(上接B123版)

网址:www.ccnew.com
客户服务电话:95377
(144)国都证券股份有限公司
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
(145)东海证券股份有限公司
住所:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
网址:www.longone.com.cn
客户服务电话:95531、400-888-8588
(146)中银国际证券股份有限公司
住所:上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:钱卫
电话:021-50372474
传真:021-50372474
联系人:王炜哲
网址:www.bocichina.com.cn
客户服务电话:400-620-8888
(147)恒泰证券股份有限公司
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:庞介民
电话:021-68405273
传真:021-68405181
联系人:张同亮
网址:www.cnht.com.cn
客户服务电话:400-196-6188
(148)国盛证券有限责任公司
住所:南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦4层
法定代表人:马跃进
电话:0791-86283080
传真:0791-86281305
联系人:俞驰
网址:www.gszq.com
客户服务电话:400-822-2111
(149)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号
办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人:杨炯洋
电话:010-52723273
传真:028-86150040
联系人:谢国梅
网址:www.hx168.com.cn
客户服务电话:400-888-8818
(150)申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(830002)
法定代表人:韩志谦
电话:0991-2307105
传真:0991-2301927
联系人:王怀春
网址:www.hysec.com
客户服务电话:400-800-0562
(151)中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
电话:021-20315290
传真:021-20315125
联系人:许曼华
网址:www.zts.com.cn
客户服务电话:95538
(152)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:姜昧军
客户服务电话:400-832-3000
传真:0755-83199511
联系人:王雯
网址:www.csco.com.cn
(153)第一创业证券股份有限公司
住所:广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人:刘学民
电话:0755-25831754
传真:0755-23838750
联系人:毛诗莉
网址:www.firstcapital.com.cn
客户服务电话:95358
(154)金元证券股份有限公司
住所:海口市南宝路36号证券大厦4楼
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:0755-83025022
传真:0755-83025625
联系人:马贤清
网址:www.jyzq.cn
客户服务电话:95372
(155)中航证券有限公司
住所:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人:王宜四
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
联系人:戴蕾
网址:www.avicsec.com
客户服务电话:95335
(156)华林证券股份有限公司
住所:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人:林立
电话:0755-83255199
传真:0755-82707700
联系人:胡倩
网址:www.chinalin.com
客户服务电话:400-188-3888
(157)德邦证券股份有限公司
住所:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:姚文平
电话:021-68761616-8076
传真:021-68767032
联系人:刘熠
网址:www.tebon.com.cn
客户服务电话:400-888-8128
(158)西部证券股份有限公司
住所:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
法定代表人:刘建武
电话:029-87417129
传真:029-87424426
联系人:刘莹
网址:www.westsecu.com
客户服务电话:95582
(159)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至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.hfzq.com.cn
客户服务电话:95547
(160)华龙证券股份有限公司
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:95368、400-468-8888(全国)
(161)中国国际金融股份有限公司
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:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:罗春蓉、武明明
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166
(162)财通证券股份有限公司
住所:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
电话:0571-87925129
传真:0571-87818329
联系人:夏吉慧
网址:www.ctsec.com
客户服务电话:95336
(163)上海华信证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心
办公地址:上海市黄埔区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人:陈灿辉
电话:021-63898427
传真:021-68776977-8427
联系人:徐璐
网址:www.shhxzq.com
客户服务电话:400-820-5999
(164)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人:俞洋
电话:021-54967552
传真:021-54967032
联系人:杨莉娟
网址:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:95323、400-109-9918
(165)瑞银证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜荪
电话:010-58328112
传真:010-58328748
联系人:牟冲
网址:www.ubssecurities.com
客户服务电话:400-887-8827
(166)中国中投证券有限责任公司
住所: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-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
电话:0755-88320851
传真:0755-82026942
联系人:胡芷境
网址:www.china-invs.cn
客户服务电话:400-600-8008、95532
(167)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:95329
(168)西藏东方财富证券股份有限公司
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:贾绍君
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:95357
(169)国融证券股份有限公司
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:陈韦杉、朱晓光
网址:www.rxzq.com.cn
客户服务电话:95385
(170)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:0755-83331195
联系人:彭莲
网址:www.lxsec.com
客户服务电话:95564
(171)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
(172)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:成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690057、028-86690058
传真:028-86690126
联系人:刘婧漪、贾鹏
网址:www.gjzq.com.cn
客户服务电话:95310
(173)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
客户服务电话:400-889-5618
(174)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
(175)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:福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼
法定代表人:王勇
电话:0592-2079259
传真:0592-2079602
联系人:邱震
网址:www.gwgsc.com
客户服务电话:400-0099-886
(176)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
(177)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:祝献忠
电话:010-85556048
传真:010-85556088
联系人:孙燕波
网址:www.hrsec.com.cn
客户服务电话:95390
(178)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:翟璟
网址:www.tfzq.com
客户服务电话:400-800-5000
(179)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:郝俊杰
网址:www.hxzq.cn
客户服务电话:400-836-6366
(180)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:唐昌田
网址:www.tpyzq.com
客户服务电话:400-665-0999
(181)华瑞保险销售有限公司
住所:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址:上海市浦东新区银城中路501号上海中心大厦32层
法定代表人:路昊
电话:021-61058785
传真:021-61098515
联系人:茆勇强
网址:www.huaruisales.com
客户服务电话:400-111-5818
(182)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:李一梅
电话:010-88066632
传真:010-88066214
联系人:仲秋玥
网址:www.amcfortune.com
客户服务电话:400-817-5666

基金管理人可根据有关法律法规规定或情况变化,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或者减少代销机构,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)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8层
法定代表人:杨明辉
客户服务电话:400-818-6666
传真:010-63136700
联系人:朱威

(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:李晗
经办律师:吴冠雄、李晗

(四)会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、王珊珊

四、基金的名称

本基金名称:华夏大盘精选证券投资基金。

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:追求基金资产的长期增值。

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,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、基金的投资策略

本基金主要采取"自下而上"的个股精选策略,根据细致的财务分析和深入的上市公司调研,精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性,基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略,即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析,监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例,以避免市场系统性风险,保证基金所承担的风险水平合理。

(一)资产配置策略

本基金主要投资于股票,股票资产比例范围为40%~95%。为了满足投资者的赎回要求,基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的国债、政策性金融债、债券回购、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于5%。根据股票、债券等资产类别的配置计划,为提高投资效率或避险,基金可投资于权证,权证投资比例范围为0%~3%。本基金其余资产可投资于债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,如法律法规或监管部门对债券投资比例有相关规定的,则从其规定。

本基金在基金合同生效后三个月内达到上述规定的投资比例。

(二)个股精选策略

1、构建备选股票池

本基金备选股票池主要包括大盘股,对大盘股的投资将占基金股票资产的80%以上。除此之外,基金还可以部分投资于其他具有高成长潜力的股票,这部分股票由研究员提交投资建议报告,经基金经理小组和投资决策委员会审议后确定。

2、进行财务指标分析

主要分析公司的成本收入、现金流、资产负债结构等指标,并与同行业内的其他公司进行对比,从中挑选出指标值较优或可能存在问题的公司,以此确定实地调研的优先顺序和关注重点。

3、进行上市公司调研

实地调研重点考察公司的财务报表信息是否真实可靠,并对公司的核心竞争能力、内部管理和外部经营环境进行全面考察,从而形成对公司经营风险和业绩成长性的评估。

4、评估个股价值并进行排序

根据实地调研的考察结果,对上市公司的公开财务数据进行风险调整和成长性调整,并计算调整后的P/E、P/B、P/S、P/C、ROE、PEG等指标。由于公司经营状况和市场环境在不断发生变化,基金将实时跟踪上市公司风险因素和成长性因素的变动,对上述几个指标进行动态调整。然后,基金将根据一段时间内整个证券市场的风险特征以及不同公司的行业特征,对上述估值指标设置不同的权重,并根据综合考察后的个股估值情况进行排序。

5、确定投资组合

本基金采取相对集中的投资策略,基金股票组合的持股个数一般不超过100只(新股申购不计算在内)。在上述排序过程之后,排名前100位的个股将进入基金的股票投资组合,其中排名越靠前的个股投资比重越高。

在未来基金规模扩大或是上市公司数量大幅扩张,导致持股个数限制严重影响基金的投资操作和收益能力时,本基金可在不改变集中持股策略的前提下适当调整组合持股个数,并及时公告。

(三)债券投资策略

本基金债券投资的主要目标是在保持基金流动性的基础上,提高基金收益水平,并分散股票投资风险。本基金可投资于国债、金融债和企业债(包括可转债)。具有以下一项或多项特征的债券,将是本基金债券投资重点关注的对象:1、有较好流动性的债券;2、在信用质量和剩余期限类似的条件下,到期收益率较高的债券;3、风险水平合理、有较好下行保护的债券;4、在同等条件下信用质量较好的债券。

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。

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富时中国A200指数。未来,如所用基准指数不再符合本基金的投资风格和投资策略,或有更合适的大盘股指数推出,基金管理人可与基金托管人协商一致后,确定采用其他基准指数并及时公告。

另外,本基金将遵守法律法规和监管部门对债券投资比例的相关规定。为此,基金采用富时中国国债指数作为债券投资的业绩比较基准,并根据基金的资产配置范围,将整体业绩比较基准设定为"富时中国A200指数×80%+富时中国国债指数×20%"。未来,在更合适的债券指数推出、法律法规或监管部门调整投资比例限制的相关规定等情况下,基金管理人可与基金托管人协商一致后,确定采用其他债券指数或变更整体业绩比较基准的构成并公告。

十、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和混合基金,低于成长型股票基金。

十一、基金投资组合报告

以下内容摘自本基金2018年第2季度报告:

"5.1 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	3,111,099,250.18	83.86
	其中:股票	3,111,099,250.18	83.86
2	固定收益投资	200,600,000.00	5.41
	其中:债券	200,600,000.00	5.41
	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	–	–
	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	385,202,409.54	10.38
7	其他各项资产	12,886,135.27	0.35
8	合计	3,709,787,794.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	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	采矿业	22,167,298.00	0.61
C	制造业	2,219,897,289.86	60.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,456.00	0.00
E	建筑业	15,288,000.00	0.42
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	438,942,896.94	11.98
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	216,094,776.94	5.90
K	房地产业	109,555,984.41	2.99
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	14,529,951.07	0.40
R	文化、体育和娱乐业	74,574,596.96	2.04
S	综合	–	–
	合计	3,111,099,250.18	84.95

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

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	600690	青岛海尔	15,300,000	294,678,000.00	8.05
2	600600	青岛啤酒	5,533,022	242,512,354.26	6.62
3	600009	上海机场	4,139,602	229,665,118.96	6.27
4	300124	汇川技术	5,799,917	190,353,275.94	5.20
5	000333	美的集团	3,163,497	165,197,813.34	4.51
6	600036	招商银行	5,799,903	153,349,435.32	4.19
7	600309	万华化学	3,264,000	148,250,880.00	4.05
8	603833	欧派家居	1,083,498	138,178,499.94	3.77
9	600019	宝钢股份	16,459,983	128,223,267.57	3.50
10	600885	宏发股份	4,227,875	126,498,020.00	3.45

5.4 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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	200,600,000.00	5.48
	其中:政策性金融债	200,600,000.00	5.48
4	企业债券	–	–
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	200,600,000.00	5.48

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

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	180404	18农发04	1,500,000	150,450,000.00	4.11
2	180201	18国开01	500,000	50,150,000.00	1.37
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	692,288.46
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,906,575.08
5	应收申购款	9,287,271.73
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,886,135.27

5.11.4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。

5.11.5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。

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
2004年8月11日至2004年12月31日	0.30%	0.48%	-8.47%	1.32%	8.77%	-0.84%
2005年1月1日至2005年12月31日	-0.20%	0.89%	-5.33%	1.03%	5.13%	-0.14%
2006年1月1日至2006年12月31日	154.49%	1.38%	92.14%	1.11%	62.35%	0.27%
2007年1月1日至2007年12月31日	226.24%	1.95%	106.61%	1.83%	119.63%	0.12%
2008年1月1日至2008年12月31日	-34.88%	2.08%	-56.18%	2.40%	21.30%	-0.32%
2009年1月1日至2009年12月31日	116.19%	1.71%	68.20%	1.63%	47.99%	0.08%
2010年1月1日至2010年12月31日	24.24%	1.36%	-9.90%	1.24%	34.14%	0.12%
2011年1月1日至2011年12月31日	-17.10%	1.29%	-18.65%	1.03%	1.55%	0.26%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.89%	1.22%	8.56%	1.00%	-2.67%	0.22%
2013年1月1日至2013年12月31日	14.92%	1.16%	-7.30%	1.12%	22.22%	0.04%
2014年1月1日至2014年12月31日	6.07%	1.14%	40.07%	1.00%	-34.00%	0.14%
2015年1月1日至2015年12月31日	28.17%	2.56%	3.95%	1.98%	24.22%	0.58%
2016年1月1日至2016年12月31日	-11.30%	1.67%	-9.12%	1.07%	-2.18%	0.60%
2017年1月1日至2017年12月31日	34.96%	0.80%	20.59%	0.52%	14.37%	0.28%
2018年1月1日至2018年6月30日	-3.61%	1.25%	-9.74%	0.94%	6.13%	0.31%

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

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,经基金托管人复核后于次月首日起5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5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。

(3)本条第(一)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,列入当期基金费用。

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财产的损失,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、基金管理费和基金托管费的调整

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率、基金托管费率,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	前端申购费率
100万以下	1.5%
100万以上(含100万)–500万	1.2%
500万以上(含500万)	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,不列入基金财产。

(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。赎回费率如下:

持有期限	赎回费率
7天以内	1.5%
7天以上(含7天)	0.5%

对于赎回时份额持有不满7天的,收取的赎回费全额计入基金财产。对赎回时份额持有满7天以上(含7天)收取的赎回费,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。

(4)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、移动客户端交易)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。

(5)当发生大额申购或赎回情形时,按照法律法规及监管要求,在履行适当程序后,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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)	1.5%	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(E=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,持有期10天,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	13,000	13,600
赎回费率(I)	0.5%	0.5%	0.5%
赎回费用(E=D×I)	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、基金转换费用

(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,还需收取相应的后端申购费用。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,且转出基金和转入基金的申购费率均适用固定费用。

费用收取方式: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。

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"中例七。

⑧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"中例八。

⑨从后端收费基金转出,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"中例九。

⑩从后端收费基金转出,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。

⑾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。

⑿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。

⒀从不收取申购费用的基金转出,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"中例十三。

⒁从不收取申购费用基金转出,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=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"中例十四。

⒂从不收取申购费用的基金转出,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:不收取申购费用的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。

⒃从不收取申购费用的基金转出,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"中例十六。

⒄对于货币基金的基金份额转出情况的补充说明

对于货币型基金,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)

(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)	1,000.00
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)	0.00%
净转入金额(H=F/(1+G))	1,194.00
转入基金费用(I=F–H)	0.00
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),甲基金申购费率适用比例费率,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%
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)	1,000.00
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%
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

例三: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)	1.200
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
转入基金费用(G)	0.00
净转入金额(H=F–G)	1,194.00
转入基金T日基金份额净值(I)	1.500
转入基金份额(J=H/I)	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在1年之内,适用后端申购费率为1.2%,此时赎回乙基金不收取赎回费,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(K)	796.00
赎回日基金份额净值(L)	1.300
赎回总金额(M=K*L)	1,034.80
赎回费用(N)	0.00
适用后端申购费率(O)	1.2%
后端申购费(P=K*I*O/(1+O))	14.16
赎回金额(Q=M–N–P)	1,020.64

例四:假定投资者在T日转出前端收费基金甲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1.300、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)	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%
转出基金费用(E=C*D)	6.50
转换金额(F=C–E)	1,293.50
转入基金费用(G)	0.00
净转入金额(H=F–G)	1,293.50
转入基金T日基金份额净值(I)	1.500
转入基金份额(J=H/I)	862.33

例五: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),甲基金申购费率适用固定费用,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1.2%,赎回费率为0.5%。

①若T日转入乙基金(前端收费模式),且乙基金申购费率适用比例费率,乙基金前端申购费率最高档为1.5%,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

②若T日转入丙基金(前端收费模式),且丙基金申购费率适用比例费率,丙基金前端申购费率最高档为1.0%,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
转入时收取申购费率(G)	0.00%
净转入金额(H=F/(1+G))	11,940,000.00
转入基金费用(I=F–H)	0.00
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=H/J)	9,184,615.38

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)	1.500
转入基金份额(J=H/I)	7,960,000.00

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在1年之内,适用后端申购费率为1.2%,此时赎回乙基金不收取赎回费,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(K)	7,960,000.00
赎回日基金份额净值(L)	1.300
赎回总金额(M=K*L)	10,348,000.00
赎回费用(N)	0.00
适用后端申购费率(O)	1.2%
后端申购费(P=K*I*O/(1+O))	141,581.03
赎回金额(Q=M–N–P)	10,206,418.97

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=A×F×G/(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=A×F×G/(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)	0.00%
净转入金额(L=J/(1+K))	1,174.55
转入基金费用(M=J–L)	0.00
转入基金T日基金份额净值(N)	1.300
转入基金份额(O=L/N)	903.50

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
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=A×F×G/(1+G))	194,499.02
转出基金费用(I=E+H)	254,499.02
转换金额(J=C–I)	11,745,500.98
转入基金费用(K)	1,000.00
净转入金额(L=J–K)	11,744,500.98
转入基金T日基金份额净值(M)	1.300
转入基金份额(N=L/M)	9,034,231.52

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
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=A×F×G/(1+G))	194,499.02
转出基金费用(I=E+H)	254,499.02
转换金额(J=C–I)	11,745,500.98
转入基金费用(K)	0.00
净转入金额(L=J–K)	11,745,500.98
转入基金T日基金份额净值(M)	1.300
转入基金份额(N=L/M)	9,035,000.75

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=A×F×G/(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=A×F×G/(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%,此时转出不收取赎回费。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10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%,此时转出不收取赎回费。乙基金适用固定申购费1,000.00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%
转入基金申购费用(G)	1,000.00
转入基金费用 (H=G–E*F*转出基金的持有时间 (单位为年))	13.70
净转入金额(I=E–H)	11,999,986.30
转入基金T日基金份额净值(J)	1.300
转入基金份额(K=I/J)	9,230,758.69

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60天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。此时转出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

华夏大盘精选证券投资基金招募说明书(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2018年3月27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"一、绪言"中相关内容。
(二)更新了"二、释义"中相关内容。
(三)更新了"三、基金管理人"中相关内容。
(四)更新了"四、基金托管人"中相关内容。
(五)更新了"五、相关服务机构"中相关信息。
(六)更新了"八、基金份额的申购、赎回与转换"中相关内容。
(七)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。
(八)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。
(九)更新了"十三、基金资产的估值"中相关内容。
(十)更新了"十七、基金的信息披露"中相关内容。
(十一)更新了"十八、风险揭示"中相关内容。
(十二)更新了"二十一、基金托管协议的内容摘要"中相关内容。
(十三)更新了"二十二、对基金份额持有人的服务"中相关内容。
(十四)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
二〇一八年九月二十一日