

(上接B060版)

客户服务电话:400-836-6366  
(8) 太平洋证券股份有限公司  
住所:云南省昆明市青年路309号志远大厦18层  
办公地址:北京市西城区北展北街9号华远企业中心D座3单元  
法定代表人:李长伟  
电话:010-88321717、18600605235  
传真:010-88321763  
联系人:唐田田  
网址:www.tpyzq.com  
客户服务电话:400-665-0999  
(7) 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668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:汤晓波  
电话:010-88066632  
联系人:申畅明  
客户服务电话:400-817-5666  
(二) 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:010-6336700  
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:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座10层  
法定代表人:朱小辉  
联系电话:010-57763888  
传真:010-57763771  
联系人:李晗  
经办律师:吴冠雄、李晗  
(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号展博大厦6楼  
办公地址:上海浦东新区世纪大道2号金茂大厦11楼  
执行事务合伙人:李勇  
联系电话:021-22328888  
传真:021-22328800  
联系人:许伟祺、赵蜀  
经办会计师:许伟祺、洪祺

四、基金的投资

本基金名称:华夏沪深300指数增强型证券投资基金

五、基金的投资目标

通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差率不超过7.75%的基础上,追求获得超越基准的指数的回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券(含中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具但须符合中国证监会相关规定。

法律法规或监管机构允许本基金投资其他基金的,本基金将按照规定的比例投资于股票投资比例不超过相应投资规模的,在不改变投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下,适度参与其他基金的投资,不需召开持有人大会。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。  
基金的投资组合比例为:本基金投资于股票组合的比例不低于非现金资产的80%,其中投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金资产的90%。

八、基金的投资策略

本基金为指数增强型基金,以沪深300指数为标的指数,基金股票投资方面将主要采用指数增强化投资策略,在严格控制跟踪误差的基础上,力求获得超越基准的指数的超额收益。

指数增强型投资策略主要指在国内外的跟踪组合投资策略,在对标的指数的成份股及其他股票基金的深入研究的基础上,运用多因子分析模型构建投资组合,同时优化交易并开展风险控制组合风险,实现超额收益。

1. 多因子模型

本基金的多因子模型以中国股票市场的宏观环境、行业及个股特征为分析框架,综合考虑各种因子在股票长期表现上所产生的超额收益,包括估值因子、财务指标因子、成长性因子、市场因子、分析师预期因子等几大类因子,每类因子分由多项指标组合而成。各类因子根据类型和效果赋予不同权重,对股票组合进行综合评价后,构建投资组合。公司量化团队将根据市场宏观环境、政策、预期等因素的变化,对模型组合进行动态调整,以保证量化模型能够紧跟市场环境,最大化程度发挥效果。

2. 风险控制与调整

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时,需要控制跟踪误差过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析,对组合跟踪效果进行预估,及时调整投资组合,力求将跟踪误差控制在目标范围内。  
本基金风险控制目标是追求日均跟踪误差率的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差率不超过7.75%。

(二) 债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利率波动策略等多种积极管理策略,通过深入的研究发现价值被低估的债券和市场化投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

(三) 股指期货投资策略

本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低展期仓位调整的交易成本,提高投资效率,从而更有效地实现投资策略。

(四) 国债期货投资策略

本基金国债期货投资,将根据风险管理的原则,充分考量国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与国债期货投资。此外,本基金还将适度投资于其他合法及合规的指数或标的的指数成份股相关的金融产品,投资目标是替代跟踪标的指数的成份股及被成份股,使基金的组合投资更接近于跟踪标的指数的指数。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金将相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+1.5% (指数收益率, 评价时按期间折算)。

未来,如法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,本基金可以变更业绩比较基准,但应当经托管人协商一致,报中国证监会备案并公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金2016年三季度报告:

“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	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	261,080,096.63	89.60
2	固定收益	261,080,096.63	89.60
3	买入返售	69,482.79	0.02
4	资产支持证券	69,482.79	0.02
5	贵金属投资	-	-
6	其他金融投资	-	-
7	其他	-	-
8	合计	261,409,066.43	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			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,704,105.60	2.43
B	制造业	78,201,713.27	28.27
D	电力、热力、燃气及生产供应业	10,369,662.66	3.91
E	建筑业	9,147,032.29	3.49
F	批发和零售业	3,814,469.82	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	10,381,304.00	3.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术业	11,006,779.33	3.96
J	金融业	94,241,767.72	35.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,000,469.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	136,407.88	0.05
N	卫生、社会保障和社会福利业	1,297,566.00	0.47
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	894,416.00	0.31
8	合计	261,409,066.43	89.67

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)
1	600138	顺鑫农业	269,600
2	600036	招商银行	400,213
3	601228	交通银行	1,265,800
4	600778	东方电气	9,314,296.00
5	601018	光大银行	1,240,200
6	601166	兴业银行	281,700
7	601398	工商银行	1,079,960
8	600033	平安银行	500,580
9	601211	国泰君安	212,800
10	600000	浦发银行	210,100

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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	公司债	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

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)
1	1100031	国开债	638
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-

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

金额单位:人民币元			
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	1100031	国开债	638
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.13 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.14 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.15 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.16 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.17 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.18 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.19 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.20 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.22 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.23 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.24 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.25 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.26 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.27 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.28 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.29 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.30 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.31 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.32 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.33 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.34 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.35 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.36 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.37 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.38 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.39 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.40 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.41 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.42 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.43 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.44 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.45 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.46 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.47 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.48 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.49 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.50 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.51 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.52 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.53 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.54 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.55 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.56 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.57 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.58 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.59 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.60 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.61 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.62 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.63 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.64 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.65 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.66 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.67 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.68 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国债期货投资

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.69 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序