（上接D111版）

本基金本报告期末未持有权证。

（八）股票组合报告附注

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。

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.其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,438,532.69
2	应收证券清算款	35,239,056.22
3	应收股利	-
4	应收利息	41,613,934.76
5	应收申购款	7,165,339.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,456,863.49

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	125731	美丰转债	9,606,151.80	0.08
2	110009	双良转债	6,386.00	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%

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用种类

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约规定，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、销售手续费等交易费用。

①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，按照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。

②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+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)	1.5%	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
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认购费，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×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：假定某投资者在交易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)	10,000.00	10,000.00	10,000.00
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)	10,000.00	10,000.00	10,000.00
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)	1.8%	1.5%	1.2%
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

③T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.基金的费用

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，除收取赎回费外，还需收取赎回时应收的后端申购费。转换金额指扣除赎回费与后端申购费（若有）后的金额。

③转入基金费用：转入基金申购费用根据适用的转换费形收取，详细如下：

①从前端（收费率 双费基金转出），转入其他前端（收费率 双费基金

情形描述：投资者将其持有的某一前端收费基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转出基金和转入基金的申购费率均适用比例费率。

费用收取方式：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。

业务举例：详见“5.业务举例”中例十二。

②从前端（收费率 双费基金转出），转入其他前端（固定费用 双费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用比例费率。

费用收取方式：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。

业务举例：详见“5.业务举例”中例十三。

从不收取申购费用基金转出，转入其他前端（固定费用 双费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他前端收费基金基金份额，且转入基金申购费率适用固定费用。

费用收取方式：收取的申购费用=转入基金的申购费用-转出基金申购费用，最低为0。

业务举例：详见“5.业务举例”中例十四。

从不收取申购费用基金转出，转入其他后端收费基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他后端收费基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用基金转入其他后端收费基金时，转入的基金份额的持有期将自转入的基金份额被确认之日起重新开始计算。

业务举例：详见“5.业务举例”中例十五。

从不收取申购费用基金转出，转入其他不收取申购费用基金

情形描述：投资者将其持有的某一不收取申购费用基金的基金份额转换为本公司管理的其他不收取申购费用的基金基金份额。

费用收取方式：不收取申购费用。

业务举例：详见“5.业务举例”中例十六。

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（认/购/赎）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：

①对于华夏债券（C类）、华夏现金增利货币、中信现金优势货币，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)

②对于中信稳定双利债券、华夏希望债券（C类），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。

③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。

5.业务举例

例一：假定投资者在T日转出1,000份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为1.200元。甲基金前端申购费率最高档为1.5%，赎回费率为0.5%。

①若T日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为2.0%，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
转换金额(F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率(G)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额(H=F/(1+G))	1,188.06
转入基金费用(I=F-H)	5.94
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=H/J)	913.89

②若T日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为1.2%，该日丙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
转换金额(F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率(G)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额(H=F/(1+G))	1,188.06
转入基金费用(I=F-H)	5.94
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=H/J)	913.89

②若T日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为1.2%，该日丙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.00
转换金额(F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率(G)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额(H=F/(1+G))	1,188.06
转入基金费用(I=F-H)	5.94
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=H/J)	913.89

例六：假定投资者在T日转出10,000,000份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为1.200元。甲基金赎回费率为0.5%。

①若T日转入乙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为500元，乙基金适用的申购费用为1,000元，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
转换金额(F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用(G)	1,000-500=500.00
净转入金额(H=F-G)	11,939,500.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.300
转入基金份额(J=H/I)	9,184,230.77

②若T日转入丙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为1,000元，丙基金适用的申购费用为500元，该日丙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
转换金额(F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用(G)	0.00
净转入金额(H=F-G)	11,940,000.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.300
转入基金份额(J=H/I)	9,184,615.38

例七：假定投资者在2010年3月15日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲10,000,000份，转入后端收费基金乙，甲基金申购费率适用固定费用，该日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.500元。2010年3月16日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000.00
转换金额(F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用(G)	0.00
净转入金额(H=F-G)	11,940,000.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.300
转入基金份额(J=H/I)	9,184,615.38

例八：假定投资者在T日转出前端收费基金甲10,000,000份，转入不收取申购费用基金乙，甲基金申购费率适用固定费用，T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.300、1.500元。甲基金赎回费率为0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.300
转出总金额(C=A*B)	13,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	65,000.00
转换金额(F=C-E)	12,935,000.00
转入基金费用(G)	0.00
净转入金额(H=F-G)	12,935,000.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.500
转入基金份额(J=H/I)	8,623,333.33

例九：假定投资者在T日转出1,000份持有期为半年的甲基金基金份额（后端收费模式），转出时适用甲基金后端申购费率为1.8%，该日甲基金基金份额净值为1.200元。甲基金前端申购费率最高档为1.5%，赎回费率为0.5%。申购日甲基金基金份额净值为1.100元。

①若T日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为2.0%，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值(F)	1.100
适用后端申购费率(G)	1.8%
后端申购费(H=AxFxG/(1+G))	19.45
转出基金费用(I=E+H)	25.45
转换金额(J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率(K)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额(L=J/(1+K))	1,168.71
转入基金费用(M=J-L)	5.84
转入基金T日基金份额净值(N)	1.300
转入基金份额(O=L/N)	899.01

②若T日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为1.2%，该日丙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值(F)	1.100
适用后端申购费率(G)	1.8%
后端申购费(H=AxFxG/(1+G))	19.45
转出基金费用(I=E+H)	25.45
转换金额(J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率(K)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额(L=J/(1+K))	1,168.71
转入基金费用(M=J-L)	5.84
转入基金T日基金份额净值(N)	1.300
转入基金份额(O=L/N)	899.01

例十：假定投资者在T日转出10,000,000份持有期为半年的甲基金基金份额（后端收费模式），转出时适用甲基金后端申购费率为1.8%，该日甲基金基金份额净值为1.200元。甲基金前端申购费率最高档为1.5%，赎回费率为0.5%。申购日甲基金基金份额净值为1.100元。

①若T日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为1,000元，乙基金前端申购费率最高档为2.0%，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	60,000.00
转换金额(F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用(G)	1,000
净转入金额(H=F-G)	11,939,000.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.300
转入基金份额(J=H/I)	9,183,846.15

②若T日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为1,000元，丙基金前端申购费率最高档为1.2%，该日丙基金基金份额净值为1.300元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	60,000.00
转换金额(F=C-E)	11,940,000.00
转入时收取申购费率(G)	1.5%-1.2%=0.3%
净转入金额(H=F/(1+G))	11,904,287.14
转入基金费用(I=F-H)	35,712.86
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=H/J)	9,157,143.95

例十一：假定投资者在2010年3月15日成功提交了基金转换申请，转出持有期为3年的后端收费基金甲1,000份，转入后端收费基金乙，转出时适用甲基金后端申购费率为1.0%，该日甲、乙基金基金份额净值分别为1.300、1.500元。2010年3月16日这笔转换确认成功。申购当日甲基金基金份额净值为1.100元，适用赎回费率为0.5%。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.300
转出总金额(C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	6.50
申购日转出基金基金份额净值(F)	1.100
适用后端申购费率(G)	1.0%
后端申购费(H=AxFxG/(1+G))	10.89
转出基金费用(I=E+H)	17.39
转换金额(J=C-I)	1,282.61
转入基金费用(K)	0.00
净转入金额(L=J-K)	1,282.61
转入基金T日基金份额净值(M)	1.500
转入基金份额(N=L/M)	855.07

若投资者在2012年9月15日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为2年半，适用后端申购费率为1.2%，且乙基金赎回费率为0.5%，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额(O)	855.07
赎回日基金份额净值(P)	1.300
赎回总金额(Q=O*P)	1,111.59
赎回费率(R)	0.5%
赎回费(S=Q*R)	5.56
适用后端申购费率(T)	1.2%
后端申购费(U=O*M*T/(1+T))	15.21
赎回金额(V=Q-S-U)	1,090.82

例十二：假定投资者在T日转出持有期为3年的后端收费基金甲1,000份，转入不收取申购费用基金乙，T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.500元。申购当日甲基金基金份额净值为1.100元，赎回费率为0.5%，转出时适用甲基金后端申购费率为1.0%。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率(D)	0.5%
赎回费(E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值(F)	1.100
适用后端申购费率(G)	1.0%
后端申购费(H=AxFxG/(1+G))	10.89
转出基金费用(I=E+H)	16.89
转换金额(J=C-I)	1,183.11
转入基金费用(K)	0.00
净转入金额(L=J-K)	1,183.11
转入基金T日基金份额净值(M)	1.500
转入基金份额(N=L/M)	788.74

例十三：假定投资者在T日转出持有期为146天的不收取申购费用基金甲1,000份，转入前端收费基金乙，T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.300元。甲基金销售服务费率为0.3%，不收取赎回费。乙基金适用申购费率为2.0%。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金费用(D)	0.00
转换金额(E=C-D)	1,200.00
销售服务费率(F)	0.3%
转入基金申购费率(G)	2.0%
收取的申购费率(H=G-F*转出基金的持有时间(单位为年))	1.88%
净转入金额(I=E/(1+H))	1,177.86
转入基金费用(J=E-I)	22.14
转入基金T日基金份额净值(K)	1.300
转入基金份额(L=I/K)	906.05

例十四：假定投资者在T日转出持有期为5天的不收取申购费用基金甲10,000,000份，转入前端收费基金乙，T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.300元。甲基金销售服务费率为0.3%，不收取赎回费。乙基金适用固定申购费500元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000.00
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000.00
转出基金费用(D)	0.00
转换金额(E=C-D)	12,000,000.00
销售服务费率(F)	0.3%
转入基金申购费(G)	500
转入基金费用(H=G-E*F*转出基金的持有时间(单位为年))	6.85
净转入金额(I=E-H)	11,999,993.15
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=I/J)	9,230,763.96

例十五：假定投资者在2010年3月15日成功提交了基金转换申请，转出持有的不收取申购费用基金甲1,000份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.500元。2010年3月16日这笔转换确认成功。甲基金不收取赎回费。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.00
转出基金费用(D)	0.00
转换金额(E=C-D)	1,200.00
转入基金费用(F)	0.00
净转入金额(G=E-F)	1,200.00
转入基金T日基金份额净值(H)	1.500
转入基金份额(I=G/H)	800.00

若投资者在2013年9月15日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为3年半，适用后端申购费率为1.0%，且乙基金赎回费率为0.5%，该日乙基金基金份额净值为1.300元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额(J)	800.00
赎回日基金份额净值(K)	1.300
赎回总金额(L=J*K)	1,040.00
赎回费率(M)	0.5%
赎回费(N=L*M)	5.20
适用后端申购费率(O)	1.0%
后端申购费(P=J*H*O/(1+O))	11.88
赎回金额(Q=L-N-P)	1,022.92

例十六：假定投资者在T日转出不收取申购费用基金甲1,000份，转入不收取申购费用基金乙。T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.300、1.500元。甲基金赎回费率为0.1%。则转出基金费用、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
转出基金T日基金份额净值(B)	1.300
转出总金额(C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率(D)	0.1%
转出基金费用(E=C*D)	1.30
转换金额(F=C-E)	1,298.70
转入基金费用(F)	0.00
净转入金额(G=E-F)	1,298.70
转入基金T日基金份额净值(H)	1.500
转入基金份额(I=G/H)	865.80

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（更新）（以下简称“本招募说明书”）根据《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第20号——招募说明书的内容与格式》及其他法律法规的要求，对本基金管理人于2010年10月20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”相关信息。

（二）更新了“四、基金托管人”相关信息。

（三）更新了“五、相关服务机构”相关信息。

（四）更新了“八、基金份额的申购、赎回与转换”相关信息。

（五）更新了“十、基金的投资”中投资组合报告，该部分内容均按有关规定编制。

（六）更新了“十一、基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

（七）更新了“二十二、对基金份额持有人的服务”相关信息。

（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

二〇一一年四月十九日

证券简称：*ST华控　证券代码：000607　公告编号：2011-14

重庆华智控股股份有限公司关于向华立集团股份有限公司及子公司融资的关联交易公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

重要内容提示：

●本次交易内容：在《关于授权公司向华立集团股份有限公司及子公司融资的议案》生效后12个月内，授权公司向公司控股股东华立集团股份有限公司及其下属子公司借款，借款额度不超过人民币1亿元，借款利息不超过年利率8%。具体借款金额和借款利息由借款发生时签订的协议约定。

●本次交易属关联交易，公司董事会在审议该议案时关联董事刘浩军、蔡晓利进行了回避表决。

●本次交易对上市公司持续经营能力、损益及资产状况无实质性影响。

一、关联交易概述

由于公司2010年度继续亏损，公司目前资金尚不宽裕，且公司的后续发展还需进行投入，为有效应对可能出现的资金紧张的局面，建议董事会授权公司在本议案生效后12个月内，向公司控股股东华立集团股份有限公司及其下属子公司进行借款，借款额度不超过人民币1亿元，借款利息不超过年利率8%。该利率水平参考了本地实际资金使用成本，能为公司节约财务成本。具体借款金额和借款利息由借款发生时签订的协议约定。

由于华立集团股份有限公司为公司控股股东，根据《深圳证券交易所股票上市规则》的相关规定，公司对其借款行为构成关联交易。

公司董事会已于2011年4月13日召开了六届十七次董事会，对上述议案进行了审议。两位关联董事刘浩军、蔡晓利进行了回避表决，经公司其余五位董事认真审议通过了《关于授权公司向华立集团股份有限公司及子公司融资的议案》。本次关联交易需提交公司2010年年度股东大会审议，通过后方可实施。

二、关联方介绍和关联关系

1、关联方基本情况

公司名称：华立集团股份有限公司

住所：浙江省杭州市余杭镇直街181号

法人代表：肖琪经

注册资本：30,338万元人民币

经营范围：实业投资，国内和国际贸易，技术服务，管理咨询，设备租赁，燃料油（不含成品油）的销售。

截止2010年12月31日的主要财务指标（以下数据均未经审计）