

华夏新经济灵活配置混合型发起式证券投资基金招募 说明书（更新）摘要

2017 年第 2 号

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

华夏新经济灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称本基金）已经中国证监会 2015 年 7 月 10 日证监许可[2015]1583 号文准予注册。本基金基金合同于 2015 年 7 月 13 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，

由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基

金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金

合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 7 月 13 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2017 年 6 月 30 日。（本招募说明书中的财务资料未经审计）

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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

设立日期：1998 年 4 月 9 日

法定代表人：杨明辉

联系人：李彬

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元，公司股权结构如下：

持股单位 持股占总股本比例

中信证券股份有限公司 62.2%

山东省农村经济开发投资公司 10%

POWERCORPORATIONOFCANADA 10%

青岛海鹏科技投资有限公司 10%

南方工业资产管理有限责任公司 7.8%

合计 100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生：董事长、党委书记，中信证券股份有限公司执行董事、总经理，硕士，高级经济师。曾任中信证券公司董事、襄理、副总经理，中信控股公司董事、常务副总裁，中国建银投资证券有限责任公司党委副书记、执行董事、总裁，兼任信诚基金管理有限公司董事长、证通股份有限公司董事等。

杨一夫先生：董事，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司（世界银行组织成员）驻中国的首席代表等。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席。曾任国际货币基金组织高级经济学家，达沃斯世界经济论坛首席经济学家，高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理。

沈强先生：董事，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会主任。曾任浙江省国际信托投资公司证券管理总部总经理，金通证券股份有限公司总经理，中信证券（浙江）有限责任公司总经理、党委书记、执行董事，中信证券股份有限公司经纪业务发展与管理委员会副主任等。

葛小波先生：董事，硕士。中信证券党委委员、董事总经理。葛先生于2007年荣获全国金融五一劳动奖章。

汤晓东先生：董事、总经理，硕士。曾任职于摩根大通、荷兰银行、苏格兰皇家银行、中国证监会等。

朱武祥先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院金融系教授、博士生导师，兼任北京建设（香港上市）、华夏幸福基业、中海油海洋工程、东兴证券、中兴通讯等五家上市公司独立董事。

贾建平先生：独立董事，大学本科，高级经济师。现已退休。兼任东莞银行独立董事。曾任职于北京工艺品进出口公司、美国纽约中国物产有限公司（外派工作），曾担任中国银行信托咨询公司副处长、处长，中国银行卢森堡公司副总经理，中国银行意大利代表处首席代表，中银集团投资管理公司副董事长、总经理，中国银行重组上市办公室、董事会秘书办公室、上市办公室总经理，中银基金管理有限公司董事长。

谢德仁先生：独立董事，博士，教授。现任清华大学经济管理学院会计学教授、博士生导师，兼任中华联合人寿保险股份有限公司、博彦科技股份有限公司（上市公司）、朗新科技股份有限公司独立董事，中国会计学会第八届理事会理事，中国会计学会财务成本分会第八届理事会副会长。

张青岭先生：副总经理，博士。现兼任上海高级金融学院客座教授、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任中国技术进出口总公司项目经理、美国联邦储备委员会（华盛顿总部）经济学家、摩根士丹利（纽约总部）信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长（主持工作），华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李一梅女士：副总经理，硕士。兼任证通股份有限公司董事。曾任基金营销部总经理、营销总监、市场总监，上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

周璇女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司纪委书记。曾任华夏基金管理有限公司总经理助理；曾任职于中国证监会、北京金融街建设开发公司。

李红源先生：监事长，硕士，研究员级高级工程师。现任南方工业资产管理有限责任公司总经理。曾任中国北方光学电子总公司信息部职员，中国兵器工业总公司教育局职员、主任科员、规划处副处长、计划处处长，中国兵器装备集团公司发展计划部副主任、经济运营部副主任、资本运营部巡视员兼副主任。

吕翔先生：监事，学士。现任中信证券股份有限公司投资管理部执行总经理。曾任国家劳动部综合计划与工资司副主任科员，中信证券股份有限公司人力资源管理部执行总经理。

张伟先生：监事，硕士，高级工程师。现任山东高速投资控股有限公司党委书记、副总经理，兼任山东渤海轮渡股份有限公司董事。曾任山东省济青公路工程建设指挥部办公室财务科职员，济青高速公路管理局经营财务处副主任科员，山东基建股份有限公司计划财务部经理，山东高速股份有限公司董事、党委委员、总会计师。

汪贵华女士：监事，博士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任财政部科研所助理研究员、中关村证券股份有限公司计划资金部总经理、华夏基金管理有限公司财务总监等。

李彬女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司合规部执行总经理、信息披露负责人。曾任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理、中信基金管理有限责任公司监察稽核部高级副总裁、华夏基金管理有限公司法律监察部总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书（兼）。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师。

2、本基金基金经理

彭海伟先生，中国科学院管理科学与工程学硕士。2004年9月加入原中信基金，曾任研究员，华夏基金研究员、基金经理助理、华夏红利混合型证券投资基金基金经理（2014年1月17日至2016年9月14日期间）等，现任股票投资部总监，华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理（2015年2月9日起任职）、华夏新经济灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（2015年7月13日起任职）、华夏经济转型股票型证券投资基金基金经理（2016年3月15日起任职）。

3、本公司股票投资决策委员会

主任：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

成员：汤晓东先生，华夏基金管理有限公司董事、总经理。

郑煜女士，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

孙彬先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

郑晓辉先生，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

赵航先生，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

王怡欢女士，华夏基金管理有限公司股票投资部执行总经理，基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称中国银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：010-66594942

中国银行客服电话：95566

(二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2017年03月31日，中国银行已托管576只证券投资基金，其中境内基金541只，QDII基金35只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

(四) 托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持规范运作、稳健经营的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于SAS70、AAF01/06ISAE3402和SSAE16等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于ISAE3402和SSAE16双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法

律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一) 销售机构

1、直销机构：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：李一梅

网址：www.ChinaAMC.com

2、代销机构：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

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其办理业务的城市、网点。

(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 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：上海市湖滨路 202 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：许康玮、赵雪

经办注册会计师：许康玮、赵雪

四、基金的名称

本基金名称：华夏新经济灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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

把握经济深化改革方向，挖掘新经济主题行业中的优秀上市公司，追求基金资产的长期、持续增值。

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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、期权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）。

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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为0%~95%，其中投资新经济主题相关股票比例不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。

（二）股票投资策略

当前中国经济正在进入新的历史发展阶段，过去经济增长主要依赖人口红利、出口等动力支撑，未来增长动力则源自改革和创新等。本基金股票投资将重点关注受益于新经济主题的具有成长优势、竞争优势且估值合理的上市公司，更好地分享中国经济快速发展的成果。

1、新经济主题的界定

本基金认为新经济主题是指从传统经济发展方式向科学的可持续的发展方式转变过程中所蕴含的投资机会，包括在此过程中受益的行业和公司、诞生的新兴行业和公司。如节能环保、高端装备制造、新一代信息技术、生物、新材料、新能源和新能源汽车等政府确定的七大战略性新兴产业；以及金融创新、文化创意、消费升级等相关产业。本基金将根据中国经济结构转型进程的深入，动态调整新经济主题的范畴界定，并在招募说明书更新中公告，不需召开持有人大会。

2、个股选择

基金将采用定性和定量相结合的方式，精选新经济主题下的优质个股进行重点投资。

（1）定性分析主要从公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面进行分析。

（2）定量分析主要从公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行分析。

（三）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。

（四）中小企业私募债券投资策略

在严格控制风险的前提下，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征，并与其他投资品种进行对比后，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散投资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。

（五）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。

（六）股指期货和期权投资策略

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货、期权投资。通过对现货市场和期货、期权市场运行趋势的研究，结合基金股

票组合的实际情况及对股指期货、期权的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货、期权合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货、期权作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

本基金投资期权，基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，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。

（七）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，适度参与国债期货投资。

未来，根据市场情况，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

本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 50%+上证国债指数收益率 50%。

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的沪深两市统一指数，具有良好的市场代表性和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩基准。

上证国债指数由中证指数有限公司编制，以上海证券交易所上市的固定利率国债为样本，具有良好的市场代表性和较高的知名度，适合作为本基金债券投资的业绩基准。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深 300 指数或上证国债指数的编制及发布、或沪深 300 指数或上证国债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 指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数，或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，取得基金托管人同意后，变更本基金的基准指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，低于股票基金，属于较高风险、较高收益的品种。

十一、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金 2017 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 30,463,946,705.05 72.52

其中：股票 30,463,946,705.05 72.52

2 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 8,700,000,000.00 20.71

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 2,840,730,553.67 6.76

7 其他各项资产 5,264,797.02 0.01

8 合计 42,009,942,055.74 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 196,809,790.60 0.47

B 采矿业 128,138,058.04 0.31

C 制造业 13,041,166,715.71 31.04

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 920,549,306.00 2.19

E 建筑业 1,129,397,637.75 2.69

F 批发和零售业 785,415,796.38 1.87

G 交通运输、仓储和邮政业 1,185,561,809.11 2.82

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 1,319,963,700.99 3.14

J 金融业 7,848,800,968.60 18.68

K 房地产业 2,184,616,450.11 5.20

L 租赁和商务服务业 438,994,727.48 1.05

M 科学研究和技术服务业 20,921,134.00 0.05

N 水利、环境和公共设施管理业 869,182,101.77 2.07

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 61,870,884.74 0.15

R 文化、体育和娱乐业 269,016,828.17 0.64

S 综合 63,540,795.60 0.15

合计 30,463,946,705.05 72.52

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

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 600000 浦发银行 159,481,295 2,017,438,381.75 4.80

2 600036 招商银行 66,312,080 1,585,521,832.80 3.77

3 601166 兴业银行 85,915,204 1,448,530,339.44 3.45

4 600887 伊利股份 44,119,114 952,531,671.26 2.27

5 000069 华侨城 A 70,843,965 712,690,287.90 1.70

6 601288 农业银行 197,479,257 695,126,984.64 1.65

7 600518 康美药业 30,894,333 671,642,799.42 1.60

8 601668 中国建筑 61,843,294 598,643,085.92 1.43

9 600804 鹏博士 32,070,438 569,250,274.50 1.36

10 600795 国电电力 156,388,432 562,998,355.20 1.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

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

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 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,540.92

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 5,263,256.10

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 5,264,797.02

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 600795 国电电力 562,998,355.20 1.34 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。

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 — —

2015年7月13日至2015年12月31日 3.30% 1.80% -2.22% 1.23% 5.52% 0.57%

2016年1月1日至2016年12月31日 -6.29% 1.21% -3.64% 0.70% -2.65% 0.51%

2017年1月1日至2017年6月30日 8.47% 0.55% 5.50% 0.29% 2.97% 0.26%

十三、费用概览

(一) 基金运作费用

1、基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

(5) 基金份额持有人大会费用；

(6) 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）；

(7) 基金的银行汇划费用；

(8) 基金上市初费及年费（如有）

(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。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不需召开持有人大会，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

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

本基金不收取管理费。

(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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.05\% \times \text{当年天数}$

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。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 2-5 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) 上述 (一) 基金费用的种类中第 (3) - (7) 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。

(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。投资者在申购本基金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

50 万元以下 1.2%

50 万元以上 (含 50 万元) -200 万元以下 0.9%

200 万元以上 (含 200 万元) -500 万元以下 0.6%

500 万元以上 (含 500 万元) 每笔 1,000.00 元

(2) 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。费率随基金份额的持有期限的增加而递减，具体如下：

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) -365 天以内 0.5%

365 天以上 (含 365 天) 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 90 天收取的赎回费，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 90 天不满 180 天收取的赎回费，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 180 天 (含 180 天) 收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

(3) 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。

(4) 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、申购份额与赎回金额的计算方式

(1) 申购份额的计算

申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日基金份额净值}$$

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 日的基金份额净值为 1.230 元，四笔申购金额分别为 1,000.00 元、50 万元、200 万元和 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

申购金额（元，a） 1,000.00 500,000.00 2,000,000.00

适用前端申购费率（b） 1.2% 0.9% 0.6%

净申购金额（ $c=a/(1+b)$ ） 988.14 495,540.14 1,988,071.57

前端申购费（ $d=a-c$ ） 11.86 4,459.86 11,928.43

该类基金份额净值（e） 1.230 1.230 1.230

申购份额（ $f=c/e$ ） 803.37 402,878.16 1,616,318.35

若该投资者申购金额为 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 4

申购金额（元，a） 5,000,000.00

前端申购费（b） 1,000.00

净申购金额（ $c=a-b$ ） 4,999,000.00

该类基金份额净值（d） 1.230

申购份额（ $e=c/d$ ） 4,064,227.64

(2) 赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份额 T 日基金份额净值

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

例二：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份，持有期限半年，该日基金份额净值为 1.250 元，则其获得的净赎回金额计算如下：

赎回金额=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

(3) T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额。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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏新经济灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金管理人于 2017 年 2 月 23 日刊登的本基金招募说明书（更新）进行了更新，主要更新内容如下：

(一) 更新了三、基金管理人中相关内容。

(二) 更新了四、基金托管人中相关内容。

(三) 更新了五、相关服务机构中相关内容。

(四) 更新了八、基金份额的申购、赎回与转换中相关内容。

(五) 更新了九、基金的投资中基金投资组合报告相关内容，该部分内容均按有关规定编制。

(六) 更新了十、基金的业绩的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。

(七) 更新了二十二、其他应披露事项，披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十三日