

【注册D36版】
69 瑞信(上海)证券有限公司
 住所: 上海市南京西路 2 号富华大厦十七楼
 办公地址: 上海市南京西路 2 号富华大厦十七楼法定代表人: 李博熙
 电话: (0952) 5161642, 15880281470
 联系人: 尹文文
 网址: www.ruixin.com.cn
70 华夏基金管理有限公司
 住所: 上海市南京西路 788 号 23 楼
 办公地址: 上海市南京西路 758 号 20-25 楼
 法定代表人: 李伟
 电话: (021) 33229888
 传真: (021) 62787873
 联系人: 李伟
 网址: www.hxam.com.cn
71 上海证券期货交易所
 住所: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 法定代表人: 于力
 电话: (010) 58568007
 联系人: 于力
 网址: www.sse.com.cn
72 上海证券期货交易所
 住所: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 法定代表人: 于力
 电话: (010) 58568007
 联系人: 于力
 网址: www.sse.com.cn
73 上海证券期货交易所
 住所: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 529 号
 法定代表人: 于力
 电话: (010) 58568007
 联系人: 于力
 网址: www.sse.com.cn

1. 报告期内, 本基金投资决策流程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. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或受到公开谴责、处罚的情形。
 3. 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额	单位: 人民币元
1	存出保证金	64,223.05	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收利息	5,778,256.14	-
4	应收利息	5,778,256.14	-
5	应收申购款	-	-
6	其他应收款	4,000.00	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,846,479.19	-

5. 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	占基金资产净值比例 (%)
1	113002	工行转债	231,253,893.00	9.27
2	110015	石化转债	70,756,000.00	2.83

5. 期末前十名股票公允价值受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
6	600256	广汇股份	23,692,053.80	0.95	非公开发行股票受限

本基金管理人依据恪尽职守、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。业绩比较基准并不代表其未来表现, 投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的投资风险提示。
 本基金业绩比较基准不包括任何认购或交易基金的各项费用, 计入费用会导致投资成本高于业绩比较基准。

阶段	净值增长率	标准差	收益率	跟踪误差	β-1	α-1
2008年10月23日至2008年12月31日	3.20%	0.84%	1.21%	1.67%	1.99%	-1.18%
2009年1月1日至2009年12月31日	84.30%	1.43%	47.69%	1.12%	36.70%	0.31%
2010年1月1日至2010年12月31日	29.59%	1.17%	-5.03%	0.87%	34.53%	0.30%
2011年1月1日至2011年12月31日	-14.25%	1.19%	-12.66%	0.72%	-1.59%	0.47%
2012年1月1日至2012年3月31日	1.99%	1.34%	3.08%	0.83%	-1.09%	0.51%

(一) 基金运作费用
 1. 基金费用的种类
 基金运作费用, 从基金财产中支付的费用包括:
 ① 基金管理人的管理费;
 ② 基金托管人的托管费;
 ③ 基金合同生效后的审计费用;
 ④ 基金合同生效后的会计师费和律师费;
 ⑤ 按照国家有关规定确定中证基金业协会认定的其他费用。

2. 基金费用的计提方法、计提标准和支付方式
 ① 基金管理人的管理费: 基金管理费按基金前一日的基金资产净值的 1.5% 年费率计提。
 计算方法如下:
 $H = E \times 1.5\% \div 365$
 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, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
 ② 基金托管人的托管费: 基金托管费按基金前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。
 计算方法如下:
 $H = E \times 0.25\% \div 365$
 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, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

③ 基金合同生效后的审计费用、会计师费和律师费: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的审计费用、会计师费和律师费, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的审计费用、会计师费和律师费划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
 ④ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑤ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑥ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑦ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑧ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑨ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑩ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑪ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑫ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑬ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑭ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑮ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑯ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑰ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑱ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑲ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

⑳ 基金合同生效后的其他费用: 基金管理人应在基金合同中约定基金管理人应承担的其他费用, 并由基金管理人向基金托管人发送基金管理人应承担的其他费用划付指令, 基金托管人复核于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且内基金适用的申购费率最高档为 1.2%, 该日内基金基金份额净值为 1.300 元, 则申购本基金费用、转入基金费用及份额计算如下:

项目	费用计算
申购份额(A)	1,000.00
转出基金份额(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
转出金额(F=C-E)	1,194.00
转入申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/G)	1,194.00
转入基金费用(I=C-H)	1,000.00
转入基金 T 日基金份额净值(J)	1,300
转入基金份额(K=H/J)	918.46

例二: 假设投资者在 T 日转出 10,000.00 份甲基金份额(申购费率模式), 甲基金申购费率适用比例费率, 该日甲基金份额净值为 1.200 元, 甲基金前端的申购费率最高档为 1.5%, 赎回费率为 0.5%。
 (注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且乙基金适用的申购费率为 1.000 元, 乙基金前端的申购费率最高档为 2.0%, 该日乙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	1.0000
净转入金额(H=F/G)	11,939.0000
转入基金费用(I=C-H)	1,300
转入基金份额(J=H/I)	9,183,846.15

(注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且内基金适用的申购费率为 1.000 元, 丙基金前端的申购费率最高档为 2.0%, 该日丙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	0.00
净转入金额(H=F/G)	11,940.0000
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

例三: 假设投资者在 2010 年 3 月 15 日成功进行了基金转换申请, 转出持有的前端收费基金 A 1,000 份, 转入后端收费基金 B, 该日 A 乙基金基金份额净值为 1.200, 1.500, 2010 年 3 月 16 日该笔转换成功, 甲基金适用申购费率为 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
转出基金份额(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
转出金额(F=C-E)	1,194.00
转入基金费用(G)	1,184.00
转入基金份额(H=F/G)	1,500
转入基金份额(I=H/J)	796.00

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金, 则赎回时乙基金持有期为 1 年之内, 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(K)	796.00
赎回基金份额(L)	1,300
赎回总金额(M=K*L)	1,034.80
赎回基金费用(N)	0.00
赎回金额(O=M-N)	1,034.80

例四: 假设投资者在 T 日转出前端收费基金 A 1,000 份, 转入不收取申购费用基金乙, T 日甲、乙基金份额净值分别为 1.300, 1.500, 甲基金前端的申购费率为 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
转出基金份额(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%
转出基金费用(E=C*D)	6.50
转出金额(F=C-E)	1,293.50
净转入金额(G=F)	1,293.50
转入基金份额(H=G/I)	1,500
转入基金份额(I=H/J)	862.33

例五: 假设投资者在 T 日转出 10,000.00 份甲基金份额(申购费率模式), 甲基金申购费率适用比例费率, 该日甲基金份额净值为 1.200 元, 甲基金前端的申购费率最高档为 1.2%, 赎回费率为 0.5%。
 (注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且乙基金适用的申购费率为 1.000 元, 乙基金前端的申购费率最高档为 1.5%, 该日乙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
转入申购费率(G)	1.5%
净转入金额(H=F/G)	11,904,287.14
转入基金费用(I=C-H)	35,712.86
转入基金份额(J=H/I)	1,300
转入基金份额(K=J/L)	9,157,143.95

(注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且丙基金适用的申购费率为 1.0%, 该日丙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/G)	11,940.0000
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

例六: 假设投资者在 T 日转出 10,000.00 份甲基金份额(申购费率模式), 该日甲基金份额净值为 1.200 元, 甲基金前端的申购费率最高档为 1.0%, 该日丙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/G)	11,940.0000
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

(注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 甲基金适用的申购费率为 1.000 元, 丙基金前端的申购费率最高档为 1.5%, 该日乙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/G)	11,940.0000
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

(注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 甲基金适用的申购费率为 1.000 元, 丙基金前端的申购费率为 500 元, 该日丙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/G)	11,940.0000
转入基金 T 日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	7,960.0000

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金, 则赎回时乙基金持有期为 1 年之内, 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(K)	7,960.0000
赎回基金份额(L)	1,300
赎回总金额(M=K*L)	10,348.0000
赎回基金费用(N)	0.00
赎回金额(O=M-N)	10,348.0000

例七: 假设投资者在 2010 年 3 月 15 日成功进行了基金转换申请, 转出持有的不收取申购费用基金 A 1,000 份, 转入后端收费基金 B, 该日 A 乙基金基金份额净值为 1.200, 1.500, 2010 年 3 月 16 日该笔转换成功, 甲基金适用申购费率为 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)	1,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	1,200.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.0000
转出金额(F=C-E)	1,194.0000
净转入金额(G=F)	1,184.0000
转入基金份额(H=G/I)	1,500
转入基金份额(I=H/J)	796.0000

例八: 假设投资者在 T 日转出 10,000.00 份甲基金份额(申购费率模式), 甲基金申购费率适用比例费率, 该日甲基金份额净值为 1.200 元, 甲基金前端的申购费率最高档为 1.5%, 赎回费率为 0.5%。
 (注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且乙基金适用的申购费率为 1.000 元, 乙基金前端的申购费率最高档为 2.0%, 该日乙基金份额净值为 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)	10,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60.0000
转出金额(F=C-E)	11,940.0000
申购费率(G)	1.2%
净转入金额(H=F/G)	11,881.0000
转入基金费用(I=C-H)	8,623,333.33
转入基金份额(J=H/I)	1,300
转入基金份额(K=J/L)	1,298.70

例九: 假设投资者在 T 日转出 1,000 份持有期为半年的甲基金份额(申购费率模式), 转入适用甲基金后端申购费率为 1.8%, 该日甲基金份额净值为 1.200 元, 甲基金前端的申购费率最高档为 1.5%, 赎回费率为 0.5%。申购日甲基金份额净值为 1.100 元。
 (注) 若 T 日转入内基金 申购费率模式, 且乙基金适用的申购费率为 1.000 元, 乙基金前端的申购费率最高档为 2.0%, 该日乙基金份额净值为 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)	1,000.0000
转出基金份额(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	1,200.0000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6.0000
转出金额(F=C-E)	1,194.0000
申购费率(G)	1.8%
净转入金额(H=F/G)	1,174,500.98