（上接B38版）

（105）中山证券有限责任公司
住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人：黄扬录
电话：0755-82570586
传真：0755-82960582
联系人：罗艺琳
网址：www.zszq.com
客户服务电话：400-102-2011
（106）西藏同信证券有限责任公司
住所：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号
法定代表人：贺经君
电话：021-36533016
传真：021-36533017
联系人：王伟光
网址：www.xzsec.com
客户服务电话：400-881-1177
（107）日信证券有限责任公司
住所：呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
电话：010-88086830-730、010-88086830-737
传真：010-66412537
联系人：陈书彩、朱晓光
网址：www.rxzq.com.cn
客户服务电话：010-88086830
（108）联讯证券股份有限公司
住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
电话：0752-2119700
联系人：彭莲
网址：www.lxsec.com
客户服务电话：95564
（109）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：0451-85863719
传真：0451-82287211
联系人：刘爽
网址：www.jhzq.com.cn
客户服务电话：400-666-2288
（110）国金证券股份有限公司
住所：成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
电话：028-86690057、028-86690058
传真：028-86690126
联系人：冯经漪、贺鹏
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95310
（111）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：李腾
网址：www.e5618.com
客户服务电话：400-889-5618
（112）华宝证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人：陈林
电话：021-50122128
传真：021-50122398
联系人：徐方亮
网址：www.cnhbstock.com
客户服务电话：400-820-9898
（113）长城国瑞证券有限公司
住所：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
办公地址：福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
法定代表人：王勇
电话：0592-5161642、1588028470
传真：0592-5161140
联系人：严金文
网址：www.xmzq.cn
客户服务电话：0592-5163588
（114）爱建证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人：钱华
电话：021-32229888
传真：021-62878783
联系人：王薇
网址：www.ajzq.com
客户服务电话：400-196-2502
（115）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦
法定代表人：钟皓宏
电话：010-85556100
传真：010- 85556153
联系人：李慧灵
网址：www.hrsec.com.cn
客户服务电话：400-898-9999
（116）天风证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
电话：027-87618882
传真：027-87618863
联系人：翟璀
网址：www.tfzq.com
客户服务电话：028-86711410、027-87618882
（117）宏信证券有限责任公司
住所：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉明
电话：028-86199278
传真：028-86199382
联系人：郝悦杰
网址：www.hxzq.cn
客户服务电话：400-836-6366
（118）太平洋证券股份有限公司
住所：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：北京市西城区北展北街9号华远企业号D座3单元
法定代表人：李长伟
电话：010-88321717、18500505235
传真：010-88321763
联系人：唐昌旦
网址：www.tpyzq.com
客户服务电话：400-665-0999
（119）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号一幢二楼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：汤晓东
电话：010-88066632
联系人：仲秋玥
客户服务电话：400-817-5666
3、场内代销机构
指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。
基金管理人可依据有关法律法规规定，根据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）登记结算机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：聂腾
联系人：陈鸿鹄
联系电话：010-50938870
传真：010-50938907
（三）律师事务所
名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人：朱小辉
联系电话：010-57763888
传真：010-57763777
联系人：杨利
经办律师：吴冠雄、杨利
（四）会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：许康玮、赵雪
经办注册会计师：许康玮、洪磊

## 四、基金的名称

本基金名称：华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）。

## 五、基金的类型

本基金类型：契约型上市开放式基金。

## 六、基金的投资目标

本基金的投资目标：追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围：限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在金融衍生产品（如股指期货）推出后，本基金还可依据法律法规的规定运用金融衍生产品进行投资风险管理。
其中，本基金股票投资占基金资产的比例范围为20%～95%，债券投资占基金资产的比例范围为0～80%，资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为0～20%，权证投资占基金资产净值的比例范围为0～3%，现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
此外，如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

## 八、基金的投资策略

（一）资产配置策略
本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。
（二）股票投资策略
本基金总体上采取“核心－卫星策略”，即将基金股票资产分成两部分，其中核心部分在投资组合中占较大比重（不低于股票资产的80%），投资较为稳定，对整个投资组合的长期风险收益特征起到决定性作用；卫星部分在投资组合中占权重较小、投资更加主动、积极和灵活，以追求超额收益为目标。
本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股，以分享中国经济成长；卫星组合则采取多种策略，积极投资于新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。由于核心组合与卫星组合之间相关性较低，还能够有效地分散基金整体组合的风险，从而实现在有效控制风险的前提下追求基金资产的稳健、持续增值。
1、核心组合投资策略
本基金的核心组合主要采取买入持有策略，投资于大盘蓝筹股。大盘蓝筹股是指市值规模较大（总市值不低于15亿元）、且具有以下特征的股票：
（1）公司在行业中处于领先地位，具备核心竞争优势，比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特的市场形象、较高的品牌认知度等。
（2）公司经营管理团队稳定、治理结构良好。
（3）公司财务指标健康、收入增长和盈利水平较高。
（4）市场估值相对于公司资产价值和增长潜力而言处于合理区间。
中国经济正处于转轨、快速成长的阶段，由于大盘蓝筹股在行业中处于领先地位，具备较高的市场占有率和市场影响力，因而能够获得更多的资源和支持，充分分享经济成长的果实，并将其转化为企业自身的业绩增长动力。而且，在我国证券市场上，随着机构投资者所占比重越来越高，对市场的影响力也越来越大，由于大盘蓝筹股在流动性和风险方面具有比较优势，将成为机构投资者的核心组合，从而获得资金面支持。因此，我们认为，投资于大盘蓝筹股将在较低风险下实现基金资产的稳健增值。
2、卫星组合投资策略
本基金卫星组合将采取多种积极策略，追求在有效控制风险的前提下实现超额收益。目前，基金主要关注新股、中小盘股、资产重组板块、衍生工具等机会，通过积极操作，为整个组合扩大增值空间。
（1）新股申购：基金将利用规模优势和定价优势，积极参与新股申购、定向增发等，把握一级市场与二级市场的差价机会，获取低风险收益。
（2）中小盘股：与大盘股相比，中小型企业的成长性更高、收益潜力更大，但个股风险也较高。基金将通过深入研究、精选个股，把握中小板块的成长机会，以实现超越市场平均水平的较高收益。
（3）资产重组板块：随着股权分置改革的完成，越来越多的大股东愿意通过整体上市、收购兼并、资产重组等形式，把优质资产注入上市公司，以提升公司业绩，并实现市值的更大增长。重组概念将成为未来一段时间内驱动公司业绩增长的重要因素，基金将积极把握其中机会，获取超额收益。
（4）衍生品板块：随着股指期货等衍生工具的推出和发展，基金将有可能采用组合策略对冲风险，或通过杠杆作用放大收益。基金将以定量分析模型为基础，在严格控制风险的前提下把握衍生品市场机会，追求实现较高收益。
未来，基金管理人还将根据证券市场发展、积极寻求其他投资机会，对卫星组合投资策略进行丰富和调整。
（三）债券投资策略
本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：
1、久期调整策略
根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。
2、收益率曲线配置策略
在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预期，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
3、债券类属配置策略
根据国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对企业债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理，获取超额收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基金整体业绩比较基准构成为：
基准收益率＝沪深300指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%
未来，如基金变更投资比例范围，或市场中出现代表性更强、投资者认同度更高的指数，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，基金管理人可在履行适当程序后，变更本基金的基准指数或权重构成。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

## 十一、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2016年第1季度报告：
"5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 3,579,802,102.10 | 81.10 |
| | 其中：股票 | 3,579,802,102.10 | 81.10 |
| 2 | 固定收益投资 | 91,638,840.90 | 2.08 |
| | 其中：债券 | 91,638,840.90 | 2.08 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 200,000,220.00 | 4.53 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 537,232,924.27 | 12.17 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,447,734.86 | 0.12 |
| 8 | 合计 | 4,414,121,822.13 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 46,772,054.08 | 1.08 |
| B | 采矿业 | 24,620,241.00 | 0.57 |
| C | 制造业 | 1,905,085,310.20 | 44.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 84,010,277.56 | 1.95 |
| E | 建筑业 | 135,787,960.83 | 3.15 |
| F | 批发和零售业 | 99,535,682.09 | 2.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 268,159,908.72 | 6.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,932,893.70 | 0.09 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 204,681,794.47 | 4.75 |
| J | 金融业 | 416,943,196.16 | 9.67 |
| K | 房地产业 | 186,451,340.88 | 4.32 |
| L | 租赁和商务服务业 | 57,446,440.58 | 1.33 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,400,000.00 | 0.13 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 23,547,300.00 | 0.55 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 6,725,679.00 | 0.16 |
| Q | 卫生和社会工作 | 364,495.60 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 97,744,978.78 | 2.27 |
| S | 综合 | 12,592,548.45 | 0.29 |
| | 合计 | 3,579,802,102.10 | 83.02 |

5.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600612 | 老凤祥 | 6,334,525 | 257,625,131.75 | 5.97 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 14,118,400 | 227,165,056.00 | 5.27 |
| 3 | 600004 | 白云机场 | 8,995,729 | 111,547,039.60 | 2.59 |
| 4 | 002051 | 中工国际 | 4,635,540 | 106,107,510.60 | 2.46 |
| 5 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,049,966 | 99,525,849.30 | 2.31 |
| 6 | 601021 | 春秋航空 | 1,856,158 | 86,162,854.36 | 2.00 |
| 7 | 600804 | 鹏博士 | 3,938,874 | 83,622,295.02 | 1.94 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 5,400,000 | 66,312,000.00 | 1.54 |
| 9 | 600271 | 航天信息 | 1,099,803 | 64,030,530.66 | 1.48 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 3,529,700 | 54,816,241.00 | 1.27 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,050,000.00 | 1.16 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,050,000.00 | 1.16 |
| 4 | 企业债券 | 41,588,840.90 | 0.96 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 91,638,840.90 | 2.13 |

5.5 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 150416 | 15农发16 | 500,000 | 50,050,000.00 | 1.16 |
| 2 | 122641 | PR武城投 | 80,000 | 6,136,800.00 | 0.14 |
| 3 | 122652 | 12杨农债 | 50,000 | 5,574,000.00 | 0.13 |
| 4 | 112044 | 11中泰01 | 50,000 | 5,332,000.00 | 0.12 |
| 5 | 122680 | PR昆建债 | 50,000 | 3,877,500.00 | 0.09 |

5.6 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 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
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 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
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 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。
5.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,134,458.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,841,843.49 |
| 5 | 应收申购款 | 471,432.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,447,734.86 |

5.11.4 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。
5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600271 | 航天信息 | 64,030,530.66 | 1.48 | 重大事项 |

5.11.6 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2007年4月24日至2007年12月31日 | 51.37% | 1.42% | 31.66% | 1.36% | 19.71% | 0.06% |
| 2008年1月1日至2008年12月31日 | -42.85% | 1.95% | -44.13% | 1.83% | 1.28% | 0.12% |
| 2009年1月1日至2009年12月31日 | 61.16% | 1.84% | 52.55% | 1.23% | 8.61% | 0.61% |
| 2010年1月1日至2010年12月31日 | -1.07% | 1.20% | -5.83% | 0.95% | 4.76% | 0.25% |
| 2011年1月1日至2011年12月31日 | -26.20% | 1.19% | -14.09% | 0.78% | -12.11% | 0.41% |
| 2012年1月1日至2012年12月31日 | 7.10% | 1.03% | 6.36% | 0.77% | 0.74% | 0.26% |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | 15.97% | 1.12% | -3.08% | 0.84% | 19.05% | 0.28% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 29.29% | 0.97% | 31.19% | 0.73% | -1.90% | 0.24% |
| 2015年1月1日至2015年12月31日 | 30.23% | 2.12% | 7.74% | 1.49% | 22.49% | 0.63% |
| 2016年1月1日至2016年3月31日 | -14.07% | 2.37% | -7.60% | 1.46% | -6.47% | 0.91% |

## 十三、费用概览

（一）基金运作费用
1、基金费用的种类
基金运作过程中，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）基金上市初费及年费。
（4）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）。
（5）基金份额持有人大会费用。
（6）与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用。
（7）基金的资金汇划费用。
（8）基金收益分配中发生的费用。
（9）按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以列入的其他费用。
在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书更新或相关公告中载明。
2、基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式
（1）基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。
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，基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。
（2）基金托管人的托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。
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，基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。
（3）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管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。
（4）本条第（一）款第1项中第（3）至第（9）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，并列入或摊入当期基金费用。
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。
（二）基金销售费用
1、申购费与赎回费
（1）本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者在申购本基金时需交纳前端申购费，费率按申购金额递减，具体如下：

| 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)-1000万元以下 | 0.8% |
| 1000万元以上(含1000万元) | 每笔1,000.00元 |

（2）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，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。
（3）基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。
（4）经中国证监会允许，基金管理人可以在遵守法律法规及基金合同规定的条件下，针对特定期间或符合特定条件的投资者，采取调低基金申购费、赎回费等措施，基金管理人须于该等措施实施前1个工作日在至少一种指定媒体公告。
2、申购份额与赎回金额的计算方式
（1）申购份额的计算
申购费用适用比例费率时，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
申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：
前端申购费用＝固定金额
净申购金额＝申购金额－前端申购费用
申购份额＝净申购金额／T日基金份额净值
对于办理场内申购的投资者，申购份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返回给投资者。对于办理场外申购的投资者，申购份额的计算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或收益归入基金资产。
例一：假定T日的基金份额净值为1.200元，若三笔场内申购金额分别为1,000元、100万元、500万元，则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% | 0.8% |
| 净申购金额(C=A/(1+B)) | 985.22 | 988,142.29 | 4,960,317.46 |
| 前端申购费(D=A-C) | 14.78 | 11,857.71 | 39,682.54 |
| 场内申购份额(E=C/1.200) | 821 | 823,451 | 4,133,597 |

若场内申购金额为1000万元，则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4 |
|---|---|
| 申购金额(元，A) | 10,000,000.00 |
| 前端申购费(B) | 1,000.00 |
| 净申购金额(C=A-B) | 9,999,000.00 |
| 场内申购份额(D=C/1.200) | 8,332.500 |

例二：假定T日的基金份额净值为1.200元，若三笔场外申购金额分别为1,000元、100万元、500万元，则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% | 0.8% |
| 净申购金额(C=A/(1+B)) | 985.22 | 988,142.29 | 4,960,317.46 |
| 前端申购费(D=A-C) | 14.78 | 11,857.71 | 39,682.54 |
| 场外申购份额(E=C/1.200) | 821.02 | 823,451.91 | 4,133,597.88 |

若场外申购金额为1000万元，则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4 |
|---|---|
| 申购金额(元，A) | 10,000,000.00 |
| 前端申购费(B) | 1,000.00 |
| 净申购金额(C=A-B) | 9,999,000.00 |
| 场外申购份额(D=C/1.200) | 8,332,500.00 |

（2）赎回金额的计算
赎回金额的计算方法如下：
赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用＝赎回金额×赎回费率
净赎回金额＝赎回金额－赎回费用
例三：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，则其获得的净赎回金额计算如下：
赎回金额＝10,000.00×1.250＝12,500.00元
赎回费用＝12,500.00×0.5%＝62.50元
净赎回金额＝12,500.00－62.50＝12,437.50元
3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。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。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）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2015年12月5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”中相关内容。
（二）更新了“四、基金托管人”的相关内容。
（三）更新了“五、相关服务机构”中相关内容。
（四）更新了“十、基金份额的申购与赎回”中相关信息。
（五）更新了“十二、基金的投资”中基金投资组合报告，该部分内容均按有关规定编制。
（六）更新了“十三、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“二十四、对基金份额持有人的服务”中相关内容。
（八）更新了“二十五、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
二〇一六年六月七日

---

证券代码：000875　证券简称：吉电股份　公告编号：2016-052

# 关于召开吉林电力股份有限公司2016年第二次临时股东大会的提示性公告

**本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。**

吉林电力股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第五十四次会议决定于2016年6月13日（星期一）召开公司2016年第二次临时股东大会（下称“本次股东大会”），关于召开本次股东大会的通知已于2016年5月25日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）上。本次股东大会将采用现场表决与网络投票相结合的方式，现将有关事项提示如下：
一、召开会议基本情况
（一）股东大会届次：本次股东大会为公司2016年第二次临时股东大会。
（二）会议召集人：2016年5月24日，吉林电力股份有限公司第六届董事会第五十四次会议，以9票赞同、0票反对、0票弃权，审议通过了《关于召开公司2016年第二次临时股东大会的议案》。
（三）本次临时股东大会的召集召开符合《公司法》、《上市公司股东大会规则》和公司《章程》等有关规定。
（四）会议召开日期和时间：
1、现场会议日期与时间：2016年6月13日（星期一）下午14:30开始。
2、网络投票日期与时间：2016年6月12日至2016年6月13日，其中通过深圳证券交易所交易系统投票的具体时间为：2016年6月13日上午9:30—11:30，下午13:00-15:00；通过互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn）进行网络投票的具体时间为：2016年6月12日下午15:00至2016年6月13日下午15:00的任意时间。
（五）会议的召开方式：本次临时股东大会采取现场会议与网络投票相结合的方式召开。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统（http://wltp.cninfo.com.cn）为股东提供网络投票平台。
（六）出席对象：
1、在本次股东大会的股权登记日—2016年6月6日（星期一）下午收市时，在中国证券登记结算有限公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东均有权出席本次临时股东大会，并可以书面委托代理人出席会议和参加表决，该股东代理人不必是公司的股东。
2、公司董事、监事和高级管理人员。
3、公司聘请的见证律师。
（七）会议召开地点：吉林省长春市人民大街9699号，吉林电力股份有限公司第三会议室
二、会议审议事项
吉林电力股份有限公司关于前次募集资金使用情况说明的议案。
三、现场会议登记方法
1、登记方式：出席会议的股东或股东代理人应在会议召开前提前登记，登记可采取在登记地点现场登记、传真方式登记、信函方式登记等方式。
2、登记地点：吉林省长春市人民大街9699号，吉林电力股份有限公司证券部。
3、登记时间：2016年6月8日上午10:30—11:30，下午13:30-16:30（信函以收到邮戳日为准）。
4、出席会议所需携带资料
（1）自然人股东
自然人股东本人出席股东大会，应持股东账户卡、身份证或其他能够表明身份的有效证件或证明；受托他人出席会议的，代理人应持有股东账户卡、股东有效身份证件、股东授权委托书和代理人有效身份证件。
（2）法人股东
法人股东应由法定代表人或法定代表人委托的代理人出席会议。法定代表人出席会议的，应持本人身份证、能证明其具有法定代表人资格的有效证明；法人股东的法定代表人委托他人出席会议的，代理人应持本人身份证、法人股东单位的法定代表人依法出具的授权委托书，能证明法定代表人资格的有效证明。
四、参加网络投票的具体操作流程
在本次股东大会上，股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统（网址为http://wltp.cninfo.com.cn）参加网络投票。
（一）网络投票的程序
1、投票代码：360875，投票简称：吉电投票。
2、议案设置及意见表决。
（1）议案设置
股东大会议案对应“议案编码”一览表

| 议案序号 | 议案名称 | 议案编码 |
|---|---|---|
| 议案1 | 吉林电力股份有限公司关于前次募集资金使用情况说明的议案。 | 1.00 |

（2）填报表决意见。
填报表决意见，同意、反对、弃权。
（3）股东对总议案进行投票，视为对除累积投票议案外的其他所有议案表达相同意见。
在股东对同一议案出现总议案与分议案重复投票时，以第一次有效投票为准。如股东先对分议案投票表决，再对总议案投票表决，则以已投票表决的分议案的表决意见为准，其他未表决的议案以总议案的表决意见为准；如先对总议案投票表决，再对分议案投票表决，则以总议案的表决意见为准。
（4）对同一议案的投票以第一次有效投票为准。
（二）通过深交所交易系统投票的程序
1、投票时间：2016年6月13日的交易时间，即9:30—11:30和13:00—15:00。
2、股东可以登录证券公司交易客户端通过交易系统投票。
（三）通过深交所互联网投票系统投票的程序
1、互联网投票系统开始投票的时间为2016年6月12日下午15:00，结束时间为2016年6月13日下午15:00。
2、股东通过互联网投票系统进行网络投票，需按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务指引（2016年4月修订）》的规定办理身份认证，取得“深交所数字证书”或“深交所投资者服务密码”。具体的身份认证流程可登录互联网投票系统http://wltp.cninfo.com.cn规则指引栏目查阅。
3、股东根据获取的服务密码或数字证书，可登录http://wltp.cninfo.com.cn在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。
五、其他事项
1、会务常设联系人
联 系 人：石岚　华子玉
联系电话：0431—81150933　81150932
传　　真：0431—81150997
电子邮箱：jdgf875@cpijl.com
通讯地址：吉林省长春市人民大街9699号
邮政编码：130022
2、会议费用情况
会期一天。出席会议者食宿、交通费用自理。
六、备查文件
公司第六届董事会第五十四次会议决议。
特此公告。
附：吉林电力股份有限公司2016年第二次临时股东大会授权委托书

吉林电力股份有限公司董事会
二〇一六年六月六日

吉林电力股份有限公司
2016年第二次临时股东大会授权委托书

吉林电力股份有限公司：
兹委托　　先生/女士（身份证号：　　）代表本人（或单位）出席贵公司于2016年6月13日（星期一）在吉林省长春市人民大街9699号召开的2016年第二次临时股东大会，并授权其对会议议案按下表所示进行表决：

| 序号 | 议案名称 | 表决结果 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 1 | 吉林电力股份有限公司关于前次募集资金使用情况说明的议案。 | | | |

委托人(法定代表人)签名：　　代理人签名：
股东账户卡号：　　持股数：
（公司盖章）
年　月　日

---

证券代码：000507　证券简称：珠海港　公告编号：2016-047

# 珠海港股份有限公司关于召开2015年年度股东大会的提示性公告

**本公司及董事局全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。**

珠海港股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于2016年5月24日在《证券时报》、《中国证券报》和http://www.cninfo.com.cn上刊登了《珠海港股份有限公司关于召开2015年年度股东大会的通知》，