

(上接D061版)

网站:www.lczq.com
客户服务电话:400-620-6968
(82) 元元保险代理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永涛
电话:13752528013
传真:021-50701053
联系人:尹亚博
网站:http://www.xynsure.com/7100/kfxt_xybx
客户服务电话:400-080-8208
(83) 上海华夏理财投资管理有限公司
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:毛泽平
电话:-
传真:010-89066214
联系人:张鼎
网站:www.amcfund.com
客户服务电话:400-817-5666
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

3.基金管理人可根据情况变化增加或者减少基金销售机构,并另行公告。基金销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

(四) 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:宋威
(五) 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
(六) 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:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中111楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:嵇峰、赵菁
经办注册会计师:嵇峰、赵菁

四、基金名称
本基金名称:华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

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
通过目标ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。

七、基金的投资方向
本基金主要投资于目标ETF基金份额,标的指数的成份股、备选股内,为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债券)、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券品种;股指期货、权证、股票期权、国债期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

八、基金的投资策略
本基金主要采用通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的资金流情况,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目标ETF的指数成分股来跟踪标的指数。

九、基金的风险收益特征
本基金是一只基金资产中投资于目标ETF份额,以进行基金建仓。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不得超过14%。

(二) 股指期货和股票期权投资策略
为了更好地实现投资目标,基金还可投资于股指期货、股票期权、权证和其他经中国证监会允许的衍生工具。基金投资股指期货、股票期权等衍生工具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,以套期保值为目的,并更多地跟踪标的指数,实现投资目标。

十、基金的投资限制
本基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权投资决策程序,明确授权,授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

(三) 国债期货投资策略
本基金还可积极参与风险低且可控的债券回购等投资,以及国债期货投资。基金投资国债期货将本着谨慎的原则,充分考虑其流动性和风险收益特征,适度参与国债期货投资。

(四) 中小企业私募债券投资策略
在严格控风险的前提下,通过严谨的研究,综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特点,并与基金销售人员进行对比,选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时,通过期限和品种的分投策略降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。

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

十一、基金的投资业绩比较基准
本基金业绩比较基准:创业板指数收益率×95%+人民币活期存款利率×5%。

创业板指数是深交所多层次资本市场的核心指数之一,成份股由最具代表性的100家创业板上市企业股票组成,反映了创业板在市场层面的运行情况。创业板指数新兴产业、高新技术企业占比高,成长性突出。若基金标的指数发生变更,基金业绩比较基准随之变更,基金管理人应相应调整投资组合,并将业绩比较基准变更事项及时公告,无需召开基金份额持有人大会,但应取得基金托管人同意,并报中国证监会备案。

十二、基金的风险收益特征
本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险收益特征高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

十三、基金的投资组合报告
以下内容摘自本基金2019年第2季度报告:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	-
2	基金投资	123,619,834.38	92.19
3	固定收益投资	-	-
其中:国债	-	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	5,646,790.41	6.40
9	负债及未确认的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆出资金	1,827,261.53	1.39
11	合计	134,093,882.20	100.00

52.期末投资组合基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金总资产比例(%)
1	华夏创业板ETF	股票型	交易型	华夏基金管理有	123,619,834.38	94.11

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
本基金本报告期末未持有股票。

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
本基金本报告期末未持有股票。

5.5 报告期末按品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.13 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.14 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.15 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.16 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.17 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.18 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.19 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.22 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.23 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.24 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.25 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.26 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.27 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

5.28 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.29 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.30 报告期末本基金投资的股票期权持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股票期权。

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据。

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2018年8月14日至2018年12月31日	-13.62%	1.58%	-17.44%	1.67%	3.82%	-0.09%
2019年1月1日至2019年6月30日	20.89%	1.80%	19.97%	1.89%	1.01%	-0.09%

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2018年8月14日至2018年12月31日	-13.62%	1.58%	-17.44%	1.67%	3.82%	-0.09%
2019年1月1日至2019年6月30日	20.71%	1.90%	19.97%	1.89%	0.94%	-0.09%

十二、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) 标的指数的许可使用费。
- (5) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用。
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费。
- (7) 基金份额持有人大会费用。
- (8) 基金投资目标ETF的相关费用(包括但不限于目标ETF的交易费用、申购赎回费用等)。
- (9) 基金证券账户开户费、期货交易或融资融券而产生的费用(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、证券账户相关费用及其他类似性质的费用)等。
- (10) 基金的银行汇划费。
- (11) 基金收益分配中发生的费用。
- (12) 基金的开户费、账户维护费。
- (13) 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。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.50\%$ ÷ 当年天数
H为每日应计提的管理费
E为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,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5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等,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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.10\%$ ÷ 当年天数
H为每日应计提的托管费
E为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,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5个工作日内从基金财产中一次性支付。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。本基金费用分为不同类别的类别,适用不同的销售费率。其中,A类基金份额收取销售服务费,C类基金份额收取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:
 $H = E \times R \div$ 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5个工作日内从基金财产中划出,经登记机构分别支付各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

4. 标的指数的许可使用费
本基金按基金管理人向标的指数的许可人签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。本基金目前不收取指数许可使用费。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费费率等年内发生变更,基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的计提方法等相关事项。

上述“1.基金费用的种类”中第(6)-(13)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) 基金管理人及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。
- (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。

(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A类基金份额时需交纳前端申购费。

申购金额(含申购费)	申购费率
申购金额<100元	1.20%
100元≤申购金额<200元	0.00%
200元≤申购金额<500元	0.60%
500元≤申购金额<1,000元	0.60%

(2) 投资者在申购A类基金份额时不收取申购费。

③对于持有基金份额满30天,且未赎回的C类基金份额,赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。

A类基金份额赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
持有时间<7天	1.50%
7天≤持有时间≤1年	0.50%
持有时间≥1年	0

其中,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费及其他必要的费用。对于赎回时间持有不满7天的,收取的赎回费计入基金财产。

C类基金份额赎回费率如下:

持有时间	赎回费率
持有时间<7天	1.50%
7天≤持有时间≤30天	0.10%
持有时间≥30天	0

收取的赎回费全额计入基金财产。

(4) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(5) 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业绩比较基准,并适时调整或变更。基金管理人有权根据法律法规规定,在不损害基金份额持有人利益的前提下,对基金业绩比较基准进行调整。

(6) 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、自律规则的规定。

2. 申购份额与赎回金额的计算方式
(1) 申购份额的计算
①申购份额的计算
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=申购金额×申购费率
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

申购费用=申购金额×申购费率
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额净值

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:

申购费用=申购金额×申购费率
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购份额=净申购金额/申购当日C类基金份额净值

②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1.2300元,投资者申购金额为1,000.00元,100万元,200万元和500万元,则各笔申购份额的前端申购费用和获得的A类基金份额计算如下:

2、申购份额与赎回金额的计算方式

(1) 申购份额的计算

① 申购份额的计算

若该投资者申购金额为500万元,则申购费占前端申购费用和获得的A类基金份额计算如下:

申购4	申购5
申购金额(元,A)	5,000,000.00
适用申购费率(a)	0.00%
净申购金额=(a/(1+a))	5,000,000.00
前端申购费=(a-a/(1+a))	0.00
A类基金份额净值(e)	1.2300
申购份额=(净申购金额/e)	4,064,227.64

例二:假定T日的C类基金份额净值为1.2500元,投资者申购金额为5,000,000.00元,则申购费占前端申购费用和获得的C类基金份额计算如下:

申购费用=5,000,000.00×0.12500=6,250.00元
净申购金额=5,000,000.00-6,250.00=4,993,750.00元
申购份额=净申购金额/申购当日C类基金份额净值=4,993,750.00/1.2500=3,995,000.00份

例三:假定该投资者在T日赎回1,000份A类基金份额,持有期限30天,该日基金份额净值为1.2500元,则其获得的赎回金额计算如下:

赎回总金额=1,000.00×1.2500=1,250.00元
赎回费用=1,250.00×0.5%=6.25元
净赎回金额=1,250.00-6.25=1,243.75元

例四:假定该投资者在T日赎回1,000份C类基金份额,持有期限30天,该日基金份额净值为1.2500元,则其获得的赎回金额计算如下:

净赎回金额=1,000.00×1.2500=1,250.00元
赎回费用=1,250.00×0.1%=1.25元
净赎回金额=1,250.00-1.25=1,248.75元

(3) 本基金份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。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,遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(4) 基金转换费用
①基金转换费用:转出基金份额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,还需收取赎回时应收

的后端申购费。转换金额指扣除赎回费与后端申购费(若有)后的余额,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。

③(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: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”中例四。

④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。

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。

⑤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: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”中例七。

⑥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: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”中例八。

⑦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。

⑧从后端收费基金转出,转入其他后端(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后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。

⑨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不收取申购费用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:收取的申购费用=固定费用—转换金额×转出基金的销售费率×转出基金的持有时间(单位为年),最低为0。