(上接B079版)

联系人:张腾
网址:www.hfzq.com.cn
客户服务电话:0591-96326
(121)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
(122)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
(123)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:0571-96336
(124)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:021-54967203
传真:021-54967293
联系人:王涓
网址:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999、029-68918888、400-109-9918
(125)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
(126)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:0755-82023442
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
(127)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
(128)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
(129)日信证券有限责任公司
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:孔伯杰
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:010-88086830
(130)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:0752-2119700
联系人:彭蓬
网址:www.lxsec.com
客户服务电话:95564
(131)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
(132)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:四川省成都市东城根上街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
(133)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
(134)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
(135)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:福建省厦门市莲前西路2号莲富大厦十七层
法定代表人:王勇
电话:0592-5161642、15880287470
传真:0592-5161140
联系人:卢金文
网址:www.xmzq.cn
客户服务电话:0592-5163588
(136)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
(137)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
(138)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:028-86711410、027-87618882
(139)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
(140)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:唐昌旧
网址:www.tpyzq.com
客户服务电话:400-665-0999
(141)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:上海市虹口区东大名路687号一幢二楼268室
法定代表人:洗晓东
电话:010-88006632
联系人:仲秋玥
客户服务电话:400-817-5666
基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市。

(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:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座十二层
负责人:王丽
联系电话:010-52682888
传真:010-52682999
联系人:李晓明
经办律师:徐建军、李晓明
(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号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)16层
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
执行事务合伙人:毛鞍宁
联系电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:汤骏
经办注册会计师:汤骏、濮晓达

四、基金的名称
本基金名称:华夏希望债券型证券投资基金。

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:在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收入和总回报。

七、基金的投资方向
本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债券、资产支持证券等。本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具(含可转债);本基金还可投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但上述非固定收益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的20%。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%。此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略
基金将坚持稳健投资,在严格控制风险的基础上,追求较高的当期收入和总回报。
(一)稳健资产配置
本基金80%以上的基金资产投资于债券类金融工具,本基金股票投资比例上限不超过20%,一般情况下保持在10%左右,以便控制市场波动风险。随着股票市场的波动,基金管理人还将采取风险预算策略,在市场上涨幅度较大时止赢,在市场下跌较快时止损,以追求绝对回报为目标。
(二)债券投资策略
本基金将在保持组合低波动性的前提下,运用多种积极管理增值策略,追求绝对回报。绝对回报投资组合的目标在于资本金保值、持续性地以绝对正回报的方式实现增值。
1.久期调整策略
本基金将根据对利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益,在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。
2.收益率曲线策略
在久期确定的基础上,根据对收益率曲线形状变化的预测,采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行配置,以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
3.债券类属配置策略
根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。其中,随着债券市场的发展,基金将加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资,主要通过信用风险的分析和管理,获取超额收益。
4.骑乘策略
通过分析收益率曲线各期限段的利差情况(通常是收益率曲线短端的1-3年,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着基金持有债券时间的延长,债券的剩余期限将缩短,到期收益率将下降,基金从而可获得资本利得收入。
5、相对价值策略
相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差等。金融债与国债的利差由税收因素形成,利差的大小主要受市场资金供给充裕程度决定,资金供给越充分上述利差将越小。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必渐加强,两市之间的利差能够提供一些增值机会。
6、信用利差策略
企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响,相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动,另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。
7、回购放大策略
该策略在资金相对充裕的情况下是风险很低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作,同时选择2年以下的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。
8、可转债投资策略
可转债不同于一般的企业债券,其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利,因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债,主要目标是降低基金净值的下行风险,基金投资的可转债可以转股,以保留参与股票升值的收益潜力。
(1)积极管理策略
可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金将采取积极管理策略,重视对可转债对应股票的分析与研究,选择那些公司行业景气趋势回升、成长性好、估值水平偏低或合理的转债进行投资,以获取收益。
(2)一级市场申购策略
目前,可转债均采取定价发行,对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债,因供求不平衡,会产生较大的一、二级市场价差。因此,为增加组合收益,本基金将在充分研究的基础上,参与可转换债券的一级市场申购,在严格控制风险的前提下获得稳定收益。
9、资产支持证券投资策略
对于资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。
(三)股票投资策略
1、新股申购策略
在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差,从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出。
2、个股精选策略
本基金将主要采取自下而上的个股精选策略,投资于具备稳定内生增长、能给股东创造经济价值(EVA)的股票。基金将以超额收益(α值)为目标,利用"多因素选股模型",综合考察股票所属行业发展前景、上市公司行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素,挑选出预期表现将超过大盘的个股,构建核心组合。
3、组合动态调整策略
本基金将根据市场波动性及其走向趋势,采用时间平均法调整建仓节奏,控制建仓成本,同时设置止赢止损点,在组合获利达到既定目标时及时兑现,以实现基金每年的绝对收益目标。
基金在构建股票组合时,会根据最近一段时间市场走势,预先设定建仓节奏。如市场振荡较大时,基金将放慢建仓节奏,如市场趋势明显、振荡不大时,基金将加快建仓节奏。时间平均法可有效控制建仓成本,降低组合波动。另外,基金将监控股票组合的表现,根据对市场走势和宏观经济的预期,预先设定组合止赢点,在止赢点附近,基金将部分变现,降低股票仓位,以兑现收益。
(四)权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。
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组合投资策略。

九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:中证综合债券指数。
中证综合债券指数是由中证指数公司编制,该指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,具有广泛的市场代表性,适合作为本基金的业绩比较基准。
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债券指数时,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。

十、基金的风险收益特征
本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告
以下内容摘自本基金2015年第4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	280,680,142.89	7.45
	其中:股票	280,680,142.89	7.45
2	固定收益投资	3,103,213,480.80	82.40
	其中:债券	3,098,146,648.80	82.27
	资产支持证券	5,066,832.00	0.13
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	2.66
	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	203,299,465.79	5.40
7	其他各项资产	78,715,300.63	2.09
8	合计	3,765,908,390.11	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	5,057,700.00	0.14
B	采矿业	4,592,500.00	0.13
C	制造业	165,301,003.76	4.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,990,900.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,717,583.78	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	4,439,300.00	0.12
H	住宿和餐饮业	2,006,142.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,066,750.00	0.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,797,550.00	0.52
L	租赁和商务服务业	19,079,996.85	0.52
M	科学研究和技术服务业	7,976,920.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	9,540,946.50	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,054,050.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	58,800.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	280,680,142.89	7.69

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	600584	长电科技	417,500	9,577,450.00	0.26
2	600240	华业资本	615,000	9,255,750.00	0.25
3	002355	兴民钢圈	429,000	8,605,740.00	0.24
4	002094	青岛金王	226,568	7,057,593.20	0.19
5	000530	大冷股份	330,000	6,263,400.00	0.17
6	000910	大亚科技	375,000	6,202,500.00	0.17
7	600618	氯碱化工	360,000	5,810,400.00	0.16
8	300098	高新兴	270,000	5,667,300.00	0.16
9	002378	章源钨业	450,000	5,418,000.00	0.15
10	002601	佰利联	136,000	5,298,560.00	0.15

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	723,953,000.00	19.84
	其中:政策性金融债	723,953,000.00	19.84
4	企业债券	1,451,409,947.00	39.78
5	企业短期融资券	221,478,000.00	6.07
6	中期票据	698,392,000.00	19.14
7	可转债(可交换债)	2,913,701.80	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,098,146,648.80	84.92

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	150419	15农发19	1,600,000	160,304,000.00	4.39
2	011515006	15中铝业SCP006	1,500,000	150,885,450.00	4.14
3	101463006	14石国投MTN002	1,200,000	141,816,000.00	3.89
4	150416	15农发16	1,000,000	100,230,000.00	2.75
5	1080181	10南宁城投债	800,000	89,856,000.00	2.46

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	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119031	澜沧江3	100,000	5,066,832.00	0.14
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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 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	639,332.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,345,117.25
5	应收申购款	6,730,850.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,715,300.63

5.11.4 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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	9,577,450.00	0.26	重大事项

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)华夏希望债券(A类)

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
2008年3月10日至2008年12月31日	11.23%	0.16%	8.01%	0.11%	3.22%	0.05%
2009年1月1日至2009年12月31日	8.94%	0.34%	0.27%	0.06%	8.67%	0.28%
2010年1月1日至2010年12月31日	3.49%	0.22%	2.00%	0.07%	1.49%	0.15%
2011年1月1日至2011年12月31日	-2.21%	0.21%	3.79%	0.06%	-6.00%	0.15%
2012年1月1日至2012年12月31日	7.55%	0.10%	4.03%	0.04%	3.52%	0.06%
2013年1月1日至2013年12月31日	1.27%	0.13%	1.78%	0.05%	-0.51%	0.08%
2014年1月1日至2014年12月31日	13.56%	0.25%	9.41%	0.16%	4.15%	0.09%
2015年1月1日至2015年12月31日	14.38%	0.36%	6.16%	0.07%	8.22%	0.29%

(二)华夏希望债券(C类)

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
2008年3月10日至2008年12月31日	11.03%	0.16%	8.01%	0.11%	3.02%	0.05%
2009年1月1日至2009年12月31日	8.58%	0.34%	0.27%	0.06%	8.31%	0.28%
2010年1月1日至2010年12月31日	3.15%	0.22%	2.00%	0.07%	1.15%	0.15%
2011年1月1日至2011年12月31日	-2.51%	0.21%	3.79%	0.06%	-6.30%	0.15%
2012年1月1日至2012年12月31日	7.23%	0.11%	4.03%	0.04%	3.20%	0.07%
2013年1月1日至2013年12月31日	0.99%	0.13%	1.78%	0.05%	-0.79%	0.08%
2014年1月1日至2014年12月31日	13.26%	0.25%	9.41%	0.16%	3.85%	0.09%
2015年1月1日至2015年12月31日	14.05%	0.36%	6.16%	0.07%	7.89%	0.29%

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)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和律师费;
(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的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.7%÷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
销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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。
(4)本条第(一)款第1项中第(4)至第(9)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,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日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
(二)与基金销售有关的费用
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,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%
100万元以上(含100万元)-500万元以下	0.8%
500万元以上(含500万元)-1000万元以下	0.5%
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)本基金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。赎回时份额持有不满60天的,收取0.1%的赎回费,持有满60天以上(含60天)的,赎回费为0。其中,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。
(4)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个工作日在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。
(5)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,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(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。
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
③申购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日基金的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、100万元和500万元,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)	1.0%	0.8%	0.5%
净申购金额(c=a/(1+b))	990.10	992,063.49	4,975,124.38
前端申购费(d=a-c)	9.90	7,936.51	24,875.62
该类基金份额净值(e)	1.230	1.230	1.230
申购份额(f=c/e)	804.96	806,555.68	4,044,816.57

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
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,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元
(2)赎回金额的计算
①当投资者赎回A类基金份额时,赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日A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
②当投资者赎回C类基金份额时,赎回金额的计算方法如下:
赎回总金额=赎回份额×T日C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份A类基金份额,持有期限10天,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=12,500.00×0.1%=12.50元
净赎回金额=12,500.00-12.50=12,487.50元
例四:假定某投资者在T日赎回10,000份C类基金份额,持有60天,该日C类基金份额净值为1.225元,则其获得的赎回金额计算如下:
赎回金额=10,000.00×1.225=12,250.00元
③T日的基金份额净值在当日收市后计算,并在T+1日公告。各个基金份额类别单独计算基金份额净值,计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。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。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。
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,转入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。
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