

Disclosure

信息披露

【上接B229版】

法定代表人:刘学民
电话:0755-23831754
传真:0755-23839760
联系人:毛诗莉
网址:www.finstatep.com.cn
客户服务热线:400-888-1888
(90)金元证券股份有限公司
住所:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
联系人:马露露
网址:www.yzq.cn
客户服务热线:400-888-8222
(100)中航证券有限公司
住所:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A座41层
法定代表人:王宜四
电话:0791-86779681
传真:0791-86770178
联系人:刘斌
网址:www.avicsec.com
客户服务电话:400-886-6567
(101)华林证券有限责任公司
住所:深圳市福田区益田路703号华融大厦5、6层
办公地址:深圳市福田区益田路703号华融大厦5、6层
法定代表人:蔡荣生
电话:0755-82673785
传真:0755-23717551
联系人:杨涛
网址:www.chinalions.com
客户服务电话:400-188-3888
(102)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路502号招商国际中心20楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心20楼
法定代表人:李文平
电话:021-68701888-9076
传真:021-68767032
联系人:刘刚
网址:www.tobon.com.cn
客户服务电话:400-888-9123
(103)西藏证券有限责任公司
住所:陕西省西安市东大街16号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:陕西省西安市东大街16号陕西信托大厦16-17楼
法定代表人:刘建武
电话:029-87417129
传真:029-87442426
联系人:刘霞
网址:www.twestsec.com
客户服务电话:95682
(104)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:0591-87382632
传真:0591-87383110
联系人:张辉
网址:www.hfq.com.cn
客户服务电话:0591-96326
(105)华龙证券有限责任公司
住所:甘肃省兰州市静宁路300号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路300号
法定代表人:李晓安
电话:0931-4890100
传真:0931-4890100
联系人:李强
网址:www.hlzqgs.com
客户服务电话:0901-4890619,4890618,4890100
(106)中国国际金融股份有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦27层及28层
法定代表人:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65051165
联系人:罗春香,洪明
网址:www.cicc.com.cn
客户服务电话:010-65051166
(107)嘉实证券有限责任公司
住所:杭州市拱墅区大钱路15号嘉实国际商务中心
办公地址:杭州市拱墅区大钱路15号嘉实国际商务中心
法定代表人:刘军
电话:0571-87926129
传真:0571-87183289
联系人:夏吉壮
网址:www.jszq.com.cn
客户服务电话:0571-96336
(108)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04层01,02,03,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23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层及21层
法定代表人:高涛
电话:400-8222442
传真:0755-82026539
联系人:刘璇
网址:www.china-invs.cn
客户服务电话:400-800-9000,95532
(109)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一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:彭海
网址:www.lxsec.com
客户服务电话:95664
(110)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:孙扬
电话:0451-86867319
传真:0451-82287211
联系人:刘莹
网址:www.jhzq.com.cn
客户服务电话:400-666-2288
(111)国信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路2028号国信大厦99号
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号
法定代表人:何云
电话:028-8669057,028-86690058
传真:028-86690122
联系人:刘娟娟,贾翔
网址:www.guizq.com.cn
客户服务电话:95313
(112)申银万国证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街50号新盛大厦A座6层-9层
办公地址:北京市西城区金融大街50号新盛大厦A座6层-9层
法定代表人:储晓明
电话:010-88095632
联系人:仲伟君
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,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并在公告、销售机构予以根据情况变化增加或者减少其销售机构(网点)。
(二)登记结算机构名称:华夏基金管理有限公司
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:010-63760680
联系人:宋斌
(三)律师事务所名称:北京国枫律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12-16层
办公地址:北京市西城区东长安街19号富凯大厦B座12-16层
负责人:王丽
联系电话:010-50932888
传真:010-50928200
联系人:李娜
经办律师:李志宏、李娜
(四)会计师事务所名称:大华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东塔楼A座16层
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东塔楼A座16层
负责人:李波
经办注册会计师:汤爽、魏晓达

五、基金名称

本基金名称:华夏经典配置混合型证券投资基金
基金简称:华夏经典配置混合

本基金类别:契约开放式

六、基金的投资目标

在长期投资的基础上,将战略资产配置与战术选择相结合,积极主动地精选优质标的,并适时进行择时操作,力争在承担适度风险的前提下,实现基金资产的长期增值。
本基金的投资范围:具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行的股票、债券、货币金融工具、资产支持证券、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围为所有在国内依法发行的、具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括国债和央行票据两个市场品种。金融债、企业债与可转债、债券投资品种与短期金融工具投资品种重叠。短期金融工具则包括期限在一年以内的债券、债券回购、央行票据、各类银行存款等;经证监会、人民银行等有关部门批准后本基金还可以投资于境外市场流动性较好的投资品种。
-35%。资产支持证券20%-40%,权证0-3%。保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。具体资产配置比例由基金经理人根据对市场的判断或主动调整,以求基金资产在三类资产配置中达到风险和收益的平衡。本基金资产配置不受上述比例限制,在法律法规有规定的情况下,基金管理人可对上述比例适度调整。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略
本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式,主动管理,遵循积极主动的投资理念,依据国家有关法律、法规和基金合同的约定,动态调整宏观、国家政策和市场周期对资产配置的影响,根据宏观经济、行业景气度、政策预期、市场估值、短期金融工具的比例进行动态调整。长期而言,本基金将以宏观经济总体运行和市场中期分析为基础,根据产品定位,通过资产类别配置策略主动调整资产配置。短期内,本基金将根据宏观经济周期中政策、主题的轮动变化,把握市场结构性行情,把握市场热点,进行灵活的资产配置。同时充分利用短期金融工具,作为对资产配置调整的有效缓冲及收益补充。

(二)股票投资策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式,主动管理,遵循积极主动的投资理念,依据国家有关法律、法规和基金合同的约定,动态调整宏观、国家政策和市场周期对资产配置的影响,根据宏观经济、行业景气度、政策预期、市场估值、短期金融工具的比例进行动态调整。长期而言,本基金将以宏观经济总体运行和市场中期分析为基础,根据产品定位,通过资产类别配置策略主动调整资产配置。短期内,本基金将根据宏观经济周期中政策、主题的轮动变化,把握市场结构性行情,把握市场热点,进行灵活的资产配置。同时充分利用短期金融工具,作为对资产配置调整的有效缓冲及收益补充。

(三)债券投资策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式,主动管理,遵循积极主动的投资理念,依据国家有关法律、法规和基金合同的约定,动态调整宏观、国家政策和市场周期对资产配置的影响,根据宏观经济、行业景气度、政策预期、市场估值、短期金融工具的比例进行动态调整。长期而言,本基金将以宏观经济总体运行和市场中期分析为基础,根据产品定位,通过资产类别配置策略主动调整资产配置。短期内,本基金将根据宏观经济周期中政策、主题的轮动变化,把握市场结构性行情,把握市场热点,进行灵活的资产配置。同时充分利用短期金融工具,作为对资产配置调整的有效缓冲及收益补充。

(四)衍生品投资策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的方式,主动管理,遵循积极主动的投资理念,依据国家有关法律、法规和基金合同的约定,动态调整宏观、国家政策和市场周期对资产配置的影响,根据宏观经济、行业景气度、政策预期、市场估值、短期金融工具的比例进行动态调整。长期而言,本基金将以宏观经济总体运行和市场中期分析为基础,根据产品定位,通过资产类别配置策略主动调整资产配置。短期内,本基金将根据宏观经济周期中政策、主题的轮动变化,把握市场结构性行情,把握市场热点,进行灵活的资产配置。同时充分利用短期金融工具,作为对资产配置调整的有效缓冲及收益补充。

(五)基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:60%×沪深300指数+20%×一年定期存款利率

本基金业绩比较基准的选取,综合考虑了本基金的投资目标和投资范围,以及本基金资产配置策略、收益和风险特征等因素,力求客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

九、基金的风险收益特征

本基金为追求资产增值的混合型基金,风险和收益高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。本基金追求资产配置动态平衡,收益和风险与本基金持仓资产相匹配。

十、基金的投资组合报告

以下内容为报告期末基金2015年第四季度报告:

“5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	999,127,303.54	67.93
2	其中:股票	999,127,303.54	67.93
3	债券投资	368,076,200.00	24.87
4	其中:国债	368,076,200.00	24.87
5	资产支持证券	-	-
6	货币市场投资	-	-
7	衍生金融资产	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其他	54,801,327.87	3.78
10	合计	1,462,104,606.22	100.00

“5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	16,700,000.00	1.14
B	采矿业	702,418,968.47	47.77
C	制造业	13,296,816.81	0.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,296,000.00	3.50
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	76,055,511.66	5.19
H	住宿和餐饮业	99,709,000.00	6.77
J	金融业	31,895,000.00	2.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	31,774,400.00	2.16
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	-	-
S	其他	16,212,000.00	1.14
合计		999,127,303.54	67.93

“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

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	601398	工商银行	10,500,000	85,200,000.00	5.81
2	000021	深万科A	2,000,000	33,400,000.00	2.28
3	000028	万科H股	87,500	28,100,000.00	1.90
5	002036	华谊兄弟	1,400,000	24,700,000.00	1.68
6	300011	向日葵A	30,000	23,840,000.00	1.62
7	002027	海康电子	1,534,200	23,519,200.00	1.60
8	300066	惠尔药业	559,500	20,579,100.00	1.40
9	300147	津滨发展	300,000	20,200,000.00	1.38
10	600004	中国铝业	39,470,000	19,400,000.00	1.32

“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五名债券投资

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债	112,767,200.00	7.72
2	企业债	-	-
3	金融债	209,297,000.00	14.01
4	其中:政策性金融债	209,297,000.00	14.01
5	公司债	40,152,000.00	2.73
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	262,056,200.00	17.81

“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资产支持

序号	资产支持证券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏银行	1,100,000	0.07
2	交通银行	1,000,000	0.07
3	建设银行	51,000,000	3.47
4	招商银行	40,000,000	2.73
5	浦发银行	30,000,000	2.07

“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贵金属投资

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,100,000	112,000,000.00	7.72
2	铂金	1,000,000	112,000,000.00	7.72
3	钯金	1,000,000	112,000,000.00	7.72
4	其他	-	-	-
5	合计	-	-	-

“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

序号	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	1,100,000	112,000,000.00	7.72
2	铂金	1,000,000	112,000,000.00	7.72
3	钯金	1,000,000	112,000,000.00	7.72
4	其他	-	-	-
5	合计	-	-	-

“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

序号	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏银行	1,100,000	112,000,000.00	7.72
2	交通银行	1,000,000	112,000,000.00	7.72
3	建设银行	51,000,000	51,000,000.00	3.47
4	招商银行	40,000,000	40,000,000.00	2.73
5	浦发银行	30,000,000	30,000,000.00	2.07

“5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

“5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

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国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

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国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.17 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

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国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.19 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

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国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

“5.23 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

十一、费用概览

(一)与基金运作有关费用
基金运作有关费用包括:基金管理人管理费、基金托管人托管费;基金合同生效后基金信息披露费用;基金合同生效后与基金相关的会计师费用;基金份额持有人大会费用;基金证券交易费用;以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

1.基金管理费
本基金管理费按本基金前一日资产净值乘以15%管理费率逐日计算,计算方法如下:
基金每日应计的基金管理费=前一日基金的资产净值×15%÷当年实际天数

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月末,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,基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2.基金托管费
本基金托管费按本基金前一日资产净值乘以0.25%托管费率逐日计算,计算方法如下:
基金每日应计的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年实际天数

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月末,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,基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(二)与基金销售有关费用
(1)本基金申购费率不超过申购金额的1.5%,具体费率如下:

申购费率	申购金额	申购费率
0.00%	100元(含)以下	1.50%
0.10%	100元(含)以上-500元(含)	1.2%
0.15%	500元(含)以上-1000元(含)	1.0%
0.20%	1000元(含)以上	0.8%

(2)本基金赎回费率不超过赎回金额的1.5%,赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减,具体费率如下:

持有期限	赎回费率	持有期限	赎回费率
持有期限<7天	0.75%	持有期限<30天	0.50%
7天<=持有期限<30天	0.50%	30天<=持有期限<90天	0.35%
90天<=持有期限<180天	0.25%	180天<=持有期限<360天	0.15%
360天<=持有期限	0.10%		

(3) 本基金的申购费用由基金申购人承担, 归基金管理人及代销机构所有, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用, 赎回费用由基金赎回人承担, 赎回费用按赎回时适用的费率收取, 所收取赎回费的25%归入基金资产, 其余部分作为登记结算费及其他手续费支付。

(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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(6) 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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(7) 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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(8) 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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(9) 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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(10) 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和调整申购费率、赎回费率, 并在更新中列示, 上述费率如发生变更, 基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。