(上接B6版)

传真:0791-6789414
联系人:余雅娜
网址:www.scstock.com
客户服务电话:0791-6770351
(72)华林证券有限责任公司
住所:珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼
法定代表人:段文清
电话:0755-82707853
传真:0755-82707850
联系人:骆扬
网址:www.chinalions.com
客户服务电话:各地营业部客户服务电话
(73)德邦证券有限责任公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:方加春
电话:021-68761616
传真:021-68767981
联系人:罗芳
网址:www.tebon.com.cn
客户服务电话:400-888-8128
(74)西部证券股份有限公司
住所:西安市东新街232号山西信托大厦16-17层
办公地址:西安市东新街232号山西信托大厦16-17层
法定代表人:刘建武
电话:029-87406488
传真:029-87406387
联系人:冯萍
网址:www.westsecu.com.cn
客户服务电话:029-96708
(75)华龙证券有限责任公司
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:0931-4890619、4890618、4890100
(76)财通证券经纪有限责任公司
住所:杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
电话:0571-87925129
传真:0571-87925129
联系人:乔骏
网址:www.ctsec.com
客户服务电话:0571-96336
(77)中国建银投资证券有限责任公司
住所:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
办公地址: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层至20层
法定代表人:杨小阳
电话:0755-82026521
传真:0755-82026539
联系人:刘权
网址:www.cjis.cn
客户服务电话:400-600-8008
(78)宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法人代表人:汤世生
电话:010-62294608-6240
传真:010-62296854
联系人:李茂俊
网址:www.hysec.com
客户服务电话:010-62294600
(79)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
法人代表:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
网址:www.jhzq.com.cn
客服电话:400-666-2288
(80)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:李微
网址:www.e5618.com
客服电话:400-889-5618
(81)华宝证券有限责任公司
住所:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
电话:021-50122107
传真:021-50122078
联系人:楼斯佳
网址:www.cnhbstock.com
客户服务电话:400-820-9898
(82)天建证券有限责任公司
住所:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:张建华
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:陈敏
网址:www.ajzq.com
客户服务电话:021-63340678

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

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3层
法定代表人:凌新源
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-88066511
联系人:廖为

(三)律师事务所

名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座11层
法定代表人:王立华
联系电话:010-88092188
传真:010-88092150
联系人:杨科
经办律师:吴冠雄、刘艳

(四)会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所
住所:北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

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,避免组合损失。

④在预期利率上升、债券价格将下降时,组合将增加现金持有比例,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8亿元及以上的股票。

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。

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偏离策略、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资级债券。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风险水平合理、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)决策和交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,投资总监是投资决策委员会的执行代表。

投资决策委员会和投资总监的主要职责是确定基金的资产配置政策,审批重大单项投资决定等。

基金经理的主要职责是在投资决策委员会确定的资产配置范围内,构建和调整投资组合,并向交易管理部下达投资指令。

交易管理部负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

(三)投资程序

1、资产配置:投资决策委员会定期召开会议,通过对政治、经济、政策、市场的综合分析,判断今后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,如遇重大情况,投资决策委员会也可以召开临时会议做出决策,基金经理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。

2、组合构建:基金经理借助内外研究力量的研究成果,结合自身对证券市场和上市公司的分析判断,决定具体的股票和债券品种并决定买卖时机,本基金组合构建注重分散化和流动性,严格控制个股集中度,以便根据市场时机灵活调整资产分配比例。

3、交易执行:交易管理部负责具体的交易执行。交易管理部同时还履行一线监控的职责。

4、组合监控与调整:基金经理将跟踪经济状况、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。同时,基金管理人将使用适用于股票债券混合组合的风险分析模型,基于统计分析和积极判断确定模型参数,综合考虑组合中股票、债券组合的持仓比例和拟持仓时间确定投资策略的年投资收益率风险,必要时调整组合,使年投资收益率低于零的概率较小。

5、风险报告与绩效评估:风险管理部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,基金经理可以据以检讨投资策略,进而调整投资组合。

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,为同期一年期定期存款利率。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人民银行规定的居民储蓄存款利率。未来,如果商业银行可以自由调整存款利率,管理人将与托管人协商确定基准利率。

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

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。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2009年7月14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2009年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)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	9,271,743,185.32	56.92
	其中:股票	9,271,743,185.32	56.92
2	固定收益投资	5,781,815,395.53	35.50
	其中:债券	5,781,815,395.53	35.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,106,828,297.24	6.79
6	其他资产	128,532,977.31	0.79
7	合计	16,288,919,855.40	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,785,029.88	0.05
B	采掘业	570,840,160.84	3.55
C	制造业	2,338,480,222.57	14.55
C0	食品、饮料	190,573,341.98	1.19
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	28,118,221.32	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	122,296,568.97	0.76
C5	电子	920,114.40	0.01
C6	金属、非金属	544,997,556.41	3.39
C7	机械、设备、仪表	940,381,224.69	5.85
C8	医药、生物制品	393,130,048.35	2.45
C99	其他制造业	118,063,146.45	0.73
D	电力、煤气及水的生产和供应业	213,774,005.01	1.33
E	建筑业	118,543.30	0.00
F	交通运输、仓储业	4,633,129.80	0.03
G	信息技术业	302,781,578.92	1.88
H	批发和零售贸易	382,056,094.89	2.38
I	金融、保险业	4,633,230,260.76	28.83
J	房地产业	656,589,355.36	4.09
K	社会服务业	567,000.00	0.00
L	传播与文化产业	10,383,600.00	0.06
M	综合类	150,504,203.99	0.94
	合计	9,271,743,185.32	57.69

(三)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	601398	工商银行	156,490,364	848,177,772.88	5.28
2	601166	兴业银行	20,127,347	746,925,847.17	4.65
3	601318	中国平安	10,850,200	536,650,892.00	3.34
4	601939	建设银行	88,295,557	532,422,208.71	3.31
5	000002	万科A	36,699,816	467,922,654.00	2.91
6	000001	深发展A	17,556,917	383,091,928.94	2.38
7	600000	浦发银行	14,369,345	330,782,321.90	2.06
8	000651	格力电器	14,687,429	306,967,266.10	1.91
9	601328	交通银行	31,899,883	287,417,945.83	1.79
10	601169	北京银行	16,004,902	260,239,706.52	1.62

(四)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	274,167,760.00	1.71
2	央行票据	3,567,449,000.00	22.20
3	金融债券	1,748,285,000.00	10.88
	其中:政策性金融债	1,748,285,000.00	10.88
4	企业债券	190,837,823.20	1.19
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,075,812.33	0.01
7	其他	-	-
8	合计	5,781,815,395.53	35.97

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801047	08央行票据47	5,900,000	619,441,000.00	3.85
2	070310	07进出10	6,000,000	615,960,000.00	3.83
3	0801044	08央行票据44	5,000,000	524,750,000.00	3.26
4	080404	08农发04	5,000,000	503,550,000.00	3.13
5	080409	08农发09	4,000,000	419,480,000.00	2.61

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、报告期内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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,483,939.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	6,918,580.66
4	应收利息	103,001,579.60
5	应收申购款	15,128,877.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,532,977.31

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	110567	山鹰转债	592,705.40	0.00
2	128031	巨轮转债	483,106.93	0.00

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。

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
2003年9月5日至2003年12月31日	8.24%	0.47%	0.64%	0.00%	7.60%	0.47%
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6月30日	24.24%	0.66%	1.12%	0.00%	23.12%	0.66%

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推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收取基金管理费,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推出新的收费方式,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)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)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。赎回费率为0.5%。其中,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。

③)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,针对以特定交易方式(如网上交易)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。

④)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。

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+申购费率)

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,各笔申购负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)	1.50%	1.20%	1.00%
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
申购份额(B=A/1.200)	833.33	833,333.33	4,166,666.67

②)赎回金额的计算

如果投资者在认购/申购时选择交纳前端认购/申购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

赎回金额=赎回总金额-赎回费用

如果投资者在认购时选择交纳后端申购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

后端认购费用=赎回份额×基金份额面值×后端认购费率/(1+后端认购费率)

(后端认购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)

赎回金额=赎回总金额-赎回费用-后端认购费用

其中,基金份额面值为1.00元。

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费,则赎回金额的计算方法如下:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率/(1+后端申购费率)

(后端申购费用的计算以四舍五入的方法保留小数点后两位)

赎回金额=赎回总金额-赎回费用-后端申购费用

例二:假定某投资者在T日赎回10,000份,该日基金份额净值为1.250元,其在认购/申购时已交纳前端认购/申购费,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回总金额=10,000.00×1.250=12,500.00元

赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50元

赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50元

例三:假定某投资者在设立募集期内认购本基金份额时选择交纳后端认购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.025、1.080和1.140元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端认购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
基金份额面值(B)	1.000	1.000	1.000
赎回日基金份额净值(C)	1.025	1.080	1.140
赎回总金额(D=A×C)	10,250.00	10,800.00	11,400.00
赎回费用(E=D×0.5%)	51.25	54.00	57.00
适用后端认购费率(F)	1.2%	0.9%	0.7%
后端认购费(G=A×B×F/(1+F))	118.58	89.20	69.51
赎回金额(H=D-E-G)	10,080.17	10,656.80	11,273.49

例四:假定某投资人申购本基金份额当日的基金份额净值为1.200元,该投资人选择交纳后端申购费,并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份,赎回当日的基金份额净值分别为1.230、1.300和1.360元,各笔赎回扣除的赎回费用、后端申购费用和获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3
赎回份额(A)	10,000	10,000	10,000
申购日基金份额净值(B)	1.200	1.200	1.200
赎回日基金份额净值(C)	1.230	1.300	1.360
赎回总金额(D=A×C)	12,300.00	13,000.00	13,600.00
赎回费用(E=D×0.5%)	61.50	65.00	68.00
适用后端申购费率(F)	1.80%	1.50%	1.20%
后端申购费(G=A×B×F/(1+F))	212.18	177.34	142.29
赎回金额(H=D-E-G)	12,026.32	12,757.66	13,389.71

③)T日基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

3、转换费

①)基金转换费:无。

②)转出基金费用:按转出基金赎回时应收的赎回费收取,如该部分基金采用后端收费模式购买,需收取赎回时应收的后端申购费。转换金额为扣除赎回费与后端申购费(若有)后的余额。

③)转入基金费用:对转入基金申购费用进行优惠,收取优惠申购费。针对转入基金的不同收费模式,具体说明如下:

①转入前端收费基金时

第一、前端或后端收费基金转入前端收费基金

A.转入基金申购费用适用比例费率时

如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高,则其差额部分即为转入时收取的申购费率;反之,则转入基金收取的申购费率为0。

B.转入基金申购费用适用固定费用时

a、若转出基金申购费用适用比例费率,则

如果转入基金的前端申购费率最高档比转出基金的前端申购费率最高档高,则收取的申购费用为转入基金适用的固定费用;反之,则不收取申购费用。

b、若转出基金申购费用适用固定费用,则

收取的申购费用=转入基金申购费用-转出基金申购费用,最低为0。

第二、不收取申购费用的基金转入前端收费基金

目前,本公司不收取申购费用的基金包括华夏现金增利货币、华夏债券C、华夏希望债券C。

不收取申购费用的基金转入前端收费基金,按转换金额所对应转入基金的不同费率档,收取优惠的申购费,公式如下:

A.转入基金申购费用适用比例费率时

收取的申购费率=转入基金的申购费率-转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。

B.转入基金申购费用适用固定费用时

收取的申购费用=固定费用-转换金额×转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。

②转入后端收费基金时

第一、前端或后端收费基金转入后端收费基金

同一基金的不同收费模式之间不能互相转换。华夏债券A/B转入其他后端收费基金时,已持有期视为5年;华夏希望债券A转入后端收费基金时,已持有期视为5年;其余前端或后端收费基金转入后端收费基金时,已持有期视为8年。

第二、不收取申购费用的基金转入后端收费基金

转入基金的已持有期从买入转出基金相应份额的时间开始计算。

③转入不收取申购费用的基金时,不收取申购费用。

④对于多笔不收取申购费用的基金份额转出情况的补充说明

上述为处理申(入)赎时间不同的多笔基金份额转出的情况,对转出不收取申购费用的基金的持有时间规定如下:

A.对于华夏现金增利货币、华夏债券C,每当有基金新增份额时,均调整持有时间,计算方法如下:

调整后的持有时间=原持有时间×原份额/(原份额+新增份额)

B.对于华夏希望债券C,其持有时间为本次转出委托中多笔份额的加权平均持有时间。

⑤上述费用另有优惠的,从其规定。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整基金转换的有关业务规则。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏回报证券投资基金招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他法律法规的要求,对本基金管理人于2009年4月18日刊登的本基金招募说明书(更新)进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了"三、基金管理人"的"主要人员情况"等。

(二)更新了"五、相关服务机构"的销售机构等相关信息。

(三)更新了"八、基金份额的申购、赎回与转换"相关信息。

(四)更新了"十、基金的投资"中基金的投资组合报告部分。

(五)更新了"十一、基金的业绩",该部分内容按有关规定编制,并经托管行复核。

(六)更新了"十三、基金资产的估值"相关内容。

(七)更新了"二十二、对基金份额持有人的服务"中有关服务提供信息。

(八)更新了"二十三、其他应披露事项",披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二○○九年十月二十日

证券代码:000516　　证券简称:开元控股　　公告编号:2009-046

西安开元控股集团股份有限公司2009年度配股发行结果公告

保荐人(主承销商)

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]720号文核准,西安开元控股集团股份有限公司(以下简称"公司"、"发行人"或"开元控股")向截至2009年10月9日下午深圳证券交易所收市后,在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的开元控股全体股东(总股本296,311,044股),按照每10股配3股的比例配售。本次配股网上、网下认购缴款工作已于2009年10月16日结束。现将发行结果公告如下:

一、认购情况

本次配股共计可配售股份总数为88,893,313股人民币普通股(A股),其中,无限售条件股股东可配66,732,804股;有限售条件股股东可配22,160,509股。

经深圳证券交易所交易系统主机统计,并经中国证券登记结算公司深圳分公司提供的网上认购数据验证;经保荐人(主承销商)清算统计,并经西安希格玛有限责任会计师事务所(已更名为:希格玛会计师事务所有限公司)对网下认购数据验证,本次配股公开发行认购情况如下:

类别	无限售条件股股东认购	占可配售股份总数比例(%)	有限售条件股股东认购	占可配售股份总数比例(%)	股东认购合计	占可配售股份总数比例合计(%)
有效认购股份	60,764,939	68.36	18,408,081	20.71	79,173,020	89.07
有效认购资金总额(元)	241,844,457.22	--	73,264,162.38	--	315,108,619.60	--

二、发行结果

根据本次配股发行公告,本次公司配股共计可配售股份总数为88,893,313股人民币普通股(A股);其中,无限售条件股股东采取网上定价发行的方式,通过深圳证券交易所交易系统进行,可配售66,732,804股;有限售条件股股东采取网下定价发行的发行方式进行,由保荐人(主承销商)第一创业证券有限责任公司负责组织实施,可配售22,160,509股。本次公司原股东按照3.98元/股的价格,以每10股配售3股的比例参与配售,不足1股的部分按照《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司上市公司权益分派及配股登记业务运作指引》中的零碎股处理办法处理。

最终的发行结果如下:

1、向无限售条件股股东配售结果

截至股权登记日(2009年10月9日)收市,公司无限售条件股股东持股总量为222,442,680股,截至认购缴款结束日有效认购数量为60,764,939股,占本次可配股份总数(88,893,313股)的68.36%,认购金额为241,844,457.22元。

2、向有限售条件股股东配售结果

截至股权登记日(2009年10月9日)收市,公司有限售条件股股东持股总量为73,868,364股,截至认购缴款结束日有效认购数量为18,408,081股,占本次可配股份总数(88,893,313)的20.71%,认购金额为73,264,162.38元。

参与配售的有限售条件股股东名称、认购的股份数量及认购款金额明细如下:

序号	有限售条件股股东名称	实际配售数量(股)	占可配股份总数比例(%)	认购金额(元)
1	西安高新医院有限公司	18,077,400	20.336	71,948,052.00
2	西安彩虹电器工业有限责任公司	326,700	0.368	1,300,266.00
3	贾小英	3,981	0.004	15,844.38
合计		18,408,081	20.708	73,264,162.38

3、截至认购缴款结束日,公司第一大股东西安高新医院有限公司履行了认配股份的承诺,全额现金认购可配股份18,077,400股,占本次可配股份总数(88,893,313股)的20.34%。

4、公司本次配股网上、网下认购配股数量合计为79,173,020股,占本次可配股份总数(88,893,313股)的89.07%,超过了中国证监会《上市公司证