

(上接 B01版)

法定代表人:李博
电话:021-20315290
传真:021-20315285
联系人:卢肇华
网址:www.aicm.com.cn
客户服务电话:95558
(108) 申联证券有限责任公司
住所:深圳市福田区福强西路788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:姜海军
电话:0400-832-3000
传真:0755-83199511
联系人:王雯
网址:www.sz.com.cn
(109) 第一创业证券股份有限公司
住所:广东省深圳市南山区海德路12号中时代广场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层
法定代表人:刘学民
电话:0755-25817554
传真:0755-23886790
联系人:毛诗莉
网址:www.firstcapital.com.cn
客户服务电话:95388
(110) 金元证券有限责任公司
住所:海口市南沙路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳福田区益田路401号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-8302022
传真:0755-8302028
联系人:冯静
网址:www.jyyz.com.cn
(111) 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300号建投国际中心26楼
法定代表人:姚爽平
电话:021-68815933
传真:021-68763032
联系人:冯璐
网址:www.tebon.com.cn
客户服务电话:400-888-8128
(112) 西部证券股份有限公司
住所:陕西省西安市东大街123号西信大厦16-17楼
办公地址:陕西省西安市东大街232号西信大厦16-17楼
法定代表人:刘鹏武
电话:029-87471299
传真:029-87424426
联系人:冯璐
网址:www.westsec.com.cn
客户服务电话:95582
(113) 中国国际金融股份有限公司
住所:北京市朝阳区建国路101号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国路101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:罗莎莎、武明娟
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:400-888-1099
(114) 上海证券有限责任公司
住所:上海市虹口区四川路100号环球金融中心
办公地址:上海黄浦区南京西路399号明广发广场29楼
法定代表人:陈祖涛
电话:021-63890427
传真:021-6877077-8427
联系人:孙婧
网址:www.shzq.com.cn
客户服务电话:400-820-5999
(115) 华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区中心区莲花路4019号华鑫大厦28层A01、B01(1)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞裕君
电话:021-36333014
传真:021-36333022
联系人:孙婧
网址:www.wxzq.com.cn
客户服务电话:95323、400-199-9918
(116) 国信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路4010号平安金融中心A栋44、48层及51层
办公地址:上海虹口区四川北路1912号2222单元
法定代表人:何如
电话:0755-83832882
传真:0755-83830942
联系人:邵建斌
网址:www.guoxin.com.cn
客户服务电话:400-800-8888、95532
(117) 光大证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1601号
办公地址:上海永平街101弄东方企业园24号
法定代表人:薛峰君
电话:021-36333014
传真:021-36333022
联系人:王仕莉
网址:www.east.com.cn
客户服务电话:95552
(118) 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3、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3、四楼
法定代表人:徐翔
电话:0755-83331195
传真:0755-83331281
联系人:李海霞
网址:www.lxsec.com.cn
客户服务电话:95566
(119) 上海证券期货交易所
住所:上海市浦东新区栖霞区东陆路56号
办公地址:浦东新区栖霞区东陆路56号
法定代表人:李海霞
电话:0421-8660057、021-86600518
传真:021-8660126
联系人:李海霞、陈瑞
网址:www.shzqh.com.cn
客户服务电话:95531
(120) 华安证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市潜山路166号27楼
办公地址:上海中山东二路166号27楼
法定代表人:李海霞
电话:021-50122128
传真:021-50122298
联系人:徐芳芳
网址:www.huan.com.cn
客户服务电话:95310
(121) 方正证券股份有限公司
住所:湖南省长沙市芙蓉区芙蓉中路二段18号方正大厦17层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉区芙蓉中路二段18号方正大厦19-20楼
法定代表人:王勇
电话:0902-7079259
传真:0902-7079262
联系人:张洪波
网址:www.fund.com.cn
客户服务电话:400-089-8866
(122) 建信基金管理有限责任公司
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:021-33229888
传真:021-62878878
联系人:王磊
网址:www.jinmin.com.cn
客户服务电话:400-800-5000
(123) 华泰证券股份有限公司
住所:南京市江东中路228号
办公地址:江苏省南京市江东中路228号
法定代表人:吴玉明
电话:025-86869278
传真:025-86869382
联系人:陈杰
网址:www.htsec.com.cn
客户服务电话:95597
(124) 上海浦东发展银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号
法定代表人:李善玲
电话:95529
传真:021-68821773
联系人:李善玲
网址:www.spdb.com.cn
客户服务电话:95529
(125) 交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道1600号交通银行大楼29楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号交通银行大楼29楼
法定代表人:彭纯
电话:95559
传真:021-61088515
联系人:胡晓熠
网址:www.bankofchina.com.cn
客户服务电话:400-111-1118
(126) 和信证券投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路55号楼20层2002
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街2号安明国际中心
法定代表人:孙焱
电话:010-85382314
传真:010-85382316
联系人:孙焱
网址:www.hxinc.com.cn
客户服务电话:400-886-6666
(127) 太平洋证券股份有限公司
住所:云南省昆明市高新区管委会第3号通广大厦B座8层
办公地址:北京西城区德胜门外大街1号院1号楼3单元
法定代表人:李永华
电话:88232177、1850056525
传真:010-88231763
联系人:薛苗田
网址:www.pctz.com.cn
客户服务电话:400-465-0999
(128) 广联达证券股份有限公司
住所:浙江省杭州市富阳区新登镇1号广联达大厦11楼B座
办公地址:浙江省杭州市富阳区新登镇1号广联达大厦11楼B座
法定代表人:李勇
电话:0571-82788888
传真:0571-82788888
联系人:李勇
网址:www.guand.com.cn
客户服务电话:400-886-8866
(129) 华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区宣武门大街147号
办公地址:北京市西城区宣武门大街147号
法定代表人:宋广华
电话:010-57367777
联系人:李勇
网址:www.hrsec.com.cn
客户服务电话:95325、400-800-8866
(130) 华鑫证券有限责任公司
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:021-33229888
传真:021-62878878
联系人:王磊
网址:www.huaxin.com.cn
客户服务电话:95566

(二) 基金类别的限制

份额类别	A类份额	B类份额
首次申购最低金额	直销机构或华夏财富:10,000元 代销机构:1,000.00元	5,000,000.00元 直销机构或华夏财富:10,000元 代销机构:1,000.00元
追加申购最低金额	直销机构或华夏财富:1,000元 代销机构:1,000.00元	直销机构或华夏财富:100元 代销机构:100.00元
单笔赎回最低份额	直销机构或华夏财富:10.00份 代销机构:100.00份	直销机构或华夏财富:10.00份 代销机构:100.00份
基金账户最低基金份额	直销机构或华夏财富:10.00份 代销机构:100.00份	5,000,000.00份
年销售服务费	0.25%	0.01%

(三) 基金赎回限制
1. 若 A 级基金份额持有人单个基金账户保留的基金份额超过 500 万份时, 本基金的销售机构有权对其持有的 A 级基金份额进行降级的处理, 投资者确认后, 本基金的销售机构将自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额。
2. 若 B 级基金份额持有人单个基金账户保留的基金份额超过 500 万份时, 本基金的销售机构将其在该基金账户持有的 B 级基金份额降为 A 级基金份额。
3. A 级、B 级基金份额的基金代码不同, 投资者在提交赎回等交易申请时, 应正确填写基金份额代码, 否则赎回申请无效。
(四) 基金赎回限制: 投资者赎回基金份额时, 需按照各销售机构的业务规则进行赎回。
(五) 基金管理人可以在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 调整赎回限制条款, 但应提前公告。
(六) 基金管理人可以在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 调整赎回限制条款, 但应提前公告。
(七) 基金管理人可以在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 调整赎回限制条款, 但应提前公告。
(八) 基金管理人可以在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下, 调整赎回限制条款, 但应提前公告。

八、基金的投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融资产, 包括但不限于: 股票、中央银行票据、政策性金融债等, 以及中国证监会认可的其他金融工具。
本基金投资于法律法规允许的证券市场, 包括: 国内依法公开发行的国债、央行票据、短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、资产支持证券、金融债、股指期货、权证、债券回购、国债期货等。
本基金投资于法律法规允许的证券市场, 包括: 国内依法公开发行的国债、央行票据、短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、资产支持证券、金融债、股指期货、权证、债券回购、国债期货等。

九、基金的投资策略

(一) 资产配置策略
本基金在资产配置策略上, 坚持价值投资, 合理配置, 追求基金资产增值和长期稳定的回报。
(二) 股票投资策略
本基金在股票投资方面, 坚持价值投资, 合理配置, 追求基金资产增值和长期稳定的回报。
(三) 债券投资策略
本基金在债券投资方面, 坚持价值投资, 合理配置, 追求基金资产增值和长期稳定的回报。

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 标准差②	业绩比较 基准收益③	业绩比较 基准误差④	①-③	②-④
2016年10月28日至2016年12月31日	0.4248%	0.0025%	0.2398%	0.0000%	0.1850%	0.0025%
2017年1月1日至2017年12月31日	3.9083%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	2.5583%	0.0021%
2018年1月1日至2018年9月30日	3.0904%	0.0023%	1.0097%	0.0000%	2.0807%	0.0023%

十四、费用费率

(一) 基金运作费用
(1) 基金管理人的管理费
(2) 基金托管人的托管费
(3) 基金的销售服务费
(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用
(5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费
(6) 基金份额持有人大会费用
(7) 基金账户开户费用
(8) 基金的银行汇划费用
(9) 基金的投资开户费、账户维护费
(10) 基金份额持有人认购、申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的开户费、交易费、手续费

(二) 基金管理人管理费
(1) 基金管理人的管理费
(2) 基金托管人的托管费
(3) 基金的销售服务费
(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用
(5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费
(6) 基金份额持有人大会费用
(7) 基金账户开户费用
(8) 基金的银行汇划费用
(9) 基金的投资开户费、账户维护费
(10) 基金份额持有人认购、申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的开户费、交易费、手续费

(三) 基金销售服务费
(1) 基金销售服务费
(2) 基金销售服务费
(3) 基金销售服务费
(4) 基金销售服务费
(5) 基金销售服务费
(6) 基金销售服务费
(7) 基金销售服务费
(8) 基金销售服务费
(9) 基金销售服务费
(10) 基金销售服务费

(四) 基金销售服务费
(1) 基金销售服务费
(2) 基金销售服务费
(3) 基金销售服务费
(4) 基金销售服务费
(5) 基金销售服务费
(6) 基金销售服务费
(7) 基金销售服务费
(8) 基金销售服务费
(9) 基金销售服务费
(10) 基金销售服务费

(五) 基金销售服务费
(1) 基金销售服务费
(2) 基金销售服务费
(3) 基金销售服务费
(4) 基金销售服务费
(5) 基金销售服务费
(6) 基金销售服务费
(7) 基金销售服务费
(8) 基金销售服务费
(9) 基金销售服务费
(10) 基金销售服务费

十五、基金的投资组合报告

截至本报告期末本基金总资产 100,000.00 元, 其中投资于股票资产的比例为 100.00%。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	597,912,959.61	64.17
2	其中: 股票	597,912,959.61	64.17
3	其中: 可转债	-	-
4	固定收益类投资	282,000,000.00	30.37
5	其中: 债券	282,000,000.00	30.37
6	其中: 资产支持证券	-	-
7	其中: 货币市场基金	-	-
8	其他资产	7,142,789.03	0.77
9	合计	931,259,849.03	100.00

5.2 报告期内债券投资组合特征

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券投资组合平均剩余期限	8.55
2	其中: 买入返售金融资产平均剩余期限	-
3	报告期内债券投资组合剩余存续期限	116.3
4	其中: 买入返售金融资产剩余存续期限	-

5.3 报告期内债券投资组合平均剩余期限

序号	项目	天数
1	报告期内债券投资组合平均剩余期限	86
2	其中: 买入返售金融资产平均剩余期限	69
3	报告期内债券投资组合剩余存续期限	89
4	其中: 买入返售金融资产剩余存续期限	81

5.4 报告期内债券投资组合平均剩余存续期限

序号	项目	天数
1	报告期内债券投资组合平均剩余期限	116.3
2	其中: 买入返售金融资产平均剩余期限	-
3	报告期内债券投资组合剩余存续期限	89
4	其中: 买入返售金融资产剩余存续期限	81

5.5 报告期内资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,990,278.70	8.40
4	其中: 政策性金融债	70,990,278.70	8.40
5	企业债券	204,471,210.97	28.83
6	中期票据	202,441,615.65	22.41
7	同业存单	267,809,948.29	30.04
8	其他	-	-
9	合计	597,912,959.61	71.69
10	报告期内资产支持证券投资	-	-
11	其中: 买入返售金融资产	-	-
12	其中: 货币市场基金	-	-

5.6 报告期内资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	111817179	18元-永续	1,000.00
2	1180445	18元-永续	700.00
3	1180440	18元-永续	500.00
4	04180002	18元-永续	500.00
5	011800870	18元-永续	300.00
6	011800808	18元-永续	300.00
7	011800908	18元-永续	300.00
8	111816114	18元-永续	300.00
9	111895542	18元-永续	300.00
10	101453000	14元-永续	200.00

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25% (含)-0.5% 的次数	5%
报告期内偏离度的最高值	-0.29%
报告期内偏离度的最低值	0.14%
报告期内每个工作日偏离度的最高平均值	0.20%

本基金报告期内不存在偏离度的绝对值超过 0.25% 的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况说明
本基金报告期内不存在正偏离度的绝对值超过 0.5% 的情况。
5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

5.8 报告期内资产支持证券投资

费用及份额计算如下:

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出总费用(B)	1.200
转出基金净值(C=A-B)	12,000,000.00
转出基金份额(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
转出基金净值(F=C-E)	11,940,000.00
转出基金费用(G)	0.00
转出基金净值(H=F-G)	11,940,000.00
转出基金费用(I=H*J)	1,194,000.00
转出基金净值(K=H-I)	1,025,600.00

例二: 假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请, 转出持有的前次收费基金 1000 份, 转入后收费基金乙, 当日乙基金基金份额净值为 1.200, 1.500。2010 年 3 月 16 日该笔转换确认成功, 转出基金费用, 转入基金费用及份额计算如下:

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出总费用(B)	1.200
转出基金净值(C=A-B)	1,200.00
转出基金份额(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
转出基金净值(F=C-E)	1,194.00
转出基金费用(G)	0.00
转出基金净值(H=F-G)	1,194.00
转出基金费用(I=H*J)	1,194.00
转出基金净值(K=H-I)	0.00

例三: 假定投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金, 赎回时乙基金持有期为 1 年 2 个月, 适用后期末赎回费率为 1.2%, 当日乙基金基金份额净值为 1.300, 1.500。赎回基金费用及份额计算如下:

项目	费用计算
赎回份额(L)	796.00
赎回基金净值(M)	1,300
赎回基金净值(N=M*L)	1,034.80
赎回基金费用(O)	0.00
赎回基金净值(P=N-O)	1,034.80
赎回基金费用(Q=P*R)	12.16
赎回基金净值(R=P-Q)	1,022.64

例四: 假定投资者在 T 日转出前收费基金甲 1000 份, 转入不收取申购费用基金乙, 当日乙基金基金份额净值为 1.300, 1.500。转出基金费用及份额计算如下:

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000.00
转出总费用(B)	1.300
转出基金	