

(上接 D20 版)

(86)北京植信基金销售有限公司
住所:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:杨纪锋
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:400-680-2123
网址:www.zhixin-inv.com
(87)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部A座
法定代表人:江井
联系人:赵德赛
电话:4000988511/4000888816
传真:010-89188000
客服电话:95118
网址:http://fund.jd.com/
(88)上海朝阳永续基金销售有限公司
住所:浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址:上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人:廖冰
联系人:郑秋月
联系电话:021-80234888-6694
传真:021-80234988
客服电话:4006991888
公司网址:www.99fund.com
(89)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人:钱昊旻
联系人:徐奕
电话:010-59336339
传真:010-59336500
客服电话:4008-909-998
(90)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1幢2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:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真:010-63136184
客服电话:400-817-5666
网址:www.amcfund.com
(91)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江宁区武汉中央商务区泛海国际SOHO(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江宁区武汉中央商务区泛海国际SOHO(一期)第七幢23层1号4号
法定代表人:陶捷
联系人:陆锋
客户服务电话:4000279899
公司网址:www.buyfunds.cn
(92)和耕传承基金销售有限公司
住所:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人:李淑敏
联系人:罗聰
客户服务电话:0371-85518396
公司网址:www.hggpc.com
(93)徽商期货有限责任公司
住所:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4,6,7层,6号楼1,2层
办公地址:安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4,6,7层,6号楼1,2层

法定代表人:吴国华
联系人:申倩倩
客户服务电话:4008878707
公司网址:www.hsqh.net
(94)北京微动利基金销售有限公司
住所:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人:李长军
联系人:何鹏
客户服务电话:400-819-6665
公司网址:www.buyforyou.com.cn
(95)成都华羿恒信基金销售有限公司
住所:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人:赵壁
联系人:徐萌
客户服务电话:400-8010-009
公司网址:http://www.huayihengxin.com
(96)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:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
联系人:李婧
联系电话:021-50810687
客服电话:021-50810673
公司网址:www.wacaijin.com
(97)上海大智慧基金销售有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人:申健
联系人:宋楠
联系电话:021-20219988
客服电话:021-20292031
网址:https://www.wg.com.cn/
(98)北京加和基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层
办公地址:北京市西城区北礼士路甲129号文化创新工场四层404
法定代表人:徐福星
联系人:李美
电话:010-68292940
传真:010-68292964
客户服务电话:400-600-0030
网址:www.bzfunds.com
(99)北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层

法定代表人:蒋煜
联系人:刘融融/徐晓荣
电话:010-58170905/010-58170876
传真:010-58100800
客户服务电话:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com.cn
(100)北格上富信基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:曹庆展
客户服务电话:400-066-8586
公司网址:www.igsafe.com
(101)北京电盈基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
客户服务电话:400-100-3391
公司网址:http://www.dianyingfund.com/
(102)万家财富基金销售有限公司(天津)有限公司
住所:天津自贸区(中心商务区)迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人:李修辞
联系人:邵玉磊
客户服务电话:010-59013825
公司网址:http://www.wanjiawealth.com/
(二)登记机构
名称:中海基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层

办公地址:上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人:杨皓鹏
总经理:杨皓鹏
电话:021-38429808
传真:021-68419328
联系人:周琳

(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:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陈颖华
经办律师:黎明、陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
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01-12室
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-58153000
联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、闾育化
四、基金的名称
中海添瑞定期开放混合型证券投资基金
五、基金的类型
混合型证券投资基金
六、基金的投资目标
本基金在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人取得超越基金业绩比较基准的收益,实现基金资产的稳健增值。
七、基金的投资范围
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、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(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场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(但须符合中国证监会相关规定)。
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,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-30%。开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
八、基金的投资策略
包括资产配置策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略和开放式投资策略。
1.资产配置策略
本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策变化、不同行业发展趋势等判断,采取自上而下的分析方法,比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征,动态确定基金资产在权益类和固定收益类资产的配置比例。
2.债券投资策略
1)久期配置:基于宏观经济趋势性变化,自上而下的资产配置。利用宏观经济分析模型,确定宏观经济的周期变化,主要是中长期的变化趋势,由此确定利率变动的方向和趋势。根据不同大类资产在宏观经济周期中的属性,即货币市场顺周期,债券市场逆周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征。结合货币政策、财政政策以及债券市场资金供求分析,根据收益率模型为各种固定收益类金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。
2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限的骑乘策略进行分解。通过优化资产配置选择预期收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。
子弹组合,即使组合的现金流呈量集中分布;
杠铃组合,即使组合的现金流呈量呈两极分布;
梯形组合,即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。
3)债券类别配置/个券选择:主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。
本基金根据利率债券和信用债券之间的相对价值,以其历史价格关系的数量分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、资产支持证券等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。
个券选择:基于各个投资品种具体情况,自上而下的资产配置。
个券选择应遵循如下原则:
相对价值原则:同等风险中收益率较高的品种,同等收益率风险较低品种。
流动性原则:其它条件类似,选择流动性较好的品种。
3.可转换债券投资策略
可转换债券兼具债券和股票的相关特性,其投资风险和收益介于债券和股票之间。在进行可转换债券筛选时,本基金将首先对可转换债券自身的内在投资价值(如果面利息、利息补偿及无条件回售价格)、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究;然后对可转换债券的基础股票的基本面进行分析,形成对基础股票的价值评估;最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。

4.资产支持证券投资策略
本基金将在宏观经济和基本分析的基础上,对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。
5.股票投资策略
在股票投资中,本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法,精选其中具有核心竞争优势的上市公司,结合投研团队的综合判断,构造股票投资组合。其间,本基金也将积极关注当前已经完成定向增发,且还处于锁定期内的上市公司,当二级市场股价跌破定向增发价时,通过深入研究增发新股的上市公司的基本面,并结合当前股价在技术面的情况,在其二级市场股价达到一定的破发幅度后择机买入,在定向增发股票解禁日逐渐临近或定向增发股票解禁后择机卖出,以实现破发回补的收益。
6.股指期货投资策略
本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,参与股指期货投资。本基金将通过对于现货市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析,与现货组合进行匹配,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将在股指期货套期保值过程中,定期测算投资组合与股指期货的相关性,根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金运作效率,降低投资组合的整体风险。
7.权证投资策略
本基金在中国证监会允许的范围内适度投资权证,权证投资策略主要从价值投资的角度出发,将权证作为套利和锁定投资的工具,采用包括套利投资策略、风险锁定策略和股票替代策略进行权证投资。由于权证市场的高波动性,本基金在投资权证时还需要重点考察权证的流动性风险,寻找流动性与基金投资规模相匹配的、成交活跃的权证进行适量配置。
8. 开放期投资策略
本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。

九、基金的投资限制
1.组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金股票资产占基金资产的比例为0%-30%;
(2)开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约所需缴纳的保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(3)本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证总量的10%;
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券净值的10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(13)本基金资产与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(15)开放期内,本基金总资产不得超过基金净资产的140%;封闭期内,本基金的基本总资产不得超过基金净资产的200%;
(16)本基金参与股指期货投资,需遵守下述限制:
在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;封闭期内,本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;开放期内,在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
(17)开放期内,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(19)法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。
因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,除上述第(2)、(12)、(17)、(18)项约定外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。
基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。
2.禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关关联交易必须得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,基金管理人履行适当程序后,则本基金投资可不受上述规定的限制或按变更后的规定为准。
十、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:
中证全债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%
中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。本基金选择该指数来衡量债券投资部分的绩效。
沪深300指数是由中证指数有限公司编制发布、表征A股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数来衡量股票投资部分的绩效。
根据本基金的投资范围和投资比例,设定本基金的业绩比较基准为:“中证全债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%”,该基准能客观衡量本基金的投资绩效。
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并履行适当程序后,按照法律法规规定,适当调整业绩比较基准并在指定媒介上及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。
十一、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
十二、基金投资组合报告
1.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,283,915.50	83.17
	其中:债券	45,283,915.50	83.17
	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	5,900,000.00	10.84
	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	173,269.09	0.32
8	其他资产	3,092,466.03	5.68
9	合计	54,449,650.62	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金在本报告期末未持有沪港通股票投资。
1.3 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
注:本基金本报告期末未持有股票。
1.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,602,481.00	30.59
	其中:政策性金融债	16,602,481.00	30.59
4	企业债券	22,315,704.50	41.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)债	6,365,730.00	11.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,283,915.50	83.44

1.5 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	018006	国开1702	162,610	16,602,481.00	30.59
2	122152	12国债(02)	51,000	5,122,440.00	9.44
3	143175	17金地01	30,000	3,045,900.00	5.61
4	132011	17浙报EB	32,640	3,012,672.00	5.55
5	136198	16上药01	30,000	2,996,400.00	5.52

1.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
1.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。
1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 本期国债期货投资政策
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货合约。
1.10.3 本期国债期货投资评价
根据基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
1.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,452.19
2	应收证券清算款	2,064,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,025,013.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,092,466.03

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
本基金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。
十三、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。
基金业绩净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(截至2018年12月31日):

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益率基准④	①-③	②-④
2018.01.19-2018.12.31	3.56%	0.05%	-0.01%	0.41%	7.57%	-0.36%
自基金合同生效起至今	3.56%	0.05%	-0.01%	0.41%	7.57%	-0.36%

注:本基金合同生效日为2018年1月19日,基金的过往业绩并不预示其未来表现。
十四、基金的费用与税收
(一)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事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券/期货交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、账户开户费用和账户维护费用;
10、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。
(二)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0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.80%÷当年天数
H为每日应计提的管理费
E为前一日的基金资产净值
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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
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0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.20%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
3、基金销售服务费
本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:
H=E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人及基金托管人双方核对无误后,基金托管人根据基金管理人的划款指令于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给销售机构。
若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。
上述“(一)基金费用的种类”中第4—10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。
(三)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。
(四)基金税收
本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。
十五、对招募说明书更新部分的说明
(一)在“基金管理人”部分,对“主要人员情况”进行了更新。
(二)对“基金托管人”部分进行了更新。
(三)对“相关服务机构”部分进行了更新。
(四)在“基金的投资”部分,对“基金投资组合报告”按最新资料进行了更新。
(五)对“基金的业绩”按最新资料进行了更新。
(六)在“其他应披露的事项”部分,披露了本期间本基金的公告信息。