易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 2018年年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司基金托管人:中国建设保行股份有限公司送出日期:二〇一九年三月二十八日基金管理人的董事会、董事保证本报告所裁资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏、扩对基内容的真实性、准确性和完整性实担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容、保证复核内落不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管从承诺以该实信用、勤勉是贯的原则管理从承诺以该实信用、勤也要贯的原则管理从承诺以该交信用、勤也要贯的原则管理从承诺以该交信用、勤也要贯的原则管理从承诺以该交信用、勤也要贯的原则管理从承诺以该交信用、勤也要贯的原则管理、 亚一定組制。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应 仔细阅读本基金的招募说明书及且更新

阅读本基金的招募说明书及其更新。 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本 出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。 本报告期自2018年7月5日起至12月31日止。

基金简称		易方达3年封闭战略配售混合(LOF)	
场内简称		易基配售	
基金主代码		161133	
交易代码		161133	
基金运作方式		契约型开放式	
基金合同生效日		2018年7月5日	
基金管理人		易方达基金管理有限公司	
基金托管人		中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额		24,437,410,355.79	
基金合同存续期		不定期	
2.2 基金产品说	宇明		
投资目标	在严格控制风 的长期稳健增	险的前提下,迫求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产值。	
投资策略	本面、治理状态 走势等判断,有 投资方面主要 宏观经济、市场 优化配置和调 趋势。修而政务	基基合于封闭上的期中主要用助物配货和国际企业的种种效效。基金会民分析的概念,把国际设施的。 为国、治性的人、任意中、证分别性、组织和证实等的。 本国、治性的人、任意中、证分别性、组织和证实等方面组织。指令的一场未来 经分别性。但不可以是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	
业绩比较基准	沪深300指数收	女益率×60%+中债总指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为混合 债券型基金和	型证券投资基金,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高引货币市场基金。	

4 信息披露方式

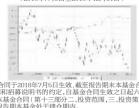
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2018年7月5日 (基金合同生效日)至2018年 12月31日
本期已实现收益	449,024,894.67
本期利润	631,475,214.22
加权平均基金份额本期利润	0.0258
本期基金份额净值增长率	2.58%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
明末可供分配基金份额利润	0.0184
明末基金资产净值	25,068,885,570.01
劉末基金份額净值	1.0258

PN収益水平更低于所列数字。 2本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动 收益, 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 3.本基金合同于2018年7月5日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存绿

份额净值增 长率小准差 业绩比较基 准收益率标 准整④ 2 - 4 。 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基 变动的比较

易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2018年7月5日至2018年12月31日)



注:1.本基金合同于2018年7月5日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。 注按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起次个月內使基金的投 资组合比例符合本基金合同(第十三部分一、投资范围,三、投资策略和四、投资限制) 的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。 3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为258%,同期业绩比较基准 收益率为-5.13%。 3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率

× 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注、本基金合同生效日为2010年7月20日, 33 过去三年基金的利润分配情况 本基金目基金合同生效日(2018年7月5日)至本报告期末未发生利润分配。 《4 管理人报告 41 基金管理人及其管理金的经验 41.1 基金管理人及其管理金的经验 41.1 基金管理人及其管理金的经验

4.1.1 基金管理从及银管组基金的经验 经中国证据会证监基金字2001 科号文批准,易方达基金管理有限公司(简称"易 多少五子2001年2月17日,总额设在广州,在北京,上海,香港,深圳等地设有分公 子公司,并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国产股各限公司两家子 ,易方达始终坚持在城信规范的前提下,通过市场化,专业化的运作,为境内外投 ,相相专业的市产管理组织方案。成为国内域研究的经合性布产管理机构。易方法用 贷者提供专业的资产管理解决方案,成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达用有公募、社保、年金、特定客户资产管理。ODI、OFII、ROFII、ODIS、OFIP、基本养老保险基金投资率必务资格、是国内基金行业分数不多的"金牌照"公司之一,在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资。多资产投资等领域全而作局。 截至2018年12月31日,易方达色资产管理规模超过1.2万亿元,服务近8000万客户,自成立以来仅公募基金累计分红达1150亿元。

姓名	职务		任本基金的基 金经理(助 理)期限 证券 从业		说明
20		任职 日期	离任 日期	年展	
纪玲云	本基金的基金经理、易方达信用债债 券型证券投资基金的基金经理、易方 达稳健收益债券型证券投资基金的 基金经理助理、固定收益研究部总经 理助理	2018 -07- 05	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有 公司固定收益研究员、投资经理助理: 固定收益研究员。
肖林	本基金的基金经理	2018 -07- 05	-	10年	本科学士,曾任易方达基金管理有限 司集中交易室交易员、宏作支持专与 研究部研究员、易方达瑞惠灵活配置 合型发起式证券投资基金基金经理。
胡剑	本基金的基金的图。因为这种图明报 证明并成立指令的发现式上并经过 基金的基金的原。因为这时即他称并 这种的一种,但是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是是	2018 -07- 05	_	12年	師士研究他,曾任馬方达基金管實材 公司開政或益部部外研究机,各金校 助理機能等研究机,则定或益能的定能 这些情酷活力能力能力就及起下达制 可基金(LOP)基金管理,属为这类相 的是,是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是一个是
付浩	本基金的基金经理、易方达料汇灵活 乾實指心型证券投资基金的基金经 理,权益投资管理部总经理	2018 -07- 05	_	21年	無上冊文生,總任广大集團條任民政 (於一周本學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學學

期。
2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对接信期内本基金运作遭规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招额设明书等有关基金法律文件的规定、以取信于干场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份转有人该定是大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

合之间存在不公平交易现象。 4.33 异常交易行为的专项说明 本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。 本报告期内,本公司献下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向 交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的%的交易并有131次,其中127 次为旗下指数及量化组合负投资策略需要职取他组合发生反向交易。4次为不同基金 经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审

44.1报告期内基金投资策略和运作分析 2018年经济基本面数据上半年相对平稳。二季度开始出现较为明显的走弱,结构 上存在一定的差异。基建投资、零售明显下行,对经济增长构成推累。房地产销售和投 资在上半年超出预期,对经济基本临场成支撑,但是下半年开始房地产销售和现设大 幅度下清、投资虽然保旧平级,但市场对未来仍预用普遍下海。进出口方面,安中美贸

批程序。 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

易磨擦不断升级影响,市场对出口的悲观烦阴在二季度逐渐升温,数据上的负面影响 也在四季度逐渐显现。受资管新规影响,社融数据持续大幅回落,虽然7月底开始政策 重心逐步转向"宽信用",但实际融资需求受限于融资平台和房地产行业偏紧的融资 政策,"宽信用",效果只显著。平年社融级规程有所企程,但整位回升克较级,制建 业业资度均分经济结构中仅剩的亮点,自二季度开始企稳向上,上行趋势较为明确,在一 空野途,上强创性公侧水准机学公司化验验

定程度上受到供给侧改革相关行业投资增加的影响。 债券市场全年震荡下行,曲线在前三季度出现明显的陡峭化,四季度"宽信用"政策及果不理想,能线出现平理化。全年10年金融债下行118BP,1年金融债下行193BP,信用债方面,高等级利差在40-60BP之间窄幅震荡,整体差别不大。非标压缩带动中低 百中IID.7III.。高等较对连任4U-60BY之间补辐膜汤,整体走别千次。非标压缩带动中低等较企业资金链紧张。信用违约暴露增加,中低等级品种、城投品种信用利差在5-7月分出现大幅上升。后缘随着"宽信用"政策逐步增加力度,市场对城投、国企的信用风含编好逐步恢复,级别利差收容,但是民营企业的资金链状况依然较为紧张,利差维持定合作

在高位。 权益市场除1月份延续小幅上涨以外,全年持续震荡下跌,沪深300指数,上证50指数,创业板指数分别下跌25.3%。198%和28.7%。 本基金成立于7月5日、操作上、债券方面推转了中短端,高流动性资产为主的配置 思路,在给组合提供流动性的同时获取安全的票息收益。权益方面,组合积极参与个股的战膨配售,获取了较好的投资收益。 4.4.3被告别内基金的投资收益。 4.4.3被告别内基金的处验或表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0258元,本报告期份额净值增长室为2.58%,

积极根据市场情况选择参与配售的投资标的。在控制下行风险的同时为投资人获取超额收益。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等率项的说明
本基金管理人按照企业会计准则,中国证据会相关规定,中国证券投资基金业协会相关把可根基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金会相关把可根基金会同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人设有估值委员会,次司首陈运营官担任估值委员会主席,主动权益极块,固定收益极块,指数强化板块,投资风险管理部、监察与合规管理总部和核算部指定人风租任委员。估值委员会成员是将即定和团制管计基金信值或规和程序,指导工人风程任委员。估值委员会成员具有多年的证券,基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资,研究、风险管理、法律合规或基金估值证件等方面的专业进任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

道的执行。 本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。 本核官別的,参考证值的体验的之间中存在江河值入利益的失。 本基金管理人已与中传金融估值中心有限公司发生理价值可能力能的估值数据,由中证指数有限公司签署服务协议,由中债金融估值中心有限公司按约定提供每万间可业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品中的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本基金本报告期内未实施利润分配。 6. 托管人报告 5.1 报告期内本基金托管、遗规守信情况用明 本报告期,中國建设银行股分有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券 炎基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益 方均、完全星现是贵地履行了基金托官人应是的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作建规守信、净值计算、利润分配等情况的说

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对

7.1 资产负债表 会计丰体: 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

Mar she	単位:人民 本期末
资产	2018年12月31日
资产:	
银行存飲	7,926,871.25
结算备付金	158,518,772.77
存出保证金	305,815.64
交易性金融资产	27,946,528,036.00
其中:股票投资	380,797,536.00
基金投资	-
质券投资	27,565,730,500.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买人返售金融资产	-
应收证券清算飲	-
应收利息	451,159,96251
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	_
资产总计	28,564,439,458.17
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日
负 债:	
短期借飲	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	3,487,052,839.41
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	2,129,314.29
应付托管费	638,794.30
应付销售服务费	-
立付交易费用	176,411.46
应交税费	1,107,372.25
应付利息	4,308,156.45
应付利润	-
递延所得税负债	_
其他负债	141,000.00
负债合计	3,496,563,888.16
所有者权益:	
实收基金	24,437,410,355.79
未分配利润	631,475,214.22
所有者权益合计	25,068,885,570.01
负债和所有者权益总计	28,564,439,458.17

注:1. 本基金合同生效日为2018年7月5日,2018年度实际报告期间为2018年7月5日至2018年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表 及报表附注均无同期对比数据。 2.报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0258元,基金份额总额24,437,

項目	本期 2018年7月5日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	709,813.455.29
1利息收入	509,444,447,80
其中:存飲利息收人	28,518,917.15
债券利息收入	459,966.037.22
资产支持证券利息收入	
3. 以 3. 以 3. 以 4. 以 5. 以 6. 以 6. 以 6. 以 6. 以 6. 以 6. 以 6. 以 6	20.959,493.43
其他利息收入	
2投资收益(损失以"-"填列)	17,918,687.94
其中:股票投资收益	
基金投资收益	_
债券投资收益	17,918,687.94
资产支持证券投资收益	_
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	182,450,319.55
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	78,338,241.07
1. 管理人报酬	12,128,863.52
2. 托管费	3,638,659.09
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	175,649.05
5. 利息支出	61,506,893.86
其中:卖出回购金融资产支出	61,506,893.86
6. 税金及附加	715,495.62
7. 其他费用	172,679.93
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	631,475,214.22
减:所得税费用	_
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	631,475,214.22

注:本基金合同生效日为2018年7月5日,2018年度实际报告期间为2018年7月5日至31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无间期对比数据

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体,易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 本报告期;2018年7月5日(基金合同生效日)至2018年12月31日 单位:人民币元					
項目	本期 2018年7月5日 (基金合同生效日) 至2018年12月31日				
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计	ı	
一、期初所有者权益(基金 净值)	24,437,410,355.79	-	24,437,410,355.79	Ì	
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数(本期利润)	-	631,475,214.22	631,475,214.22	l	
三、本期基金份額交易产生 的基金净值变动数(净值减 少以"-"号填列)	-	-	_		
其中:1.基金申购款	-	-	-	ı	
2.基金赎回款	-	-	-	ı	
四、本期向基金份额持有人 分配利润产生的基金净值 变动(净值减少以"-"号 填列)	-	-	-		
五、期末所有者权益(基金 净值)	24,437,410,355.79	631,475,214.22	25,068,885,670.01	Ì	
注:本基金合同生效日为2018年7月5日,2018年度实际报告期间为2018年7月5日 18年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及					

74.1 基金基本商品 易方达5年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称 "本基金",根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2018] 926号《关于准予易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照(中华人民共和国证券投资 注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金(LOF)基金长,和(易方达3年封闭运作效路配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集,经向中国证路金备案。(易方达5年封闭运作效路后是灵配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2018年7月5日正式生效。基金合同生效日的基金份额运动为24.437.410、365.796基金份额、其中认购资金利息并合4.420.28440份基金份额、本基金为契约型开放工基金。存获期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理用限公司基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金募集期间为2018年6月11日至2018年6月19日,募集金额总额为人民币24.47.410、365.79元,其中:有效净认购金额为人民币24.432.990、071.39元,有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币4.420、284.40元,经安水华明(2018)验字第6048000、G16号验资报告予以审验。

74.2 会计报表的哪种基础 本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则及相关规定以下合称"企业会计准则"),中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国

证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编

本财务报表以持续经营为基础编制。 7.43 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本财务报表符合企业会计准则的要求,真实,完整地反映了本基金本报告期末的 分况以及本投售期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。 7.4.4 重要会计政策和会计估计

74.4 重要会计议策科会计估计 本基金龄多报表所裁财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计 核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

74.41会计年度 本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止,惟本会计年度期间为2018年7月

5日(基金合同生效日)至2018年12月31日正,他年云11年度期间为2016年7月5日(基金合同生效日)至2018年12月31日。 7.44.2 记账本位币 本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明

不能查记或小证门标题则所称则为我农的采用的效用为为人民间。解目的初始的 , 5以从人民币元为单位表示。 7.4.43 金融资产和金融负债的分类 (1) 金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为;以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资 点收款项,可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对 融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产 转表看必则根据

金融或戶的持行是協相行有能力。 各處並目前習尤並嚴以戶方吳內可以由自立職以 於特有至到期投资。 在 起途目前持有的股票投资,债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权 证投资)分类为以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产。除衍生工具所产 生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值 变动计人损益的金融资产在资产负债表中以反及赔金融资产列示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买人返售金融资产 和各类应收款项等。 应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的 非衍生金融资产。

7年金融资产。 (2) 金融负债的分类 金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融负

金融负债于初始确认时分类为;以公允价值计量目具实对时人与照切础时运感以低及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债的关为以公允价值计量且其变动时人当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括支出回购金融资产款和各类应付款项等。
74.44 金融资产和金融负债的初始确认。后续计量和终止确认金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债决的确认。以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产,取得时发生的相关全交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息、单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易邮时上初降确认金额

除息日至胸实日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计人初始确认金额。 对于以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续 计量,对于应收款项项银他金融资低采用实际利率法,以搜索放本进行后线计量。 金融资产海足下列条件之一的,予以参比确认。(1) 收取该金融资产现金流量的合 同权利终生;(2) 该金融资产已转移。且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和 报酬转移给收入;或者(3) 绘金融资产已转移。虽然本基金联及有转移上处有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和股票(但是股弃了对该金融资产控制。

资产所有权上几乎所有的风险和限删。但是放弃了对该金融资产控制。 金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。 当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解 的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。 7445 金融资产和金融负债的估值原则 本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值。 (1)存在活跃市场目能够获取相同资产或负债报价的金融工具,按其估值日不加 整的报价确定公允价值,估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的 大事件的、采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或度近交 目的报价不能真实反映公分值的,对报价进行调整,概定公允价值。 与上述投资品种相同。但具有不同特征的,以相同资产或负债的公允价值为基础, 存在的还有表表表表表表表表表

為日的稅的不能與美及陳公先的相談,刻報的近行期整。确定公允的相。 与上達投資品种相同。但具有不同特征的、良相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是相对资产出售或使用的限制等,如 果沒限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不够废限制作为特征考虑。基金管 理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或形价。 (2) 不存在活跃市场的金融工具,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据 和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,优先使用 可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情 5亿下,才使用不可观察输入值。这方法进行估值不能客观反映会允价值的,优先使用 5亿十分,但有一个人。 2015年的资产和金融负债的抵销 本基金持有的资产和金融负债的抵销 本基金持有的资产和承租的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有 抵制已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的。且2)交易双方准备按 净额结累时,金融资产业金融负债的技术较利到。

7447 实收基金 实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的 点。由于即购服赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日 』。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基

別。上述申與和赎回分別包括基金转换的与啟的转人縣金的吳収縣金單加和時也無 为2次基金據少 7.4.4.8 期益平准金 的益平准金包括已空现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申與或號回基 份額时,申购或號回數項中包含的按實计未分配的已实现根益占基金净值比例计算 68億、未实现平准金指在申购或號回基金份納时,申购或號回數項中包含的按實计 实现根益占基金净值比例计算的金额。根益平准金于基金申购确认日或基金赎回确

亲实现船站占基金净值比例计算的金额。扔益铲准仓于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于朋末金额转入头分预利润《累计亏损》。
7.44.9 收入/债头的确认和计量
股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税
局的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的投票而利率或者发行价计算
的利息组除在运用增高还 由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴
物的增值税间的净额确认为利息收入。货产支持证券投资本金部外租投资收益部分,将本
金部分市破污产支持证券投资成本,并将投资收益部分的保证制的企工制构资收益部分,将本
金部分市域产支持证券投资成本,并将投资收益部分和股企租间的产品量合管理
从缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。
以公允价值计量且其变到什么当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动
确认为公允价值变动损益,处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为利投资收益。

收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。 应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差

行确认。 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线 其中企业的企业。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线 法差异较小的按直线法近似计算。 7.4.4.11 基金的收益分看吸填 7.4.4.11 基金的收益分看吸填 配,俱体分配方案以公告为强,若《基金合同》生效不调3个月可不进行收益分配。 (2)本基金收益分配方式分两种。现金分红与组利再投资。 登记在登记结算系统基 金份额持有人开放式基金账户下的场外基金份额。可选择现金红利自动 转为基金份额进行再投资,若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。 登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的场内基金份额设备分配方式 为现金分纪。具体权益分配图等有4天率项通需常加速分配为无效。 方现金分定。 若深圳证券交易所改登记经算制构的相 关规定。 若深圳证券交易所或登记经算制构的相 关规定。 若深圳证券交易所或登记结算机构的相 关规定。 若深圳证券交易所或登记结算机构的相

为现金分红。具体权益分配程序等有关事项遗憾或川证券交易所及登记结算机构的相关规定;若深圳证券交易所或登记结算机构对收益分配的相关业务规则有新的规定,这其新规定执行。

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。(4)间一类别的每一基金份额多有同等分配权。(6)在对基金份额持入利益无实资本利率响的前提下,基金管理人可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则和支付方式;(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。74.412 其他重要的会计政效和会计估计据现。74.412 其他重要的会计政效和会计估计据现金。74.412 其他重要的会计政效和会计估计报报本基金的估值为设计政效和会计位。(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。74.412 其他重要的会计政效和会计估计。根据基金的估值规则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作。本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时採用的估值方法及其关键假设如下;(1)对于证券交易所上中的股票,若出现理人本项的课度或关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况还用《关于发布中基协众AMAC)基金行业股票的估值物数的通知》是相处的理论或法,市盈率法等估值较大进行估值。(2)于2017年12月15日前,对于在锁定组份的协会开发行股票,根据中国证监会证金计于2007年16月,是可由,对于在锁定组份的协会对处企计相则的信息外选行价值。

司稅納間与IJT級从近度19日7年20.0032 文元84.5元。 行估值。 (3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种。同时的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间司业市场交易的固定收益品种,根押中国证监会公告/2017113号《中国证监会关于证券投资基金址的业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2016年1季度固定收益品种的信贷处斯标准》采用估值技术确定公允价值、本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种可转换债券除外,按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同址市场固心的公司的取口供金融估值由人有限公司所被立提供的合值结果概定公允价值。 t益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供 74.5金计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 74.5.金计政策变更的说明 本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.45.2会计估计变更的说明 本基金本报告期未发生会计估计变更。 7.45.3差错更正的说明 本基金本报告期无会计差错。

46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》。财税2011670 号(关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知)。财税201140号《关于明确 金融 房地产开发。教育辅助服务等增值税政策的通知》。财税201170号《关于资管产 品增能税政策有关问题的补充通知》。财税20170号号《关于资管产品增值税有关问题 (1) 资管产品运营12时中处生的增值税政策的资格。 (1) 资管产品运营12时中处生的增低股、股行为、以资管产品管理人为增值税效 税人。资管产品营12时中处生的增低股、股行为、以资管产品管理人为增值税纳 税人。资管产品营12时中处生的增低股、股行为、协定等产品管理人为增值税纳 税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值起及形行为,指通用简易计税 方法 按照%的征收率缴收增值税、对资管产品还是1914日;目口前运过程中发生的 增值税及税行为,未缴纳增值税的、不再缴纳;已缴均增低税的,已纳税额从资管产品 管理人以居月份的增值税政的税额中抵缴 货票以足用与份的增值税政的税额中抵缴 ,加速券投资基金管理人运用基金买卖股票,债券的转让收入免证增值税,对国债、 均方政府税及金融回业标准和自收入方物企即增值税。资管产品管理人运营管产品

地方投資基並管理人場出歷並失失股票、限分口对社場人へ无地。但最近的公司等地方政府借收及金融同业性来利息收入亦及证增值款。资管产品管理人运营资管产品,提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人宣资管产品转让2017年12月31日前取得的基金。非爱物朋贷,可以选择收照实际买人价计算销售额。或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期

照实际实人价计算销售额,或者以2017年最后一个交易目的基金份额净值,非货物明 偿结价格为实人价计算销售额。
(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票,债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代据20%的个人所得税,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以及10人内含1个月的,其股息工利所得全部计人应效解所得额,持股期限在1个月以上至1、10人内含1个月的,其股息工利所得全部计人应效解所得额,持股期限至1个月以上至10人位,10人们有限的股惠。 品。对监查持有的上市公司限售股,解除后取得的股息。红利收入,该职上还规定计算 纳税,持股时间目解第日起计算,解读前取得的股息。红利收入继续暂减按60%计入应 纳税,特股时间目解第日起计算,解读前取得的股息。红利收入继续暂减按60%计入应 纳税所得额。上述所得统一通用20%的特殊非让作入所得税。 (4)基金类出股票按0.1%的税率缴纳股票交易日花税。买入股票不证收股票交易 日花税。

///。 (5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴

基金管理人股东、基金销售机构 东省广晟资产经营有限

|馬拉思子經濟相限公司 注:以下支架交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 7.48 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.48.1 超过关联方交易单元进行的交易 7.48.11 股票交易

7.4.6.1.1 成宗文勿 本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。 本基蓝净报口财产企工。 748.12 权证交易 本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。 748.13 应支付关联方的佣金 本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

本期 2018年7月5日 (基金合同生效日)至2018年12月31日 :1.封闭运作期内基金管理费计提方法、计提标准和支付方式)本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。管理费的计算方

E为铜一日的基金资产净值 基金管理教每日计据 按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据。自动在月初5个工作日内,按照标定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出县资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。 2.) 封闭近作期内,本基金每年计提的管理费和托管费合计不超过4000万元,若当年计据的费用合计已达到4000万元,则当年内不用计提管理费和托管费。 2.开放运作局基金管理数计据方法、计提标能和支付方式 本基金的管理数按前一日基金资产净值的150%年费率计提。管理费的计算方法

E7列申一日的基金資产净值 基金管理發每日刊基。按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月55个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需用出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。 748.222 基金托管费

本期 2018年7月5日 (基金合同生效日)至2018年12月31日 圖與茲里姆維密風及可得的世報 注:1封闭运作期内基金托管费计提方法、计提标准和支付方式 1)本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.03%年费率计提。托管费的计算方

单位:人民币元

法如下:

H=E×0.03%-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
基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初6个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出县资金划货指令。若遗法定节假日,休息日等,支付日期顺延。
2)封闭定作期内,本基金每年计提的管理费和任管费合计不超过4000万元,若当年计捷的费用合计已达到4000万元,则当年内不再计提管理费和托管费。
2.环治疗库基本经管数4排每方法,比据后来由无线有方式。

2.开放运作后基金托管费计提方法、计提标准和支付方式 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法

: H=E×025% → 当年天数

H=EX-025%-当年大数 H为每日应计提的基金完产净值 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财 按据,自动在月初6个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无 引出真资金划按指令。若遇法定节假日,休息日等,支付日期顺延。 7-48.3 与支账方进行银行间同业市场的债务信回购交易

7.48.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。 7.48.4 各关联方投资本基金的情况 7.48.41 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金。 7.48.42 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 7.

元。 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本期 2018年7月5日 (基金合同生效日)至2018年12月31日

加利率或约定利率订思。 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末 (2018年12月31日) 本基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元 可流 流通 认购 期末 数量(单) 价格 单价 位:股) 期末 成本总額 期末 估值总额 2019-11-18

7.492 期末持有的暂时停牌等流通受限股票。 7.49.3 期末,持有暂时停牌等流通受限股票。 7.49.3 期末,他养正回购交易中作为抵押的债券 7.49.31 银行间市场债券正回购 報至和指目期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成 2.出回购证券款余额907,052,839.41元,是以如下债券作为质押;

					金额单位:人民	币元
债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量(张)	期末估值总额	
011801191	18广州地铁 SCP006	2019-01-02	100.55	3,000,000	301,650,000.00	
101800733	18保利房产 MTN003	2019-01-02	102.00	1,211,000	123,522,000.00	
180409	18农发09	2019-01-02	102.17	3,061,000	312,742,370.00	
111810369	18兴业银行 CD369	2019-01-03	96.60	1,042,000	100,657,200.00	
180313	18进出13	2019-01-04	101.06	100,000	10,106,000.00	
111817179	18光大银行 CD179	2019-01-07	97.59	1,000,000	97,590,000.00	
合计				9,414,000	946,267,570.00	
フォロココ オモ	1元士/2/4/4	राई जिल्लाहरू	•			

74.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成 的卖出回购证券款余额2.580,000,0000元,于2019年1月2日(先后)到期,该类交 易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转人 质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

74.10 有期于理解和分析会计报表需要规则的其他事项 (1)公允价值 (a)金融工具公允价值性量的方法 公允价值性计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次块定: 第一层次,相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次,路第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。第二层次,路第一层次输入值的环可观察输入值。(b)持续的以公允价值计量的金融工具 (b)持续的以公允价值计量的金融工具 (b)各层公益融工具入允价值 于2018年12月31日,本基金持有约以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 21,512,586.00元,属于第二层次的余额为 27,925,010,5000元,无属于第三层次的余额。(b)公允价值所属层次侧的重大变动对于正券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌,交易不适联,包括张铁停时的交易不适联,即成是有半处于线上线上,从显示非处于探针会、本基金不会于停榨用至交易恢复活账日期间、交易不活联期间及限值期间将相关股票的公允价值列从第一层次,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是统工是次。

采用的不可观察物へ鳴へ。 次还是第三层次。 (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。 (c)非持续的以公允价值计量的金融工具 于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。 (d)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账而 与公允价值相整极小。

8.1 期末基金资产组合情况

序号	項目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	380,797,536.00	1.33
	其中:股票	380,797,536.00	1.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,565,730,500.00	96.50
	其中:债券	27,565,730,500.00	96.50
	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: 汉断式回购的买人返售金 融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	166,445,644.02	0.58
8	其他各项资产	451,465,778.15	1.58
9	合计	28,564,439,458.17	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	5,788,398.00	0.02
В	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	369,544,830.00	1.47
K	房地产业	5,464,308.00	0.02
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	-	
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
P	教育	-	_
Ω	卫生和社会工作	-	_
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	-	_
	合计	380,797,536.00	1.52

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	601319	中国人保	74,850,000	359,280,000.00	1.43
2	601288	农业银行	1,674,800	6,029,280.00	0.02
3	300498	温氏股份	221,100	5,788,398.00	0.02
4	000002	万科A	229,400	5,464,308.00	0.02
5	601318	中国平安	75,500	4,235,550.00	0.02

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细本基金本报告期内未进行股票卖出交易。 8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

"买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交)填列,不考虑相关交易费用。 8.5 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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	_
2	央行票据	-	_
3	金融债券	3,555,574,000.00	14.18
	其中:政策性金融债	3,555,574,000.00	14.18
4	企业债券	3,835,586,500.00	15.30
5	企业短期融资券	2,483,172,000.00	9.91
6	中期票据	4,944,368,000.00	19.72
7	可转债(可交换债)	-	_
8	同业存单	12,747,030,000.00	50.88
9	其他	-	_
10	合计	27,565,730,500.00	109.9€

数量(张)

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 8.8 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贵金属投资明细 8.8 报告期末按公允价值占基金资本基金本报告期末未持有贵金属。 本基金本报告期末未持有贵金属。 8.9 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。 8.10 报告期末本基金投资的配精期贷交易情况说明 本基金本报告期末未投资股档期货。 8.11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投资股捐期货。 8.11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投资国债期货。 8.12 投资组合报告附注 8.12.11治消发银行CD224 (个码,111809224)为易方达3年封闭运作战略配售灵 活配置混合型证券投资基金 (LOP)的前十大持仓证券。根据上海浦东发展银行股份 有限公司董事会2018年1月19日发布的(关于成都分行处罚事项的公告),银监会四川 监管局对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反 申填经营规则的违规行为依法查处,并执行罚款46.17万元人民币。2018年2月12日, 中国根监会针对浦发银行的如下事由罚款5846万元、没收违法所得10.927万元,罚货 6.118855.927万元(一)户按管理严重连权博签营规则(二)通过资管计划的资分 行协议存款。虚增一般存款(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收 适调节;(四)理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求(干),提供不实说明 材料、不配合调查取证;(六)以贷转存。据增存贷款(七)票据承兑、贴现业务贸易营 贯审查不严。(人)国内信用证业务贸易管景审查不严。(九)贷款管理严重缺失。要为 大概不良贷款(十)违规通过同业投资转存款方式、虚增存款(十一)罪据资管业务 在总行审批股回后仍继续办理;(十二)对代理价资金的信托计划提供保本承诺, (十三)以及市团则业务贸易行的投资条件,并少时风险资产;(十四)投资 多款间业理财产品未尽职审查。涉及金额较大;(十五)修改总行理财合同标准文本, 导致理财资金实际投向与合同约定不符、(十六)为非保本理财产品产程文本, 是实现时资金实际投向与合同约定不符、(十六)为非保本理财产品产准文本,明 显质价不符;(十九)收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本。2018年3月19日,上海

银监局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心2016年至2017年配分信用卡 现金分期资金被用于证券交易。2016年至2017年配分信用卡分期资金被用于非消费领 城,严重违反申粮受营规则的违法违事实。责令改正、罚役合计人民币17516517元 2018年7月26日,中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定超行 客户身份识别义务,未按照规定保存多户纷分转和交易记录,未按照规定报长于做 交易相告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的违法进规事实。罚款人民 57307年5年

大河流自省中海火河流已一分。2017年3月1日,2017年3月1日,2017年3月1日,2017年3月1日,17日7日

银行政好有除公司線L分行违法应规的是异态业务,严重垃圾申请经营规则的违法垃圾事实处以人民司2320万元的行政处罚。
18光大银行CD167(代码:111817167)为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置 18光大银行CD167(代码:111817167)为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置 18光大银行CD167(代码:111817167)为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置管理委员会对中国光大银行股份有限公司关以等市建规事实。(一)内控管理严重违误审价。1918年,191

国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的违法行为,罚

REC。 除18浦发银行CD224、18南京银行CD101、18光大银行CD167、18上海银行

CD269、18上海银行CD266、18平安银行CD221外,本基金投资的前十名证券的发行主 体本期没有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 5/4/6。 8.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。 8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金額
1	存出保证金	306,816.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	451,159,962.51
5	应收申函數	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	451,465,778.15
3.12.4 太基令	期末持有的处于转股期的可转换份本报告期末未持有处于转股期的可	

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2 期末基金管理人的从业人员持有本基金

金额单位:人民币元 601319 中国人保 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

海班的则非基金的最后的 注:本基金合同生效日为2018年07月05日。 \$ 11 置大事件揭示 11.1 基金份额持有人大会决议 本报告期内未召开基金份额持有人大会。 11.2 基金管则人基金托管允的专门基金托管部门的重大人事变动 本基金管则人基金托管自20有公告。自2018年6月8日起粤任陈荣女士担任 首简房运营官(副总经理级),聘任狂兰英女士担任公司首席大类资产配置官(副总 18级)。

級 / 。 本报告期内本基会托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。 本报告期内本基金社管人的专门基金社管部门未按生重大人事变动。
113 涉及基金管理人、基金龄产、基金社管业务的诉讼
本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金社管业务的诉讼
事项。
114 基金投资策略的改变
本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。
115 为基金进行审计的会计师事务所情况。
本报告期内本基金向社安设实聘请替华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提
计计服务,本报告年度的审计费用为100,00000元。
116 管理人,社管人及其高级管理人员全餐企成处罚等情况
本报告目报本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到
可整查收例则。

)相宜以处罚。 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

成空金额 佣金

(a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增国元证券股份有限公司、广告

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

招商证券	186,739, 800.00	4.43%	230,000, 000.00	0.13%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	_	-
中信建投	4,028,298, 840.00	95.57%	49,370, 000,000.00	27.10%	-	-
国信证券	-	-	-	-	_	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	_	-
兴业证券	-	-	-	-	_	-
平安证券	-	-	-	-	_	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	53,641, 000,000.00	29.44%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	_	-
广发证券	-	-	78,939, 000,000.00	43.33%	-	-
方正证券	-	-	-	-	_	-
3513613C25	1					

国信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各两个交易单元;新增长城证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各三个交易单元;新增广发证券股份有限公司各三个交易单元;新增广发证券股份有限公司

的需要:
3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于;有较好的研究能力和行业分析能力,能及时,全面地向公司提供高质量的关于宏观,行业及市场走向,个股分析的报告及丰富全面的信息服务,能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力,能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

() 基金安局单元的选择程序如下:
1) 本基金管理人根据上站后准金等后确定选用交易单元的证券经营机构。
2. 基金管理人根据上站后准金等后确定选用交易单元和用协议。