5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。

5.11.6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尾差。”

## 十二、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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2016年6月30日至2016年12月31日 | –1.10% | 0.12% | 3.27% | 0.38% | –4.37% | –0.26% |
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | 12.74% | 0.27% | 10.86% | 0.32% | 1.88% | 0.05% |
| 2018年1月1日至2018年9月30日 | –12.11% | 1.20% | –5.57% | 0.61% | –6.54% | 0.59% |

## 十三、费用概览

（一）基金运作费用

1、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）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。

（5）基金份额持有人大会费用。

（6）基金的证券、期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、相关账户费用及其他类似性质的费用等）。

（7）基金的银行汇划费用。

（8）其他。

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。

2、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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷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×0.25%÷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。

上述“1、基金费用的种类”中第（3）–（7）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。

（二）基金销售费用

1、申购费与赎回费

（1）本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者在申购本基金时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

| 申购金额（含申购费） | 前端申购费率 |
|---|---|
| 50万元以下 | 1.5% |
| 50万元以上（含50万元）–200万元以下 | 1.2% |
| 200万元以上（含200万元）–500万元以下 | 0.8% |
| 500万元以上（含500万元） | 每笔1,000.00元 |

（2）本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。费率随基金份额的持有期限的增加而递减，具体如下：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| 7天以内 | 1.5% |
| 7天以上（含7天）–30天以内 | 0.75% |
| 30天以上（含30天）–365天以内 | 0.5% |
| 365天以上（含365天） | 0 |

对于赎回时份额持有不满30天的，收取的赎回费全额计入基金财产；对于赎回时份额持有满30天不满90天收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对于赎回时份额持有满90天不满180天收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对赎回时份额持有期长于180天（含180天）收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

（3）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（4）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率。

（5）当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

2、申购份额与赎回金额的计算方式

（1）申购份额的计算

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额＝申购金额/（1＋前端申购费率）

前端申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

前端申购费用＝固定金额

净申购金额＝申购金额－前端申购费用

申购份额＝净申购金额/T日基金份额净值

基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例一：假定T日的基金份额净值为1.230元，四笔申购金额分别为1,000.00元、50万元、200万元和500万元，则各笔申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

| | 申购1 | 申购2 | 申购3 |
|---|---|---|---|
| 申购金额（元，a） | 1,000.00 | 500,000.00 | 2,000,000.00 |
| 适用前端申购费率（b） | 1.5% | 1.2% | 0.8% |
| 净申购金额（c＝a/（1＋b）） | 985.22 | 494,071.15 | 1,984,126.98 |
| 前端申购费（d＝a–c） | 14.78 | 5,928.85 | 15,873.02 |
| 该类基金份额净值（e） | 1.230 | 1.230 | 1.230 |
| 申购份额（f＝c/e） | 800.99 | 401,683.86 | 1,613,111.37 |

若该投资者申购金额为500万元，则申购负担的前端申购费用和获得的基金份额计算如下：

| | 申购4 |
|---|---|
| 申购金额（元，a） | 5,000,000.00 |
| 前端申购费（b） | 1,000.00 |
| 净申购金额（c＝a–b） | 4,999,000.00 |
| 该类基金份额净值（d） | 1.230 |
| 申购份额（e＝c/d） | 4,064,227.64 |

（2）赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回金额–赎回费用

例二：假定某投资者在T日赎回10,000.00份，持有期限半年，该日基金份额净值为1.250元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额＝10,000.00×1.250＝12,500.00元

赎回费用＝12,500.00×0.5%＝62.50元

净赎回金额＝12,500.00–62.50＝12,437.50元

（3）T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T＋1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

3、基金的转换费用

（1）基金转换费：无。

（2）转出基金费用：按转出基金赎回时应收的赎回费收取。如该部分基金采用后端收费模式购买，除收取赎回费外，还需收取赎回时应收的后端申购费。转换金额指扣除赎回费与后端申购费（若有）后的余额。

（3）转入基金费用：转入基金申购费用根据适用的转换情形收取，详细如下：

①从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率＝转入基金的前端申购费率最高档－转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例一。

②从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率，转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高，则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用；反之，收取的申购费用为0。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例二。

③从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例三。

④从前端（比例费率）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例四。

⑤从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用，转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率＝转入基金的前端申购费率最高档－转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例五。

⑥从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用＝转入基金申购费用－转出基金申购费用，最低为0。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例六。

⑦从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：前端收费基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例七。

⑧从前端（固定费用）收费基金转出，转入其他不收取申购费用的基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额，且转出基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例八。

⑨从后端收费基金转出，转入其他前端（比例费率）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：收取的申购费率＝转入基金的前端申购费率最高档－转出基金的前端申购费率最高档，最低为0。

业务举例：详见“（5）业务举例”中例九。

⑩从后端收费基金转出，转入其他前端（固定费用）收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一后端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购