（上接B061版）

联系人：戴蕾
网址：www.avicsec.com
客户服务电话：400-886-6567
（55）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
（56）华龙证券有限责任公司
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：0931-4890619、4890618、4890100
（57）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
（58）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：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
电话：021-64339000-807
传真：021-64333051
联系人：陈敏
网址：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999、029-68918888、400-109-9918
（59）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
（60）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：龙增来
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
联系人：刘毅
网址：www.china-invs.cn
客户服务电话：400-600-8008、95532
（61）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
（62）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：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：400-881-1177
（63）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
（64）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：028-86690070
传真：028-86690126
联系人：刘一宏
网址：www.gjzq.com.cn
客户服务电话：95105111（四川地区）、400-660-0109（全国）
（65）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
（66）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
（67）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区月坛北街26号
办公地址：北京西城区金融大街8号A座3层、5层
法定代表人：祝歇忠
电话：010-58568235
传真：010-58568062
联系人：黄恒
网址：www.hrsec.com.cn
客户服务电话：010-58568118
（68）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：028-86711410、027-87618882
（69）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
（70）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
（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12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
本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市延安东路222号30楼
办公地址：中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城德勤大楼8层
法定代表人：卢伯卿
联系电话：010-85207788
传真：010-85181218
联系人：吕静

四、基金的名称

本基金名称：华夏沪深300指数增强型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式基金。

六、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年跟踪误差不超过7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。

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或中国证监会允许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基金投资其他基金的，本基金将按照届时的相关规定设置投资比例限制并制定相应投资策略，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下，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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，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基金资产的80%，其中投资于相关标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于非现金资产的80%。

八、基金的投资策略

（一）股票投资策略

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量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成分股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，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、行业及个股特性为分析框架，综合测试各类因子在股票长期表现上所产生的超额收益，包括估值因子、财务质量因子、成长因子、市场因子、分析师预期因子等几大类因子，每类因子分别由多项指标组合而成。各类因子根据其类型和效果赋予不同的权重，对股票组合进行综合评价后，构建出投资组合。公司量化团队将根据市场宏观环境、政策、预期等信息的变化，对模型结构进行动态调整，以保证量化模型能够紧跟市场环境，最大程度发挥效果。

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，需要控制跟踪偏离过大的风险。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0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。

（二）债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，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，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

（四）国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑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基金以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，投资目标是替代跟踪标的指数的成份股及被选成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。

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

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准＝95%×沪深300指数收益率＋1.5%（指年收益率，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，但应与托管人协商一致，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，属于较高预期风险、较高预期收益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2015年第2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	308,401,878.41	80.80
	其中：股票	308,401,878.41	80.80
2	固定收益投资	91,545.30	0.02
	其中：债券	91,545.30	0.02
	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	68,463,114.85	17.94
7	其他各项资产	4,741,750.32	1.24
8	合计	381,698,288.88	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	189,112.00	0.06
B	采矿业	13,265,046.40	3.99
C	制造业	104,638,366.52	31.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,907,456.00	3.58
E	建筑业	12,665,993.50	3.81
F	批发和零售业	11,352,968.00	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	12,920,301.00	3.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,577,645.00	4.08
J	金融业	102,250,128.40	30.74
K	房地产业	16,192,383.32	4.87
L	租赁和商务服务业	917,775.48	0.28
M	科学研究和技术服务业	158,573.52	0.05
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,070,720.27	1.52
S	综合	3,295,409.00	0.99
	合计	308,401,878.41	92.72

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	601318	中国平安	185,000	15,158,900.00	4.56
2	600036	招商银行	601,513	11,260,323.36	3.39
3	600016	民生银行	1,068,658	10,622,460.52	3.19
4	600837	海通证券	470,500	10,256,900.00	3.08
5	601166	兴业银行	474,600	8,186,850.00	2.46
6	600000	浦发银行	471,387	7,994,723.52	2.40
7	300059	东方财富	105,500	6,655,995.00	2.00
8	601398	工商银行	1,145,400	6,047,712.00	1.82
9	601688	华泰证券	249,700	5,775,561.00	1.74
10	000002	万科A	387,591	5,627,821.32	1.69

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	91,545.30	0.03
8	其他	-	-
9	合计	91,545.30	0.03

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	110031	航信转债	630	91,545.30	0.03
2	-	-	-	-	-
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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）（单位：手）	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1507	IF1507	3	3,939,120.00	-121,320.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1508	IF1508	2	2,619,120.00	-265,800.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计				-387,120.00	
股指期货投资本期收益				4,172,834.00	
股指期货投资本期公允价值变动				-379,434.00	

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	1,016,958.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,259.41
5	应收申购款	3,715,532.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,741,750.32

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。

（一）华夏沪深300指数增强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
2015年2月10日至2015年6月30日	35.30%	2.15%	32.58%	2.14%	2.72%	0.01%

（二）华夏沪深300指数增强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
2015年2月10日至2015年6月30日	35.00%	2.15%	32.58%	2.14%	2.42%	0.01%

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）标的指数许可使用费。

（5）基金上市初费及年费（如有）。

（6）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。

（7）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。

（8）基金分红费。

（9）基金的证券交易费用(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、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等)。

（10）基金的银行汇划费用。

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的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0 %÷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

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给基金管理人。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的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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0.5%。

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

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中划出，经登记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）标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.016%÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费每日计算，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。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方法。

上述"一、基金费用的种类"中第5－10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。

（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）对于A类基金份额，投资者在申购时需交纳前端申购费。本基金对通过基金管理人的直销中心申购A类份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

①通过基金管理人的直销中心申购A类份额的养老金客户申购费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	0.24%
100万元以上（含100万元）-200万元以下	0.16%
200万元以上（含200万元）-500万元以下	0.08%
500万元以上（含500万元）-1000万元以下	0.04%
1000万元以上(含1000万元)	每笔1,000.00元

②其他投资者申购A类基金份额的申购费率如下：

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）-200万元以下	0.8%
200万元以上（含200万元）-500万元以下	0.4%
500万元以上（含500万元）-1000万元以下	0.2%
1000万元以上(含1000万元)	每笔1,000.00元

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。

（2）本基金C类基金份额不收取申购费。

（3）A类、C类基金份额均收取赎回费，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）-30天以内	0.75%
30天以上（含30天）-1年以内	0.5%
1年以上（含1年）	0

对于赎回时份额持有不满30天的，收取的赎回费全额计入基金财产；对于赎回时份额持有满30天不满3个月收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对于赎回时份额持有满3个月不满6个月收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对赎回时份额持有期长于6个月（含6个月）收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%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、赎回费率。

2、申购份额的计算方式

（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：

①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A类份额净值

②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

（3）上述计算结果按照四舍五入方法，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日基金的A类基金份额净值为1.230元，某投资者（非养老金客户）四笔申购金额分别为1,000.00元、100万元、200万元、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4
申购金额（元,a）	1,000.00	1000,000.00	2,000,000.00	5,000,000.00
适用前端申购费率（b）	1.2%	0.8%	0.4%	0.20%
净申购金额（c=a/（1+b））	988.14	992,063.49	1,992,031.87	4,990,019.96
前端申购费（d=a-c）	11.86	7,936.51	7,968.13	9,980.04
该类基金份额净值（e）	1.230	1.230	1.230	1.230
申购份额（=c/e）	803.37	806,555.68	1,619,538.11	4,056,926.80

若该投资者申购金额为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5
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
该类基金份额净值（d）	1.230
申购份额（e=c/d）	8,129,268.29

例二：假定T日基金的C类基金份额净值为1.200元，某投资者申购金额为10万元，则申购获得的基金份额计算如下：

申购份额＝100,000.00/1.200=83,333.33份

3、赎回金额的计算方式

（1）当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回金额＝赎回份额×T日该类别基金份额净值

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

（2）上述计算结果按照四舍五入方法，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。

例三：假定某投资者在T日赎回10,000份A类（或C类）基金份额，该日A类（或C类）基金份额净值为1.230元，持有期限分别为6天、29天、半年和一年，则其获得的赎回金额计算如下：

	赎回1	赎回2	赎回3	赎回4
赎回份额（份,a）	10,000.00	10,000.00	10,000.00	10,000.00
该类基金份额净值（元,b）	1.230	1.230	1.230	1.230
赎回金额（c=a*b）	12,300.00	12,300.00	12,300.00	12,300.00
持有期限	6天	29天	半年	1年
适用赎回费率（d）	1.5%	0.75%	0.5%	0
赎回费用（e=c*d）	184.50	92.25	61.50	0
净赎回金额（f=c-e）	12,115.50	12,207.75	12,238.50	12,300.00

（3）本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，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：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。

（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，且转出基金和转入基金的申购费率均适用固定费用。

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"中例七。

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"中例八。

9 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：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。

11 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。

12 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。

13 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。

14 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。

15 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。

16 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。

17 对于多笔不收取申购费用的基金份额转出情况的补充说明

上述为处理申（认）购时间不同的多笔基金份额转出的情况，对转出不收取申购费用的基金的持有时间规定如下：

（i）对于货币型基金（目前包括华夏现金增利货币、华夏货币、华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币）和不收取赎回费用的债券型基金（目前包括华夏债券C），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）

（ii）对于除上述（i）中五只基金外的不收取申购费用的基金，其持有时间为本次转出委托中多笔份额的加权平均持有时间。

（4）上述费用另有