(上接D29版)

联系人:周璐
网址:www.pingan.com
客户服务电话:400-881-6168

63 华安证券有限责任公司
住所:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座
法定代表人:李工
电话:0551-5161821
传真:0551-5161672
联系人:甘霖
网址:www.hazq.com
客户服务电话:0551-96518、400-809-6518

64 国海证券有限责任公司
住所:广西南宁市滨湖路46号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
电话:0771-5539262
传真:0771-5539033
联系人:覃清芳
网址:www.ghzq.com.cn
客户服务电话:全国:400-888-8100、广西:96100

65 财富证券有限责任公司
住所:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人:周晖
客户服务电话:0731-4403319
传真:0731-4403349
联系人:郭磊
网址:www.cfzq.com

66 东莞证券有限责任公司
住所:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:游锦辉
电话:0769-22119426、0769-22119351
传真:0769-22119423
联系人:张建平、罗绍辉
网址:www.dgzq.com.cn
客户服务电话:0769-961130

67 中原证券股份有限公司
住所:郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦
办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸11楼
法定代表人:石保上
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
联系人:程月艳、耿铭
网址:www.ccnew.com
客户服务电话:967218、400-813-9666

68 招都证券有限责任公司
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、10层
法定代表人:常喆
电话:010-84183389
传真:010-84183311-3389
联系人:黄静
网址:www.guodu.com
客户服务电话:400-818-8118

69 东海证券有限责任公司
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
法定代表人:朱利敏
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
联系人:李涛
网址:www.longone.com.cn
客户服务电话:021-52574550.0519-88166222.0379-64902266.400-888-8588

60 恒泰证券有限责任公司
住所:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:刘汝军
电话:021-68405273
传真:021-68405181
联系人:张同纪
网址:www.cnht.com.cn
客户服务电话:0471-4961259

61 国盛证券有限责任公司
住所:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
客户服务电话:0791-6285337
传真:0791-6288690
联系人:徐美云
网址:www.gsstock.com

62 宏源证券股份有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
电话:010-88085201
传真:010-88085195
联系人:李巍
网址:www.hysec.com
客户服务电话:400-800-0562

63 齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经十路128号
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:0531-81283906
传真:0531-81283900
联系人:吴阳
网址:www.qlzq.com.cn
客户服务电话:95538

64 世纪证券有限责任公司
住所:深圳市深南大道7088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:卢长才
客户服务电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
联系人:刘军辉
网址:www.esco.com.cn

65 万一创业证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
电话:0755-25832494
传真:0755-25831718
联系人:王立洲
网址:www.fcsc.cn
客户服务电话:0755-25832523

66 渝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:深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025666
传真:0755-83025625
联系人:金春
网址:www.jyzq.cn
客户服务电话:400-888-8228

67 中航证券有限公司
住所:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
联系人:余雅娜
网址:www.avicsec.com
客户服务电话:400-886-6567

68 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:骆玲
网址:www.chinalions.com
客户服务电话:各地营业部客户服务电话

69 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

70 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:陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼
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:029-95582

71 广发华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
联系人:张腾
网址:www.gdhzq.com.cn
客户服务电话:0591-96326

72 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

73 中国国际金融有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:李剑阳
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:罗春蓉
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166

74 财通证券有限责任公司
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:0571-87828042
联系人:乔骏
网址:www.ctsec.com
客户服务电话:0571-96336

75 中国银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:杨小弭
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

76 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
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世红
网址:www.jhzq.com.cn
客服电话:400-666-2288

77 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B座6层-9层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B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
客户服务电话:400-889-5618

基金管理人可依据有关法律法规规定及情况变化增加或者减少代销机构,并及时公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。

(二)其他登记机构
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:范勇宏
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
联系人:张金锋
(三)律师事务所
名称:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人:王丽
联系电话:010-52682888
传真:010-52682999
联系人:李娜
经办律师:李志宏、李娜
(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:华夏收入股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标:本基金在严格执行投资风险管理的前提下,主要投资于盈利增长稳定的红利股,追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的公司股票、债券、资产支持证券、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,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

(一)决策依据
1、国家有关法律、法规和基金合同的规定。
2、宏观经济环境、国家政策和市场周期分析。
3、上市公司财务品质和管理能力、分红历史、分红价值、分红意愿和分红预期,以及对公司盈利增长能力的预测。
(二)投资管理办法
1、资产配置策略
本基金遵循积极主动的投资理念,以红利股为主要投资对象,通过自下而上的方法精选个股获得股息收入和资本的长期增值。以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。基金的波动范围限制为股票60%-95%、债券0%-35%、短期金融工具5%-40%,资产支持证券0-20%、权证0-3%。具体配置比例由基金管理人根据对市场走势的判断做主动调整,以求基金资产在三类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

本基金不作主动的行业资产配置,为控制个别行业投资过于集中的风险,基金管理人根据业绩比较基准作相应的行业配置。
2、股票投资策略
本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,通过品质检验、红利股筛选和盈利增长预测三个立体选股流程,精选出兼具良好财务品质、稳定分红能力、高股息和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象,这类股票占全部股票市值的比例不低于80%。
(1)品质检验
剔除风险股、庄股和流动性差的股票,对上市公司进行定期量化筛选,通过体系内表征企业盈利能力、财务健康状况、资产管理运作效率和企业成长性四类13个量化指标筛选出在财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司,构成本基金初选股票库。

(2)红利股筛选
在初选股票库基础上,我们综合考察上市公司历史分红政策,分红价值,分红意愿和分红预期等特征来确定本基金备选股票库。具体选股标准包括满足以下一项或多项特征的股票:A具有稳定的分红历史:过去两年内连续分红,其中分红包括现金股利和股票股利。B具有较好的分红价值:最近一年股息率(每股现金分红/最近1年内经复权调整的股价)市场排名进入前30%。C具有较强的分红意愿:最近一年度股利分配率(分红除以前一年度税后净利润)市场排名进入前30%。D具有很好的分红预期:将会推出较优厚分红方案。

本基金同时对具有投资价值的新股进行申购。
(3)盈利增长预测
在备选股票库的基础上,通过实地调研考察上市公司,精选盈利增长稳定的个股。重点考量上市公司是否具备精英管理团队、出众的竞争优势、较好的盈利增长前景等特征条件,综合研究团队对这些企业未来盈利增长驱动因素的研究判断,建立本基金的核心股票池。
3、债券投资策略
债券投资管理的目标是在保持投资组合稳定收益和充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。债券投资组合的构建将通过全面的宏观、市场和品种的研究分析,在各种定量辅助手段的支持下综合运用利率预测、价值评估、利率期限结构分析等投资策略,积极主动地预期市场变化,寻找各种市场机会,获得超过市场水平的平均收益。
4、短期金融工具投资策略
在控制风险的前提下,通过对政策调控和资金面的精确把握,结合股票和债券资产的动态配置,并充分考虑基金资产的流动性要求,获得短期金融工具的稳定收益同时,为基金的动态资产配置提供有效的线索,结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行短期货币工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。
5、权证投资策略
在有效进行风险管理的前提下,通过对权证标的证券的基本面研究,结合多种期权定价模型,在确定权证合理价值的基础上,以主动投资为主,结合资产和组合特性,谨慎进行权证投资。

主要投资策略包括但不限于:①在标的证券价值和趋势判断的基础上,利用权证的杠杆性进行趋势投资;②利用权证的损失有限性,运用权证作为组合管理工具;③运用权证组合技术,构建新的投资回报模式。

九、基金的业绩比较基准

80%富时中国A股红利150指数+20%富时中国国债指数
将来如有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只股票型基金,遵循积极主动的投资理念,以盈利增长稳定的高股息和连续分红股票类资产为主要投资工具,在股票型证券投资基金中属于中等风险的基金产品。本基金力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的中长期稳定增值。

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。

基金托管人中国建设银行根据基金合同规定,于2011年4月19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2011年3月31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	3,209,429,314.31	78.45
	其中:股票	3,209,429,314.31	78.45
2	固定收益投资	236,703,000.00	5.79
	其中:债券	236,703,000.00	5.79
	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	626,763,305.04	15.32
6	其他各项资产	18,150,176.93	0.44
7	合计	4,091,045,796.28	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	-	-
B	采掘业	94,433,358.84	2.36
C	制造业	1,445,622,354.15	36.17
C0	食品、饮料	258,402,928.64	6.47
C1	纺织、服装、皮毛	43,378,873.80	1.09
C2	木材、家具	46,839,491.29	1.17
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	55,596,424.00	1.39
C5	电子	137,134,757.62	3.43
C6	金属、非金属	156,303,366.24	3.91
C7	机械、设备、仪表	681,591,439.97	17.05
C8	医药、生物制品	66,375,072.59	1.66
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,885,893.12	0.87
E	建筑业	25,599,148.50	0.64
F	交通运输、仓储业	27,022,955.28	0.68
G	信息技术业	265,664,307.36	6.65
H	批发和零售贸易	248,297,131.92	6.21
I	金融、保险业	730,208,502.25	18.27
J	房地产业	183,206,515.10	4.58
K	社会服务业	62,709,432.74	1.57
L	传播与文化产业	32,229,988.01	0.81
M	综合类	59,549,727.04	1.49
	合计	3,209,429,314.31	80.30

(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	600036	招商银行	14,499,996	204,304,943.64	5.11
2	600519	贵州茅台	679,139	122,143,149.15	3.06
3	600016	民生银行	19,999,918	111,799,541.62	2.80
4	601009	南京银行	9,681,614	107,175,466.98	2.68
5	600741	华域汽车	7,442,409	95,337,259.29	2.39
6	600582	天地科技	3,931,633	94,201,926.68	2.36
7	000063	中兴通讯	3,002,738	90,082,140.00	2.25
8	600739	辽宁成大	2,849,826	87,774,640.80	2.20
9	601166	兴业银行	2,999,932	86,128,047.72	2.15
10	000527	美的电器	4,441,668	83,236,858.32	2.08

(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	49,960,000.00	1.25
2	央行票据	176,700,000.00	4.42
3	金融债券	10,043,000.00	0.25
	其中:政策性金融债	10,043,000.00	0.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	236,703,000.00	5.92

(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	1001056	10央行票据56	1,500,000	146,610,000.00	3.67
2	019021	10国债21	500,000	49,960,000.00	1.25
3	0801062	08央行票据62	300,000	30,090,000.00	0.75
4	080303	08进出03	100,000	10,043,000.00	0.25
5	-	-	-	-	-

(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,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、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,550,356.31
2	应收证券清算款	11,221,342.55
3	应收股利	-
4	应收利息	4,265,503.22
5	应收申购款	112,974.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,150,176.93

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600741	华域汽车	95,337,259.29	2.39	筹划重大资产重组事项

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资产,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	基金净值增长率①	基金净值增长率标准差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
2005年11月17日至2005年12月31日	0.52%	0.03%	5.79%	0.67%	-5.27%	-0.64%
2006年1月1日至2006年12月31日	139.55%	1.32%	70.55%	1.17%	69.00%	0.15%
2007年1月1日至2007年12月31日	146.38%	1.97%	150.76%	2.14%	-4.38%	-0.17%
2008年1月1日至2008年12月31日	-43.27%	1.93%	-52.67%	2.56%	9.40%	-0.63%
2009年1月1日至2009年12月31日	78.76%	1.64%	84.16%	1.85%	-5.40%	-0.21%
2010年1月1日至2010年12月31日	-6.83%	1.29%	-3.02%	1.24%	-3.81%	0.05%
2011年1月1日至2011年3月31日	3.34%	1.11%	3.57%	1.09%	-0.23%	0.02%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用
与基金运作有关的费用包括:基金管理人的管理费;基金托管人的托管费;基金财产拨划支付的银行费用;基金合同生效后的基金信息披露费用;基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;基金份额持有人大会费用;基金的证券交易费用;以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
1、基金管理费
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×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%
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,支付日期顺延。
2、基金托管费
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×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%
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,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,支付日期顺延。
(二)与基金销售有关的费用
1、申购费与赎回费
(1)本基金的申购费率按申购金额递减。投资人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)	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上(含100万元)-200万元以下	1.2%
200万元以上(含200万元)-500万元以下	0.8%
500万元以上(含500万元)	每笔500元

(2)本基金赎回费率不超过赎回金额的0.5%,赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

持有期限	一年以内	满一年(含)不满二年	满二年(含)不满三年	三年(含)以上
赎回费率	0.5%	0.35%	0.2%	0

(3)本基金的申购费用由基金申购人承担,归基金管理人及代销机构所有,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担,赎回费将按照赎回当时适用的费率收取,所收取赎回费的25%归入基金资产,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

(4)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式,并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。

(5)基金管理人可以在不违背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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式(如网上交易等)等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、赎回费率。
2、申购份额与赎回金额的计算方式
(1)基金申购份额的计算
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
(注:申购费用为固定金额时,净申购金额=申购金额-申购费用)
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
例一:假定T日的基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100万元、200万元,则各笔申购负担的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	2,000,000.00
适用申购费率(R)	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额(S=A/(1+R))	985.22	988,142.29	1,984,126.98
申购费用(H=A-S)	14.78	11,857.71	15,873.02
申购份额(E=S/1.200)	821.02	823,451.91	1,653,439.15

若申购金额为500万元,则申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购4
申购金额(元,A)	5,000,000.00
申购费用(R)	500.00
净申购金额(S=A-R)	4,999,500.00
申购份额(E=S/1.200)	4,166,250.00

(2)基金赎回金额的计算
本基金的赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中,
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
例二:假定T日的基金份额净值为1.250元,投资者分别赎回本基金1,000份、10,000份、10万份和100万份,持有期分别为6个月、1年、2年和3年,则其获得的赎回金额计算如下:

	赎回1	赎回2	赎回3	赎回4
赎回份额(A)	1,000.00	10,000.00	100,000.00	1,000,000.00
赎回总金额(元,B=A*1.250)	1,250.00	12,500.00	125,000.00	1,250,000.00
适用赎回费率(C)	0.5%	0.35%	0.2%	0
赎回费用(D=B*C)	6.25	43.75	250.00	0
赎回金额(E=B-D)	1,243.75	12,456.25	124,750.00	1,250,000.00

(3)基金份额资产净值的计算公式
T日基金份额资产净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量
T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。
(4)申购份额余额的处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。
(5)赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。
(6)本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的误差在基金财产中列支。
3、基金转换费用
(1)基金转换费:无。
(2)赎出基金费用: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)后的余额。
(3)转入基金费用:转入基金申购费用根据适用的转换情形收取,详细如下:
①从前端(比例费率)收费基金转出,转入其他前端(比例费率)收费基金
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=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的前端申购费率最高档,最低为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例一。
②从前端(比例费率)收费基金转出,转入其他前端(固定费用)收费基金
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,且转出基金申购费率适用比例费率,转入基金申购费率适用固定费用。
费用收取方式: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,收取的申购费用为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例二。
③从前端(比例费率)收费基金转出,转入其他后端收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一前端收费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,且转出基金申购费率适用比例费率。
费用收取方式:前端收费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"中例三。
④从前端(比例费率)收费基金转出,转入其他不收取申购费用的基金
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不收取申购费用的基金基金份额,且转出基金申购费率适用比例费率。
费用收取方式:不收取申购费用。
业务举例:详见"5.业务举例"中例四。
⑤从前端(固定费用)收费基金转出,转入其他前端(比例费率)收费基金
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,且转出基金申购费率适用固定费用,转入基金申购费率适用比例费率。
费用收取方式:收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的前端申购费率最高档,最低为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例五。
⑥从前端(固定费用)收费基金转出,转入其他后端收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一前端收费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,且转出基金申购费率适用固定费用。
费用收取方式:前端收费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"中例六。
⑦从前端(固定费用)收费基金转出,转入其他不收取申购费用的基金
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不收取申购费用的基金基金份额,且转出基金申购费率适用固定费用。
费用收取方式:不收取申购费用。
业务举例:详见"5.业务举例"中例七。
⑧从后端(比例费率)收费基金转出,转入其他前端(比例费率)收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一后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:收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的前端申购费率最高档,最低为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例八。
⑨从后端(比例费率)收费基金转出,转入其他后端(比例费率)收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一后端收费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,且转入基金申购费率适用比例费率。
费用收取方式:收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的前端申购费率最高档,最低为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例九。
⑩从后端(固定费用)收费基金转出,转入其他前端(固定费用)收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一后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,且转入基金申购费率适用固定费用。
费用收取方式: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,收取的申购费用为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例十。
⑪从后端收费基金转出,转入其他后端收费基金
情形描述:投资者将其持有的某一后端收费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:后端收费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"中例十一。
⑫从后端收费基金转出,转入其他不收取申购费用的基金
情形描述:投资者将其持有的某一后端收费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"中例十二。
⑬从不收取申购费用基金转出,转入其他前端(比例费率)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:收取的申购费率=转入基金的前端申购费率最高档-转出基金的销售服务费率×转出基金的持有时间(单位:年),最低为0。
业务举例:详见"5.业务举例"中例十三。
⑭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。
业务举例:详见"5.业务举例"中例十四。
⑮从不收取申购费用基金转出,转入其他不收取申购费用的基金
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"中例十五。
⑯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)购时同一天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。
(4)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)	1,000.000
转出基金T日基金份额净值(B)	1.200
转出总金额(C=A*B)	1,200.000
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