（上接B38版）

(103)万联证券股份有限公司

住所	广州市中山二路18号电信广场36、37层		
办公地址	广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼		
注册地址	广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020)37865070	传真	020-22373718-1013
网址	http://www.wanlq.com.cn	客服电话	4008888133

(104)渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022)28451991	传真	(022)28451892
网址	http://www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(105)信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
注册地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	尹旭航
电话	(010)63081493	传真	(010)63081344
网址	http://www.cindasc.com	客服电话	95321

(106)平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层		
办公地址	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层		
注册地址	深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层		
法定代表人	何之江	联系人	周一涵
电话	021-38637436	传真	021-58991896
网址	stock.pingan.com	客服电话	95511-8

(107)东莞证券股份有限公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
注册地址	广东东莞市莞城区可园南路1号		
法定代表人	张运勇	联系人	李荣
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712
网址	http://www.dgzq.com.cn	客服电话	95328

(108)国都证券股份有限公司

住所	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
办公地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层		
注册地址	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层		
法定代表人	王少华	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311
网址	http://www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(109)东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
注册地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	http://www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

(110)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路88		
办公地址	江西省南昌市北京西路88号		
注册地址	江西省南昌市西湖区北京西路88号(江信国际金融大厦)		
法定代表人	徐丽峰	联系人	占文驰
电话	(0791)86283372	传真	(0791)86281305
网址	http://www.gsstock.com	客服电话	4008222111

(111)金元证券股份有限公司

住所	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
办公地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
注册地址	海口市南宝路36号证券大厦4楼		
法定代表人	王作义	联系人	马贤清
电话	(0755)83025022	传真	(0755)83025625
网址	http://www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(112)西部证券股份有限公司

住所	陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼		
办公地址	陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室		
注册地址	陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室		
法定代表人	徐朝晖	联系人	梁承华
电话	(029)87416168	传真	(029)87406710
网址	http://www.west95582.com	客服电话	95582

(113)华龙证券股份有限公司

办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼		
注册地址	甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼		
法定代表人	李晓安	联系人	范坤
电话	(0931)4890208	传真	(0931)4890628
网址	http://www.hlzq.com	客服电话	95368

(114)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	浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716室		
注册地址	浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716室		
法定代表人	陆建强	联系人	陶志华
电话	0571-87789160	传真	0571-87818329
网址	http://www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336、962336(上海地区)

(115)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	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
注册地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
法定代表人	俞洋	联系人	杨剪娟
电话	021-54967552	传真	021-54967032
网址	http://www.cfsc.com.cn	客服电话	021-32109999;029-68918888;4001099918

(116)中山证券有限责任公司

办公地址	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层		
注册地址	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	联系人	罗艺琳
电话	0755-82570586	传真	0755-82960582
网址	http://www.zszq.com.cn	客服电话	95329

(117)国金证券股份有限公司

办公地址	四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼		
注册地址	四川省成都市青羊区东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	刘靖娜、贾鹏
电话	028-86690057、028-86690058	传真	028-86690126
网址	http://www.gjzq.com.cn	客服电话	95310

(118)长城国瑞证券有限公司

住所	厦门市蓬莱西路2号蓬富大厦十七楼		
办公地址	厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼		
注册地址	厦门市思明区蓬莱西路2号蓬富大厦17楼		
法定代表人	王勇	联系人	林丹
电话	(0592)2079259	传真	(0592)2079602
网址	http://www.gwgsc.com/	客服电话	400-0099-886

(119)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32楼		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼(陆家嘴商务广场)		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼		
法定代表人	祝健	联系人	陈敏
电话	(021)32229888	传真	021-68728782
网址	http://www.ajzq.com	客服电话	(021)63340678

(120)天风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼		
注册地址	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	联系人	岑妹妹
电话	027-87617017	传真	027-87618863
网址	http://www.tfzq.com	客服电话	4008005000

(121)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006		
注册地址	深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006		
法定代表人	马勇	联系人	文雯
电话	010-83363101	传真	010-83363072
网址	http://www.xinlande.com.cn	客服电话	400-118-1166

(122)上海挖财基金销售有限公司

住所	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室		
办公地址	上海浦东杨高南路799号3号楼5楼		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室		
法定代表人	冷飞	联系人	李明
电话	021-50810687	传真	021-58300279
网址	http://www.wacaijijin.com	客服电话	021-50810673

(123)腾安基金销售(深圳)有限公司

办公地址	深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼		
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)		
法定代表人	刘明军	联系人	谭广锋
电话	0755-86013388-80618	传真	-
网址	http://www.tenganxinxi.com或http://www.txfund.com	客服电话	95017

(124)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座12楼		
注册地址	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室		
法定代表人	祖国明	联系人	韩爱彬
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	http://www.fundl23.cn	客服电话	4000-766-123

(125)北京汇成基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区中关村大街11号11层1108室		
注册地址	北京市海淀区中关村大街11号11层1108号		
法定代表人	王伟刚	联系人	丁向坤
电话	010-56282140	传真	010-62680827
网址	http://www.hejijin.com/	客服电话	400-619-9059

(126)北京新浪仓石基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室		
注册地址	北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室		
联系人	付文红		
电话	010-62676405	传真	010-62676582
网址	http://www.xincai.com	客服电话	010-62675369

(127)上海万得基金销售有限公司

办公地址	中国(上海)浦东新区福山路33号9楼		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座		
法定代表人	王廷富	联系人	姜吉灵
电话	021-68882280	传真	021-68882281
网址	https://www.520fund.com.cn/	客服电话	400-821-0203

(128)凤凰金信(银川)基金销售有限公司

办公地址	宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层办公房		
注册地址	宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房		
法定代表人	程刚	联系人	张旭
电话	010-58160168	传真	010-58160173
网址	http://www.fengfd.com/	客服电话	400-810-55919

(129)和耕传承基金销售有限公司

办公地址	郑州市郑东新区东风东路康宁街北6号楼6楼602、603房间		
注册地址	郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间		
法定代表人	李淑慧	联系人	裴小龙
电话	0371-85518395 4000-555-671	传真	0371-85518397
网址	HGCCPB.COM		

(130)南京途牛金融信息服务有限公司

办公地址	南京市玄武区玄武大道699-32号		
注册地址	南京市玄武区玄武大道699-1号		
法定代表人	宋时琳	联系人	王骏
电话	025-86853960 025-86853969	传真	025-86853969
网址	http://www.tuniufu.com		

(131)北京肯特瑞基金销售有限公司

办公地址	北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06		
注册地址	北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06		
法定代表人	江卉	联系人	江卉
电话	4000988511	传真	010-89188000
网址	http://fund.jd.com	客服电话	010-89188462

(132)北京蛋卷基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507		
注册地址	北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507		
法定代表人	钟翼垫	联系人	黄永姣
电话	010-61840688	传真	010-61840699
网址	http://www.ncfjj.com	客服电话	4000-618-518

（二）登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	赵学军
联系人	彭鑫
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021)31358666	传真	(021)31358600
经办律师	吕红、黎明		

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼		
办公地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	张勇
电话	(021)23238888	传真	(021)23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

四、基金的名称

本基金名称:嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。本基金为股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下,力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报,谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,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(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为85%-95%;债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为0%-15%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

本基金将在保持较高的股票仓位和基本面研究的基础上,以谋求基金资产的长期增值为目标,采用“自下而上”精选策略优选个股,通过嘉实研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合,并根据宏观经济运行状况,动态调整大类资产的配置比例,达到增强收益的目的。

1、大类资产配置

本基金作为较高仓位的股票基金,将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析,根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置,在控制风险的前提下,通过对基本面的深入研究谋求基金投资组合。

2、股票投资策略

基金管理人依托强大的研究平台,通过多层面、多维度的方法来深入研究公司的基本面状况,挖掘企业的价值驱动因素。嘉实采用实地调研、案头研究以及电话访谈等多种对上市公司进行调研,寻找备选企业能够在所处行业生存并不断发展的根本驱动要素,从而为研究员进行业绩预测和估值提供依据。

（1）股票研究方法及选股策略

嘉实采用“自下而上”的股票精选策略,坚持以深入细致的基本面研究为选股的基本原则并在研究团队的模拟组合基础上精选个股。嘉实将研究团队划分为不同的研究小组,其研究范围覆盖了全部行业。因此,选股将不再局限于个别行业或者单一风格,选股类型也更加丰富,包括成长股、价值股等不同类型。

我们认为市场阶段性的效率缺失会导致股价低于企业价值,从而构成投资机会,尤其在A股市场,机构投资者占比仍然不高的情况下,市场的阶段性无效会更加明显。股票研究的过程及框架如下:

1)案头研究,具体又分为:a)行业研究:公司所处行业发展空间、所处的周期阶段、行业内的竞争结构的分析;b)公司研究:分析内容包括公司历史沿革、定期财务报表、竞争劣势、核心竞争力、核心管理团队、以及公司治理。案头研究一般会产生调研提纲以及初步的估值模型,并作为下一步研究的基础。

2)实地调研,包括对公司核心管理团队的拜访,对公司生产车间的实地调研,对上下游环节以及竞争对手的调研。

3)估值模型的完善,通过调研对核心假设进行修正,从而获得对公司价值的全面认识并在日后的跟踪中不断完善。

长期看,股票价格反应企业价值,但中短期内,股票价格会受各种因素影响而偏离价值,比如行业景气波动、产品技术革新、公司治理结构、甚至市场情绪,我们致力于在公司股价与公司价值发生偏离的时候进行买入或卖出。

（2）组合构建

本基金的股票投资组合构建是以研究团队的模拟组合为蓝本,模拟组合的构建方法如下:

研究团队的模拟组合分为三级结构,由上到下分别为研究小组权重配置、组内行业配置及行业内个股配置。

1)在第一个层次中,公司研究小组在整体研究团队模拟组合中的配置比例直接参考该小组所占的自然权重。主要原因在于研究团队模拟组合的理念是通过自下而上的精选个股创造超额收益,而非依赖大类行业间的轮动获取收益。

2)在第二个层次中,组内行业的配置比例由小组会议讨论决定。各小组组内行业的权重占比以该行业的流通市值占比为基础,根据研究员对组内行业基本面前景的比较和判断做一定的调整。各小组通过对组内行业进行超、标、低配置来体现研究员对行业之前做出的比较和判断;

3)在第三个层次中,各个研究员依据对其分管行业以及上市公司基本面的研究和判断做出的独立决策,行业内的个股配置比例由行业分析师建议、经小组组长及研究总监核准后确定。

(3)个股调整

本基金将动态跟踪上市公司和所在行业的基本面情况,结合行业配置比例和个股估值水平,进行行业、个股的优化配置。调整频率分为定期和非定期两种。定期调整是按月统一调整。非定期调整是指市场出现重大事件或重大观点转变时进行调整。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面,通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以久期控制和结构分布策略为主,以收益率曲线策略、利差策略等为辅,构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制,严格控制风险,对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估,并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响,通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

5、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

6、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

具体而言,在大类资产配置策略的风险控制上,由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在行业配置策略的风险控制上,风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外,也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规章制度,控制单一个股投资风险。

九、基金的业绩比较基准

MSCI中国A股指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

MSCI中国A股指数是摩根斯坦利资本国际公司(MSCI)编制的,它的样本选自于沪深两个证券市场,并以自由流动量作为权重来选取成份股。MSCI中国A股指数具有覆盖性广、代表性强、指数编制方法透明、市场波动较小、国际化等特点,能够较好的反映中国A股市场总体发展趋势。

如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律法规发生变化或更改指数名称、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人可以根据维护投资者合法权益的原则,调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日(“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

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	385,361,635.99	85.60
	其中:股票	385,361,635.99	85.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,538,493.90	4.56
	其中:债券	20,538,493.90	4.56
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,376,137.68	9.63
8	其他资产	929,197.37	0.21
9	合计	450,205,464.94	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,619,184.00	0.58
B	采矿业	12,127,894.91	2.70
C	制造业	170,397,790.01	37.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,185,805.44	2.27
E	建筑业	5,029,880.20	1.12
F	批发和零售业	15,162,295.67	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	11,711,206.18	2.61
H	住宿和餐饮业	2,116,125.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,324,769.69	2.52
J	金融业	104,585,877.20	23.30
K	房地产业	19,097,482.22	4.25
L	租赁和商务服务业	9,012,994.90	2.01
M	科学研究和技术服务业	4,556,833.12	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	571,000.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,601,338.23	0.58
R	文化、体育和娱乐业	4,261,159.22	0.95
S	综合	-	-
	合计	385,361,635.99	85.85

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	601336	新华保险	461,602	23,301,668.96	5.19
2	600036	招商银行	559,600	17,174,124.00	3.83
3	600030	中信证券	970,200	16,192,638.00	3.61
4	601398	工商银行	1,909,600	11,018,392.00	2.45
5	601939	建设银行	1,356,100	9,818,164.00	2.19
6	601318	中国平安	142,900	9,788,650.00	2.18
7	601155	新城控股	300,400	7,867,476.00	1.75
8	002120	韵达股份	189,278	6,446,808.68	1.44
9	002415	海康威视	213,800	6,144,612.00	1.37
10	601988	中国银行	1,639,600	6,099,312.00	1.36

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	20,040,056.00	4.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	498,437.90	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,538,493.90	4.58

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	170024	17附息国债24	200,000	20,024,000.00	4.46
2	113014	林洋转债	2,830	259,256.30	0.06
3	127004	模塑转债	1,725	149,592.00	0.03
4	113015	隆基转债	920	89,589.60	0.02
5	019585	18国债03	160	16,056.00	0.00

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

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末,本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

(1)2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于2018年2月12日作出行政处罚决定,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金投资于“招商银行(600036)”的决策程序说明:基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“招商银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无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。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,913.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	653,983.55
5	应收申购款	187,300.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	929,197.37

(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	113014	林洋转债	259,256.30	0.06
2	127004	模塑转债	149,592.00	0.03
3	113015	隆基转债	89,589.60	0.02

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

（一）本报告期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

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
2013年5月28日(基金合同生效日)-2013年12月31日	1.10%	0.79%	-7.93%	1.30%	9.03%	-0.51%
2014年	39.96%	1.03%	44.19%	1.10%	-4.23%	-0.07%
2015年	31.73%	2.40%	10.63%	2.37%	21.10%	0.03%
2016年	-7.14%	1.50%	-13.92%	1.45%	6.78%	0.05%
2017年	25.53%	0.67%	10.59%	0.64%	14.94%	0.03%
2018年1月1日至2018年6月30日	-10.13%	1.18%	-16.86%	1.12%	6.73%	0.06%
2018年1月1日至2018年9月30日	-12.69%	1.23%	-20.28%	1.18%	7.59%	0.05%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实研究阿尔法股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年5月28日至2018年9月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关约定。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

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）基金的证券交易费用;

（7）基金的银行汇划费用;

（8）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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3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、公休日等,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3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“一、基金费用的种类中第3—8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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

（1）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财产的损失;

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

（3）《基金合同》生效前的相关费用;

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在