

汇添富睿丰混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
送出日期：2018年3月28日

§1 重要提示
基金管理人、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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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，投资者欲了解详细信息，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年9月29日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	添富睿丰
基金代码	1010139
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月29日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期内基金份额总额	322,816,128.72份
基金存续期限	不定期
基金份额上市的交易场所	上海证券交易所
上市日期	2018年1月12日
上市份额基金的简称称:	汇添富睿丰混合A 汇添富睿丰混合C
上市份额基金的场内简称:	添富睿丰
上市份额基金的场内代码:	501039
报告期内上市份额基金的份额总额	227,597,283.65份 105,218,834.07份

注：本基金下属分级上市日期为：添富睿丰：2018年3月8日，添富睿C：2018年1月12日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类资产，并通过投资股票等权益类资产增强收益，在科学资产配置策略的前提下，力争实现长期稳定的基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将密切关注市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况及金融市场的运行状况，判断不同资产类别在投资组合中的预期风险收益特征，以动态调整大类资产配置比例，在此基础上，灵活运用债券投资策略、股票投资策略、定向增发策略、另类投资策略等，为上市公司提供基金、基金基金采取的投资策略主要为资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中国债指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中等预期风险和预期收益。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息联络负责人	李蔚	王长林
联系电话	021-28932888	100-66504066
电子邮箱	service@fund100.com	ts@bankofchina.com
客户服务热线	400-888-9918	95566
传真	021-28932888	100-66504942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的互联网网址	www.fund100.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道国际大厦21-23楼 汇添富基金管理股份有限公司

§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	2017年9月29日(基金合同生效日)-2017年12月31日		
本期已实现收益	333,170.18	46,366.62	
本期利润	5,489,446.36	2,428,044.89	
加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0231	
本期基金份额净值增长率	2.41%	2.31%	
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		
期末可供分配基金份额利润	0.0411	0.0304	
期末可供分配基金份额净值	223,686,739.20	107,646,297.73	
期末基金份额净值	1.0241	1.0231	

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有买入认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表末中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的《基金合同》生效日为2017年9月29日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2017年12月31日数据，特此说明。

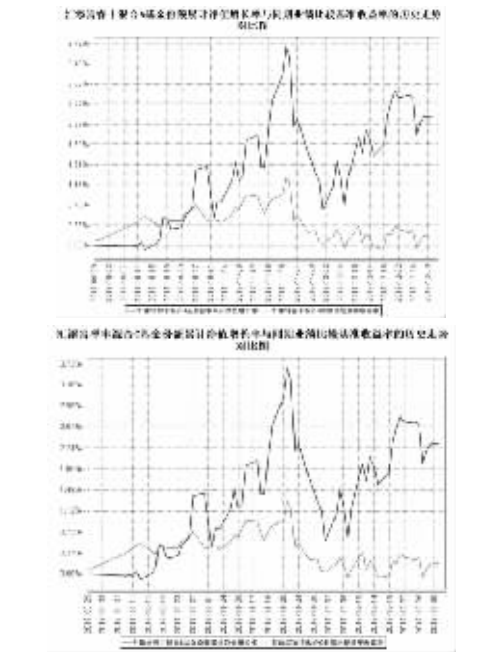
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富睿丰混合A	阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.41%	0.38%	0.09%	0.16%	0.22%	0.23%	0.22%
自基金合同生效日起至至今	2.41%	0.38%	0.19%	0.16%	0.22%	0.23%	0.22%

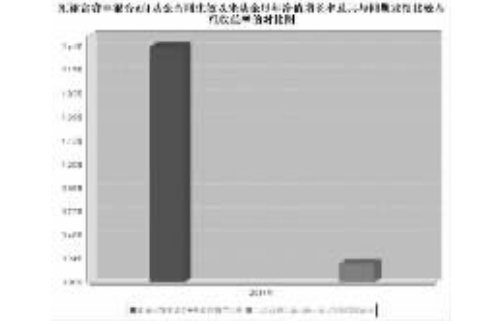
汇添富睿丰混合C	阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.31%	0.38%	0.09%	0.16%	0.22%	0.23%	0.22%
自基金合同生效日起至至今	2.31%	0.38%	0.19%	0.16%	0.22%	0.23%	0.22%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值累计增值率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本《基金合同》生效之日为2017年9月29日，截至本报告期末，基金成立未满一年；本基金建仓期为《基金合同》生效之日（2017年9月29日）起6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

3.2.3 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的比较



注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投

资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，为本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和内部控制方法
根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理计划和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息系统，公司内外部研究成果对所有基金组合和投资执行开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合合理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控报告、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等。（5）在投资组合分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资综合管理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况
本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等部门共同组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风控管控，确保公平交易制度的执行和落实。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异，分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度数据，在不同时间窗口下（日内、3日、6日）同向交易的样本，根据0%置信区间下差价格的T检验显著程度、差价率均值是否小于1%、同向交易占比优比等方式进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送行为。

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易数量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为11次，均是因为投资策略原因，并经公司内部风控审核。经检查和分析，未发现异常情况。

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
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年国内经济整体处于上升态势，表现出较强的韧性，企业盈利、出口、地产销售和旅游等多项经济指标出现好转，尤其是以信息传输、软件和信息技术服务业和租赁和商务服务业为代表的新兴部门GDP增速大幅增长，逐渐形成新的增长点。外部环境方面，2017年全球经济出现企稳改善局面，除美国经济增长放缓外，欧元区企业全球需求也开始恢复，经济总体也获得明显复苏。通胀方面，2017年以来，国内供给端改善和全球大宗商品价格影响，国内工业品价格指数持续回升，尽管四季度受2016年高基数影响有所回落，但总体依然保持在高位，并带动企业盈利的明显复苏；相对而言，2017年CPI涨幅相对温和，工业品价格涨幅过快对CPI的传导效果依然不是很明显。2017年货币政策保持稳健，四季度以来，叠加监管政策在11月之后陆续出台，各条债券收益率大幅上行，国债普遍上行幅度超过20BP，金融债和信用债普遍上行50-80BP，信用利差继续走扩。

受供给侧改革和补库存带来的盈利增长驱动影响，尽管期间因监管、海外市场等因素影响出现过波动，但2017年股票市场整体是向上的，行业分化也比较明显，主板市场显著好于创业板。数据上，2017年上证综指整体上涨6.56%，深圳成指上涨3.48%，创业板下跌12.60%。

本基金于2017年3季度末成立，操作思路上是灵活参与股票和债券市场的配置，尽可能追求绝对收益目标。整体而言，本基金成立以来，债券配置比例整体维持较低的久期和杠杆水平，债券以短久期信用债为主；股票以价值股为主，比例控制在30%以内。

截至本报告期末汇添富睿丰混合A基金份额净值为1.0241元，本报告期基金份额净值增长率为2.41%；截至本报告期末汇添富睿丰混合C基金份额净值为1.0231元，本报告期基金份额净值增长率为2.31%；同期业绩比较基准收益率为0.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2018年，经济总体可能会前高后低，前期经济增长的动力主要来自新兴于新兴产业和消费相关服务业务的持续增长，而后期压力则可能是来自于调控对总需求的影响。目前看，政府的调控手段逐渐多样化，且精准化，经济总体大幅下滑的可能性较小。2018年工业品出厂价格指数同比增速在高基数之下可能会前高后低，消费价格指数会温和上升，但总体可控。货币政策上，2017年年底中央工作会议提出“管住流动性的总闸门”措辞意味着，后期应该会更加放松的可能性，尤其是在监管政策尚未完全落地之前放松货币政策，会导致金融去杠杆工作“前功尽弃”，资金面有望继续保持紧平衡格局，但2018年后半，伴随工业品价格指数同比增速的持续回落，企业盈利可能会有所回落，货币政策可能会适度放松。

债券市场上，考虑当前监管政策趋严态度较为坚决，并且对债券市场情绪可能会产生巨大影响，叠加近期环保督查和原油价格上涨可能还会对债券市场产生制约，债券市场短期压力仍存。但伴随工业品价格指数同比增速的持续回落，2018年后期货币政策或监管政策可能会出现边际上放松，进而对债市带来配置时机。品种上，相对而言，高等级信用债可能具有更高的配置价值，毕竟在信用利差整体处于低位的情况下，监管政策可能对低评级信用债仍可造成冲击，当前时点的收益率对于中低等级信用债的保护可能仍相对不足，高等级的配置价值则有望相对凸显。

股票市场上，考虑中国经济进入中速增长阶段，经济结构的变化比总量增长更值得关注，股票将继续保持持下且上优中优选，围绕消费升级、优先选择行业发展空间大、持续增长动力强、增速较快的行业；另外，组合也会关注供给侧改革带来的行业集中度提高的龙头股机会。但作为绝对收益组合，会根据安全垫情况合理控制股票头仓的回报风险。

在本基金的操作上，我们将继续坚持价值投资的理念，重视绝对收益目标，积极调整组合结构，控制组合下行风险，力争为投资者创造持续稳定的收益。

4.6 管理人内部有关基金的监察稽核工作情况
本报告期内，公司维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据法规、客观、公正的原则，认真履行职务，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机构、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系
在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规范、岗位手册和业务流程，进一步明确了内部控制和风险

管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规
本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控、对投资组合的风险度量、评估和建议、对基金信息披露的审核、监督、对基金投资、销售、营销的稽核、控制、对基金运营、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

（三）强化培训教育，提高全员合规意识
本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的能力和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护并保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017年9月6日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金运营部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议调整某一投资品种的估值调整影响，并有权利发表有关议案但仅有一票表决权，从而将其影响范围进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。本基金在封闭期内的收益分配方式为现金分红。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者选择不将，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的形式，具体收益分配程序等有关事项遵照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；本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应分配金额后不能低于面值。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
无。

§5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇添富睿丰混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等相关内容的真实、准确和完整发表意见
本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.5 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.6 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.7 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.8 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.9 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.10 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.12 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.13 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.14 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.15 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.16 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.17 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.18 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.19 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.20 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.21 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.22 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.23 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.24 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.25 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.26 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.27 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.28 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.29 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.30 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.31 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.32 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.33 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.34 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.35 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.36 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.37 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.38 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.39 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.40 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.41 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.42 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.43 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.44 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定，对基金管理人投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.45 本报告期内，本托管人根据《证券投资基金