（上接B107版）

办公地址:杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼
法定代表人:吴承根
电话:0571-87901053
传真:0571-87901913
联系人:谢相辉
网址:www.stocke.com.cn
客户服务电话:95345
（130）平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:谢永林
电话:021-38631117
传真:021-3383039
联系人:石静武
网址:www.pingan.com
客户服务电话:95511-8
（131）华安证券股份有限公司
住所:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人:章宏韬
电话:0551-65161666
传真:0551-65161600
联系人:范超
网址:www.hazq.com
客户服务电话:95318
（132）国海证券股份有限公司
住所:广西桂林市辅星路13号
办公地址:广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人:何春梅
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
联系人:牛孟宇
网址:www.ghzq.com.cn
客户服务电话:95563
（133）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:蔡一兵
电话:0731-84403319
传真:0731-4403349
联系人:郭磊
网址:www.cfzq.com
客户服务电话:400-883-5316
（134）东莞证券股份有限公司
住所:东莞市莞城区可园南路1号金源中心
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:张运勇
电话:0769-22115712、0769-22119348
传真:0769-22119423
联系人:李荣、孙旭
网址:www.dgzq.com.cn
客户服务电话:95328
（135）中原证券股份有限公司
住所:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
电话:0371-69099882
传真:0371-65585899
联系人:程月艳、李盼盼、党静
网址:www.ccnew.com
客户服务电话:95377
（136）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
（137）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
（138）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
（139）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:张向亮
网址:www.cnht.com.cn
客户服务电话:400-196-6188
（140）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
（141）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
（142）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
（143）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:姜映军
客户服务电话:400-832-3000
传真:0755-83199511
联系人:王雯
网址:www.csco.com.cn
（144）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10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
（145）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
（146）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:刘赠
网址:www.tebon.com.cn
客户服务电话:400-888-8128
（147）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
（148）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:96326、400-889-6326、0593-95547
（149）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）
（150）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、邱明明
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166
（151）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
（152）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:上海市黄浦区南京西路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
（153）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:021-32109999、029-68918888、400-109-9918
（154）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
（155）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:0755-83320851
传真:0755-82026942
联系人:胡正境
网址:www.china-inv.cn
客户服务电话:400-600-8008、95532
（156）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:0755-82290582
联系人:罗艺琳
网址:www.zszq.com
客户服务电话:95329
（157）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
（158）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:陈书杉、朱晓光
网址:www.rxzq.com.cn
客户服务电话:95385
（159）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
（160）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
（161）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:021-32109999、029-68918888、400-109-9918
（162）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
（163）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:邱晨
网址:www.gwgsc.com
客户服务电话:400-0099-886
（164）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
（165）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:010-85556100
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
（166）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:翟璎
网址:www.tfzq.com
客户服务电话:400-800-5000
（167）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
（168）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
（169）开源证券股份有限公司
住所:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
电话:029-88447611
传真:029-88447611
联系人:曹欣
网址:www.kysec.cn
客户服务电话:95325、400-860-8866
（170）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:路凯
电话:021-61058785
传真:021-61098515
联系人:郝勇强
网址:www.huaruisales.com
客户服务电话:400-111-5818
（171）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

基金管理人可依据有关法律法规规定或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:华夏基金管理有限公司
住所:北京市顺义区天竺空港工业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: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:上海市滨江区滨江路2202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:单峰、赵雪
经办注册会计师:单峰、赵雪

四、基金的名称

本基金名称:华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

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

采用指数化投资方式，追求对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（如股票指数期货等金融产品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）。基金持有现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数，基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可通度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在目标ETF上市之前，本基金可以股票和现金等殊申购目标ETF基金份额。

如法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于期权、期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，投资目标是更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并在报中国证监会备案后公告。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%＋1%（指年收益率，评价时应按期间折算）。

沪深300指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，其流动性高，可投资性强，综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批优质企业的整体状况，适合作为本基金跟踪的指数。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数的编制及发布、或沪深300指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他更适合投资的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。

如果今后法律法规发生变化，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的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

若基金变更投资比例范围约定，基金管理人可相应变更基金业绩比较基准的权重构成，无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人应取得基金托管人同意后，报中国证监会备案。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

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	127,108,372.58	1.18
	其中:股票	127,108,372.58	1.18
2	基金投资	10,051,177,673.18	93.27
3	固定收益投资	401,200,000.00	3.72
	其中:债券	401,200,000.00	3.72
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	25,000,000.00	0.23
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	151,341,873.68	1.40
8	其他各项资产	20,422,615.50	0.19
9	合计	10,776,250,534.94	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	10,051,177,673.18	93.37

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3.1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	367,580.00	0.00
B	采矿业	3,320,082.00	0.03
C	制造业	62,692,113.09	0.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,672,384.00	0.02
E	建筑业	3,414,427.76	0.03
F	批发和零售业	2,754,133.59	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	3,000,922.41	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,586,206.21	0.05
J	金融业	31,063,297.41	0.29
K	房地产业	6,856,725.19	0.06
L	租赁和商务服务业	2,256,759.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	743,170.01	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,140,121.21	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,240,450.70	0.01
S	综合	-	-
	合计	127,108,372.58	1.18

5.4 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	601318	中国平安	98,200	5,752,556.00	0.05
2	000333	美的集团	90,600	4,731,132.00	0.04
3	000651	格力电器	91,246	4,302,248.90	0.04
4	600519	贵州茅台	4,800	3,511,008.00	0.03
5	000858	五粮液	38,045	2,891,420.00	0.03
6	002415	海康威视	69,950	2,597,243.50	0.02
7	600036	招商银行	93,500	2,472,140.00	0.02
8	000002	万科A	92,100	2,265,660.00	0.02
9	601166	兴业银行	113,000	1,627,200.00	0.02
10	000725	京东方A	449,200	1,590,168.00	0.01

5.5 报告期末投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	401,200,000.00	3.73
	其中:政策性金融债	401,200,000.00	3.73
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	401,200,000.00	3.73

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	3,000,000	300,900,000.00	2.80
2	180201	18国开01	1,000,000	100,300,000.00	0.93
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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。
5.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.1 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。
5.11.2 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。
5.11.3 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。
5.12投资组合报告附注
5.12.1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。
5.12.2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。
5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	276,720.67
2	应收证券清算款	3,803,120.16
3	应收股利	-
4	应收利息	5,701,981.99
5	应收申购款	9,915,890.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	724,902.20
9	合计	20,422,615.50

5.12.4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。
5.12.5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。
5.12.6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。

华夏沪深300ETF联接A:

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
2009年7月10日至2009年12月31日	-0.20%	1.60%	5.50%	2.06%	-5.70%	-0.46%
2010年1月1日至2010年12月31日	-11.52%	1.51%	-10.89%	1.50%	-0.63%	0.01%
2011年1月1日至2011年12月31日	-23.44%	1.24%	-22.76%	1.23%	-0.68%	0.01%
2012年1月1日至2012年12月31日	9.47%	1.22%	8.18%	1.22%	1.29%	0.00%
2013年1月1日至2013年12月31日	-5.00%	1.33%	-6.26%	1.32%	1.26%	0.01%
2014年1月1日至2014年12月31日	50.64%	1.13%	50.08%	1.15%	0.56%	-0.02%
2015年1月1日至2015年12月31日	8.88%	2.37%	6.30%	2.36%	2.58%	0.01%
2016年1月1日至2016年12月31日	-7.98%	1.31%	-9.72%	1.33%	1.74%	-0.02%
2017年1月1日至2017年12月31日	22.62%	0.60%	21.69%	0.61%	0.93%	-0.01%
2018年1月1日至2018年6月30日	-11.53%	1.10%	-11.76%	1.10%	0.23%	0.00%

华夏沪深300ETF联接C:

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
2018年2月2日至2018年6月30日	-16.38%	1.16%	-16.04%	1.16%	-0.34%	0.00%

十三、费用概览

（一）基金运作费用
1、基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费。
（2）基金托管人的托管费。
（3）基金的销售服务费。
（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
（6）基金份额持有人大会费用。
（7）基金的证券交易费用。
（8）基金的银行汇划费用。
（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
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
本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H＝E×0.5%÷当年天数
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扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。
（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H＝E×0.1%÷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扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
（3）销售服务费
销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.3%。
各类别基金份额的销售服务费计算方法如下:
H＝E×R÷当年天数
H为各类别基金份额每日应计提的销售服务费
E为各类别基金份额前一日基金资产净值
R为各类别基金份额适用的销售服务费率
销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中划出，经登记结算机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
（4）本条第（一）款第1项中第（4）至第（8）项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
3、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
（1）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。
（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。
（3）《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用。
（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
4、费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率须召开基金份额持有人大会审议，但根据法律法规或证监会的要求提高管理费、托管费的情形除外；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。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在指定媒体和基金管理人网站上公告。
（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。
①对于A类基金份额，投资者在申购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	1.2%
100万元以上（含100万元）-500万元以下	0.9%
500万元以上（含500万元）-1000万元以下	0.6%
1000万元以上（含1000万元）	每笔1,000.00元

②本基金C类基金份额不收取申购费。
（2）本基金A类、C类基金份额收取赎回费，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。
①A类基金份额赎回费率如下:

持有期限	赎回费率
7天以内	1.5%
7天以上（含7天）-1年以内	0.5%
1年以上（含1年）	0

②C类基金份额的赎回费率如下:
赎回时份额持有不满7天的，收取1.5%的赎回费，持有满7天以上（含7天）的，赎回费为0。
③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，其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。
（3）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒体公告。
（4）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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。
（5）当发生大额申购或赎回情形时，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、目律规则的规定。
2、申购份额与赎回金额的计算方式
（1）申购份额的计算
①当投资者选择申购A类基金份额时，申购份额的计算方法如下:
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A类基金份额净值
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A类基金份额净值
②当投资者选择申购C类基金份额时，申购份额的计算方法如下:
申购份额＝申购金额/T日C类基金份额净值
基金份额按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。
例一:假定T日的A类基金份额净值为1.230元。若三笔申购金额分别为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A类基金份额计算如下:

	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）	1.2%	0.9%	0.6%
净申购金额（c=a/（1+b））	988.14	991,080.28	4,970,178.93
前端申购费（d=a-c）	11.86	8,919.72	29,821.07
T日A类基金份额净值（e）	1.230	1.230	1.230
申购份额（f=c/e）	803.37	805,756.33	4,040,795.88

若申购金额为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
T日A类基金份额净值（d）	1.230
申购份额（e=c/d）	8,129,268.29

例二:假定T日的C类基金份额净值为1.250元,投资者申购金额为5,000,000.00元,则申购获得的C类基金份额计算如下:
申购份额＝5,000,000.00/1.250＝4,000,000.00份
（2）赎回金额的计算
当投资者赎回基金份额时,赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额＝赎回份额×T日该类基金份额净值
赎回费用＝赎回总金额×赎回费率
净赎回金额＝赎回总金额－赎回费用
例三:假定某投资者在T日赎回10,000.00份A类基金份额,持有期限半年,该日A类基金份额净值为1.250元,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
净赎回金额＝12,500.00-62.50＝12,437.50元
例四:假定某投资者在T日赎回10,000.00份A类基金份额,持有2年,该日A类基金份额净值为1.225元,则其获得的赎回金额计算如下:
赎回总金额＝10,000.00×1.225＝12,250.00元
例五:假定某投资者在T日赎回10,000.00份C类基金份额,持有期限5天,该日C类基金份额净值为1.250元,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＝12,500.00×1.5%＝187.50元
净赎回金额＝12,500.00-187.50＝12,312.50元
（3）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。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。遇特殊情况,经中国