（接B77版）

客户服务电话:95531,400-888-8588

（152）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:钱卫

电话:021-50372474

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

（153）恒泰证券股份有限公司

住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人:庞介民

电话:021-68405273

传真:021-68405181

联系人:张同亮

网址:www.cnht.com.cn

客户服务电话:400-196-6188

（154）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:江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦4层

法定代表人:马承进

电话:0791-86283080

传真:0791-86281305

联系人:俞艳

网址:www.gszq.com

客户服务电话:400-822-2111

（155）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:谢翌梅

网址:www.hxf168.com.cn

客户服务电话:400-888-8818

（156）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

（157）中泰证券股份有限公司

住所:山东省济南市市区经七路86号

办公地址:山东省济南市市区经七路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.zts.com.cn

客户服务电话:95538

（158）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:裴咏军

客户服务电话:400-832-3000

传真:0755-83199511

联系人:王雯

网址:www.csco.com.cn

（159）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:0755-23838750

联系人:毛诗莉

网址:www.firstcapital.com.cn

客户服务电话:95358

（160）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:0755-83025225

联系人:马婧清

网址:www.jyzq.cn

客户服务电话:95372

（161）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

（162）华林证券股份有限公司

住所:西藏日喀则市桑珠孜区柴古大道1-1号君泰国际B栋一层3号

办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人:林立

电话:0755-83255199

传真:0755-82707700

联系人:胡倩

网址:www.chinalin.com

客户服务电话:400-188-3888

（163）德邦证券股份有限公司

住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人:姚文平

电话:021-68761616-8076

传真:021-68767032

联系人:刘晓

网址:www.tebon.com.cn

客户服务电话:400-888-8128

（164）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:029-87147129

传真:029-87424426

联系人:刘宏

网址:www.westsecu.com

客户服务电话:95582

（165）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

（166）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）

（167）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

（168）财通证券股份有限公司

住所:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人:沈继宁

电话:0571-87925129

传真:0571-87818329

联系人:夏吉慧

网址:www.ctsec.com

客户服务电话:95336

（169）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:上海市黄浦区南京西路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:徐璐

网址:www.shhxzq.com

客户服务电话:400-820-5999

（170）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

（171）瑞银证券有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:程宜荪

电话:010-58328112

传真:010-58328748

联系人:牟冲

网址:www.ubssecurities.com

客户服务电话:400-887-8827

（172）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:胡正瑶

网址:www.china-invs.cn

客户服务电话:400-600-8008、95532

（173）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

（174）西藏东方财富证券股份有限公司

住所:拉萨市北京中路101号

办公地址:上海市永和路118弄东方金业园24号

法定代表人:贾绍君

电话:021-36533017

传真:021-36533017

联系人:王伟光

网址:www.xzsec.com

客户服务电话:95357

（175）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

办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人:孔伯杰

电话:010-88088830-730、010-88086830-737

传真:010-66412537

联系人:陈书杉、朱晓光

网址:www.rxzq.com.cn

客户服务电话:95385

（176）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

（177）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

（178）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

（179）中国民族证券有限责任公司

住所:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层

办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6层-9层

法定代表人:赵大建

电话:010-59355941

传真:010-66553791

联系人:李魏

网址:www.e5618.com

客户服务电话:400-889-5618

（180）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

办公地址:上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼

法定代表人:陈亚民

电话:021-68777126

传真:021-68777077-8427

联系人:徐菊

网址:www.shhxzq.com

客户服务电话:400-820-5999

（181）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:福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼

法定代表人:王勇

电话:0592-2079259

传真:0592-2079602

联系人:邱霞

网址:www.gwgsc.com

客户服务电话:400-0099-886

（182）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

（183）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:杨献平

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

（184）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:崔璀

网址:www.tfzq.com

客户服务电话:400-800-5000

（185）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:熊欣杰

网址:www.hxzq.cn

客户服务电话:400-836-6366

（186）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

（187）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:邵勇强

网址:www.huarisales.com

客户服务电话:400-111-5818

（188）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:010-88066632

传真:010-88066214

联系人:何秋月

网址:www.amcfortune.com

客户服务电话:400-817-5666

基金管理人可以根据有关法律法规、相关情况增加或者减少代销机构，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）注册登记机构

1、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:杨小辉

客户服务电话:400-818-6666

传真:010-63136700

联系人:宋威

2、名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

联系人:熊鸿鹄

联系电话:010-50938870

传真:010-50938907

（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:华夏回报证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:尽量避免基金资产损失，追求每年较高的绝对回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资方向:限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1、资产配置策略

基金管理人分析判断证券市场走势，在遵守有关投资限制规定的前提下，合理配置基金资产在股票、债券、现金等各类资产间的投资比例。基金管理人还将采用分析市场价值均衡点等定量方法，辅助判断市场趋势的变动。

（1）在股票市场处于低风险区域或预期股票市场趋于上涨时，基金将采取积极的做法，主要投资于股票市场，分享股票市场上涨带来的收益，实现较高回报。

（2）预期股票市场处于震荡运行时，基金将采取波段操作策略，在市场震荡、调整过程中，经常会出现整个资产类别、部分行业或个股投资价值被低估的短期失衡现象，如投资者因恐慌心理而过度抛售导致股票价值被低估的情况，基金管理人将发现、确认并利用这些市场失衡机会，重点选择被低估的资产类别、行业、个股进行投资，以实现基金的投资目标。

（3）在股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时，基金将采取保守的做法，大幅减少股票投资比例，甚至不再持有股票，而主要投资于债券市场，以回避股票市场下跌的系统性风险，避免损台损失。

（4）在预期利率上升、债券价格将下降时，组合将增加现金存款比例，并将债券资产主要投资于短期债券和浮息债券，在预期利率下降、债券价格将上升时，组合将降低现金持有比例，并将债券资产主要投资于中长期债券，以实现较高的回报。

此外，基金还将积极参与风险低且可控的新股申购、债券回购等投资，以增加收益。基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于权证。

2、股票投资策略

本基金股票投资部分主要采取价值型投资策略，达到以下标准的股票，将是本基金重点关注的对象：

（1）总市值达到20亿元及以上、流通市值达到4亿元及以上的股票。

（2）市盈率（P/E）低于市场平均水平，尤其是与公司未来的业务发展相比，市盈率水平偏低的股票，具体表现为经过成长性调整后的市盈率（P/E/G）偏低的股票。

大盘股票占股票市场总值的比重较高，能够更好地体现我国经济的高速增长，投资于大盘股票，可以更充分地分享中国经济成长的成果。此外大盘股票价格的波动性相对较小，可预测性相对较强，有利于分析判断、选择投资，而经过成长性调整后的市盈率偏低的股票具有更高的投资价值，我们预期这些股票能够取得较高的绝对收益，有利于基金实现取得较高绝对回报的投资目标。

3、债券投资策略

本基金债券投资部分主要通过对利率、利差等因素变化趋势的判断采用久期调离策略、收益率曲线配置策略和类属配置策略提高债券投资收益率。

本基金债券投资部分投资于国债及投级债券，即具有以下一项或多项特征的债券，将是本组合债券投资重点关注的对象：

（1）有较好流动性的债券。

（2）到期收益率相对类似信用质量和期限债券较高的债券。

（3）风险水平较高，有较好下行保护的债券。

（4）期限结构和收益风险特征符合对市场预期的债券。

（5）同等条件下信用质量较好或预期信用质量将得到改善的债券。

（二）投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

1、研究

本基金股票投资研究依托公司整体的研究平台，同时整合了外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果。公司研究员按行业分工，负责对各行业以及行业内个股进行跟踪研究。在财务指标分析、实地调研和价值评估的基础上，研究员对所研究的股票、行业提交投资建议报告，供基金经理小组和投资决策委员会参考。此外，公司有专门的宏观经济研究员，负责分析消费、投资、进出口、就业、利率、汇率以及政府政策等因素，为资产配置决策提供支持。公司还设有固定收益部，专门负责债券投资研究。

2、资产配置决策

投资决策委员会负责判断一段时间内证券市场的基本走势，决定基金资产在股票、债券等资产类别间的分配比例范围，基金经理小组在投资决策委员会决定的资产配置比例范围内，决定基金的具体资产配置。

3、组合构建

基金经理小组根据研究员提交的投资报告，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批，对于股投资的个股，基金经理小组将采取长期关注、择机介入的方法，以降低买入成本、控制投资风险。对于买入的股票，基金的持有周期一般较长，长期持有的操作策略可有效降低基金的交易费用和变现成本，从而提高基金的收益水平。

4、交易执行

交易管理部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产配置、个股投资比例等。

5、风险与绩效评估

风险管理规定期和不定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理小组能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理小组可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

6、组合监控与调整

基金经理小组将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为绝对回报标准，为同期一年期银行存款利率。基金应在以较高的概率水平超过同期一年期定期存款利率的基础上，争取获得较高绝对回报。其中，“一年期定期存款利率”是指中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准利率。

在合理的市场化利率基准推出的情况下，基金管理人可根据投资目标和投资政策，确定变更业绩比较基准，并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金的风险收益特征:本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金2018年第2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	9,418,166,162.30	71.31
	其中:股票	9,418,166,162.30	71.31
2	固定收益投资	2,980,284,409.44	22.57
	其中:债券	2,971,759,782.80	22.50
	资产支持证券	8,524,626.64	0.06
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	200,000,340.00	1.51
	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	521,813,812.90	3.95
7	其他各项资产	86,282,484.59	0.65
8	合计	13,206,547,209.23	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	-	-
B	采矿业	127,573,859.00	0.98
C	制造业	7,487,745,918.55	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,463,522.82	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	326,438,668.00	2.51
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,056,750.00	0.24
J	金融业	214,525,394.38	1.65
K	房地产业	888,249,024.02	6.82
L	租赁和商务服务业	76,887,092.13	0.59
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	158,362,107.30	1.22
R	文化、体育和娱乐业	91,863,826.10	0.71
S	综合	-	-
	合计	9,418,166,162.30	72.32

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	000333	美的集团	15,195,539	793,511,046.58	6.09
2	000858	五粮液	8,768,847	666,432,372.00	5.12
3	600519	贵州茅台	839,371	613,966,311.66	4.71
4	000568	泸州老窖	7,030,738	427,890,714.68	3.29
5	603833	欧派家居	3,048,664	388,796,119.92	2.99
6	601155	新城控股	12,235,786	378,942,292.42	2.91
7	600779	水井坊	6,219,027	343,476,861.21	2.64
8	600276	恒瑞医药	4,384,407	332,162,674.32	2.55
9	300124	汇川技术	10,107,228	331,719,222.96	2.55
10	000963	华东医药	6,728,304	324,640,668.00	2.49

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	376,013,312.80	2.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,585,290,000.00	19.85
	其中:政策性金融债	2,585,290,000.00	19.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,149,000.00	0.08
7	可转债（可交换债）	307,470.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,971,759,782.80	22.82

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	180404	18农发04	9,200,000	922,760,000.00	7.09
2	140900	16上海09	2,500,000	245,575,000.00	1.89
3	170410	17农发10	2,200,000	220,066,000.00	1.69
4	170206	17国开06	1,900,000	189,031,000.00	1.45
5	150213	15国开13	1,800,000	179,550,000.00	1.38

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	131729	PR4A10	110,000.00	6,452,694.13	0.05
2	142400	PR聚绿A2	50,000.00	2,071,932.51	0.02
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报告期末股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	1,625,047.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,973,152.18
5	应收申购款	33,684,284.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,282,484.59

5.11.4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。

5.11.5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
2004年1月1日至2004年12月31日	0.52%	0.91%	2.04%	0.00%	-1.52%	0.91%
2005年1月1日至2005年12月31日	5.43%	0.92%	2.25%	0.00%	3.18%	0.92%
2006年1月1日至2006年12月31日	113.72%	1.24%	2.36%	0.00%	111.36%	1.24%
2007年1月1日至2007年12月31日	122.13%	1.61%	3.25%	0.00%	118.88%	1.61%
2008年1月1日至2008年12月31日	-24.52%	1.14%	3.96%	0.00%	-28.48%	1.14%
2009年1月1日至2009年12月31日	37.15%	1.14%	2.25%	0.00%	34.90%	1.14%
2010年1月1日至2010年12月31日	4.33%	0.93%	2.30%	0.00%	2.03%	0.93%
2011年1月1日至2011年12月31日	-11.77%	0.80%	3.28%	0.00%	-15.05%	0.80%
2012年1月1日至2012年12月31日	7.51%	0.62%	3.24%	0.00%	4.27%	0.62%
2013年1月1日至2013年12月31日	23.90%	0.91%	3.00%	0.00%	20.90%	0.91%
2014年1月1日至2014年12月31日	7.10%	0.80%	2.97%	0.00%	4.13%	0.80%
2015年1月1日至2015年12月31日	22.20%	1.07%	2.12%	0.00%	20.08%	1.07%
2016年1月1日至2016年12月31日	-3.58%	0.85%	1.50%	0.00%	-5.08%	0.85%
2017年1月1日至2017年12月31日	34.83%	0.66%	1.50%	0.00%	33.33%	0.66%
2018年1月1日至2018年6月30日	1.03%	1.11%	0.74%	0.00%	0.29%	1.11%

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用种类

（1）基金管理人的管理费。

（2）基金托管人的托管费。

（3）证券交易费用。

（4）基金份额持有人大会费用。

（5）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用。

（6）其他按照国家有关规定可以列入的费用。

2、与基金运作有关费用的计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金管理人可以降低基金管理费率，或在中国证监会允许的条件下依据法律法规的有关规定指出其他的基金管理费收费方式，包括但不限于浮动费率方式。本基金如按浮动费率方式取基金管理费，则年费率浮动范围最高不超过基金资产净值的2.5%。如降低基金管理费率或指出新的收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。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为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金托管费率，无须召开基金持有人大会。如降低基金托管费率，基金管理人最迟须于新的费率开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（3）其他基金运作费用的支付方式

本条第1款第3至第6项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金费用种类的调整

本基金可在中国证监会允许的条件下按照国家的有关规定增加其他种类的基金费用，如本基金仅对新发行的基金份额适用新的基金费用种类，不涉及已有基金份额持有人利益的，无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费与赎回费

（1）A类份额的申购费

①投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。

②投资者选择交纳前端申购费时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上（含100万元）—500万元以下	1.2%
500万元以上（含500万元）	1.0%

③投资者选择交纳后端申购费时，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有期	后端申购费率
1年以内	1.8%
满1年不满2年	1.5%
满2年不满3年	1.2%
满3年不满4年	1.0%
满4年不满8年	0.5%
满8年以后	0

④本基金申购费由基金管理人支配使用，不列入基金资产。

（2）H类份额的申购费

投资人申购H类基金份额，申购费率最高不超过申购金额的5%。具体申购费率和缴纳方式由销售机构自行决定。

（3）A类份额的赎回费

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。A类份额赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
7天以内	1.5%
7天以上（含7天）	0.5%

对于赎回时份额持有不满7天的，收取的赎回费全额计入基金财产，对赎回时份额持有满7天以上（含7天）收取的赎回费，须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

（4）H类份额的赎回费

对于H类份额，不论其持有期，均收取赎回金额0.125%的固定赎回费，且全部归入基金资产。

（5）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，针对以转定文易方式（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和基金赎回费率。

（6）基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率和收费方式在招募说明书更新中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（7）当发生大额申购或赎回情形时，按照法律法规及监管要求，在履行适当程序后，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法

（1）申购份额的计算

如果投资者选择交纳前端申购费，则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

净申购金额及申购份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位。

如果投资者选择交纳后端申购费，则申购份额的计算方法如下：

申购份额=申购金额/T日基金份额净值

申购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金资产承担，产生的收益归基金资产所有。

例一:假定T日的基金份额净值为1.200元，三笔A类份额的申购金额分别为1,000元、100万元和500万元，如果投资者选择交纳前端申购费，各笔申购合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	1,000,000.00	5,000,000.00
适用前端申购费率（B）	1.5%	1.2%	1.0%
净申购金额(C=A/（1+B）)	985.22	988,142.29	4,950,495.05
前端申购费(D=A-C)	14.78	11,857.71	49,504.95
申购份额（E=C/1.200）	821.02	823,451.91	4,125,412.54

如果该投资者选择交纳后端申购费，各笔申购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	1,000,000.00	5,000,000.00