

华夏睿磐泰荣混合型 证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年10月21日公告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2017年8月18日证监许可[2017]1530号文准予注册。本基金基金合同于2017年12月27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，属于较高风险、较高收益的品种。根据2017年7月1日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

投资有风险，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、基金合同、基金产品资料概要，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。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

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。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，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。基金投资者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。基金投资者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2019年10月18日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019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：邱曦

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%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
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，硕士，高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员，华夏基金（香港）有限公司董事长。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，中信信托董事，信诚基金管理有限公司董事长，中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McNerney 先生：董事，硕士。现任万信投资公司（Mackenzie Financial Corporation）总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

胡祖六先生：董事，博士，教授。现任春华资本集团主席，兼任百胜中国控股有限公司非执行董事长，香港联交所与瑞银集团等上市公司董事等。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、董事总经理等。

杨冰先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、资产管

理业务投资主管等。

李勇进先生：董事，硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、中信证券财富管理委员会主任。兼任中信期货有限公司董事、金通证券有限责任公司执行董事兼总经理。曾任中国农业银行大连市分行国际业务部科员，申银万国证券大连营业部部门经理，中信证券大连营业部总经理助理、副总经理、总经理，中信证券经纪业务管理部高级副总裁、总监，中信证券（浙江）有限责任公司总经理，中信证券浙江分公司总经理，中信证券经纪业务发展与管理委员会主任等。

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

张平先生：独立董事，博士。现任中国社科院经济研究所研究员。兼任民生通惠资产管理公司及香港中航工业国际独立董事。曾任中国社科院经济研究所宏观研究室副主任、经济增长室主任、所长助理、副所长，国家金融与发展实验室副主任等。

张宏久先生：独立董事，硕士。现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。兼任中信信托有限公司独立董事，全国律师协会金融专业委员会顾问，全国侨联法律顾问委员会委员及民事法律委员会主任，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员等。

支晓强先生：独立董事，博士。现任中国人民大学继续教育处处长、商学院财务与金融系教授、博士生导师。兼任全国会计专业学位研究生教育指导委员会委员兼副秘书长、中国会计学会财务成本分会副会长、财政部企业会计准则咨询委员会咨询专家、中国会计学会内部控制专业委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会委员、北农大科技股份有限公司独立董事等。

杨一夫先生：监事长，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（Power Corporation of Canada）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，华夏基金管理有限公司董事等。

杨维华先生：监事，硕士。现任中信证券股份有限公司风险管理部行政负责人、公司副首席风险官。曾任中信证券股份有限公司风险管理部B角（主持工作）、总监等。

史本良先生：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部联席负责人、公司副财务总监。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、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，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任基金运作部B角等。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任华夏基金（香港）有限公司首席执行官、中国石化销售股份有限公司董事、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任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。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、合规部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人等。

2、本基金基金经理

张弘弢先生，硕士。2000年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013年3月28日至2016年3月28日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012年8月9日至2017年11月10日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012年8月21日至2017年11月10日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014年12月23日至2017年11月10日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015年1月13日至2017年11月10日期间）、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015年2月12日至2017

年11月10日期间)、MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2015年2月12日至2017年11月10日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017年12月27日至2019年2月26日期间)等,现任数量投资部董事总经理,华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(2009年7月10日起任职)、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2012年12月25日起任职)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013年3月28日起任职)、华夏网购精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年11月2日起任职)、上证50交易型开放式指数证券投资基金基金经理(2016年11月18日起任职)、华夏鼎融债券型证券投资基金基金经理(2016年12月29日起任职)、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理(2017年3月15日起任职)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理(2017年7月14日起任职)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理(2017年12月6日起任职)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理(2017年12月27日起任职)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理(2019年2月27日起任职)。

毛颖女士,北京大学金融学硕士。曾任西南证券研究员等。2003年8月加入原中信基金,曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员、华夏新锦略灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年5月22日期间)、华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2017年1月18日至2018年7月16日期间)、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年9月10日期间)、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2016年8月24日至2018年12月17日期间)、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年12月17日期间)、华夏圆和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(2017年9月8日至2018年12月17日期间)、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017年10月13日至2018年12月17日期间)、华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017年10月17日至2018年12月17日期间)、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2017年10月18日至2018年12月17日期间)、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理(2013年5月13日至2019年1月14日期间)、华夏磐泰混合型证券投资基金(LOF)基金经理(2018年7月17日至2019年1月14日期间)等,现任固定收益部高级副总裁,华夏恒融一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2017年9月8日起任职)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理(2018年1月8日起任职)。

宋洋女士，中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016年3月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、华夏新锦图灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年3月24日至2018年9月10日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2018年4月10日至2019年2月26日期间）等，现任数量投资部总监，华夏沪深300指数增强型证券投资基金基金经理（2016年11月18日起任职）、华夏鼎汇债券型证券投资基金基金经理（2017年3月24日起任职）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017年8月29日起任职）、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理（2017年8月29日起任职）、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理（2018年4月10日起任职）、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理（2018年4月10日起任职）、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理（2019年2月27日起任职）。

3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

成员：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。

徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

宋洋女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，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）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2019 年 6 月 30 日，本集团总资产 71,931.81 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.09%，权重法下资本充足率 12.60%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队 7 个职能团队，现有员工 83 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成

为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991 年加入本行；2002 年 10 月至 2013 年 12 月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013 年 12 月至 2016 年 10 月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016 年 10 月至 2017 年 4 月任本行业务总监兼北京分行行长；2017 年 4 月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019 年 4 月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年6月30日，招商银行股份有限公司累计托管479只证券投资基金。

（四）托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，以有效防范各种风险作为内部控制的核心，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题能够得到及时的反馈和纠正。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部配备独立的托管业务技术系统，包括网络系统、应用系统、安全防护系统、数据备份系统。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务事项和高风险领域。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）经营风险控制。招商银行资产托管部制定托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险。

（3）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（4）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

（5）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房24小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（6）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

（五）基金托管人对基金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》等有

关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

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：张德根

网址：www.ChinaAMC.com

2、代销机构

（1）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

网址：www.cmbchina.com

客户服务电话：95555

（2）苏州银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

法定代表人：王兰凤

电话：0512-69868389

联系人：项喻楠

网址：www.suzhoubank.com

客户服务电话：96067

（3）华融湘江银行股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段828号鑫远杰座

办公地址：湖南省长沙市雨花区湘府东路二段208号万境财智中心南栋

法定代表人：张永宏

电话：0731-89828592

传真：0731-89828806

联系人：曾玉姣

网址：www.hrxjbank.com.cn

客户服务电话：0731-96599

（4）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层

法定代表人：林义相

电话：010-66045529

传真：010-66045518

联系人：尹伶

网址：www.txsec.com

客户服务电话：010-66045678

（5）鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

住所：北京市海淀区太月园3号楼5层521室

办公地址：北京市海淀区太月园3号楼5层521室

法定代表人：齐凌峰

电话：010-82050520

传真：010-82086110

联系人：阮志凌

网址：www.9ifund.com

客户服务电话：400-158-5050

(6) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：洪弘

电话：010-83363101

传真：010-83363072

联系人：文雯

网址：<http://8.jrj.com.cn/>

客户服务电话：400-166-1188

(7) 北京百度百盈基金销售有限公司

住所：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区信息路甲9号奎科科技大厦

法定代表人：张旭阳

电话：010-61952702

传真：010-61951007

联系人：霍博华

网址：<https://8.baidu.com/>

客户服务电话：95055

(8) 诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

法定代表人：汪静波

电话：021-38509680

传真：021-38509777

联系人：张裕

网址：www.noah-fund.com

客户服务电话：400-821-5399

（9）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

联系人：童彩平

网址：www.zlfund.cn

客户服务电话：4006-788-887

（10）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

联系人：潘世友

网址：www.1234567.com.cn

客户服务电话：400-181-8188

（11）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613635

传真：021-68596916

联系人：胡轶隼

网址：www.ehowbuy.com

客户服务电话：400-700-9665

（12）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心西塔14层

法定代表人：陈柏青

电话：18205712248

联系人：韩爱彬

网址：www.antfortune.com

客户服务电话：95188

（13）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

联系人：黄辉

网址：www.erichfund.com

客户服务电话：400-820-2899

（14）北京展恒基金销售有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088-6006

传真：010-62020355

联系人：翟飞飞

网址：www.myfund.com

客户服务电话：400-888-6661

（15）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市虹口区东大名路1098号53楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-61101630

联系人：曹怡晨

网址：<http://www.leadfund.com.cn/>

客户服务电话：95733

（16）浙江金观诚基金销售有限公司

住所：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

电话：0571-88337717

传真：0571-88337666

联系人：孙成岩

网址：www.jincheng-fund.com

客户服务电话：400-068-0058

（17）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809

法定代表人：沈伟桦

电话：010-52855713

传真：010-85894285

联系人：程刚

网址：www.yixinfund.com

客户服务电话：400-609-9200

（18）南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道苏宁总部

法定代表人：刘汉青

电话：025-66996699-887226

传真：025-66008800-887226

联系人：王峰

网址：www.snjjjin.com

客户服务电话：95177

（19）深圳腾元基金销售有限公司

住所：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808单元

办公地址：深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808单元

法定代表人：曾革

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

联系人：鄢萌莎

网址：www.tenyuanfund.com

客户服务电话：400-687-7899

（20）通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场9楼

法定代表人：马刚

电话：021-60818757、13916871276

传真：021-60818280

联系人：周晶

网址：www.tonghuafund.com

客户服务电话：400-101-9301

（21）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

电话：010-56282140

传真：010-62680827

联系人：丁向坤

网址：www.hcjijin.com

客户服务电话：400-619-9059

（22）北京晟视天下投资管理有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座21层

法定代表人：蒋煜

电话：010-58170806

传真：010-58170910

联系人：蒋煜

网址：www.shengshiview.com.cn

客户服务电话：010-58170761

（23）北京钱景基金销售有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-57418829

传真：010-57569671

联系人：魏争

网址：www.niuji.net

客户服务电话：400-893-6885

（24）北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：杨纪峰

客户服务电话：400-680-2123

联系人：陶翰辰

网址：www.zhixin-inv.com

（25）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

电话：18918353003

传真：021-20219923

联系人：宋楠

网址：<https://www.wg.com.cn/>

客户服务电话：021-20292031

（26）北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

电话：010-60619607

传真：010-62676582

联系人：付文红

网址：www.xincai.com

客户服务电话：010-62675369

（27）北京辉腾汇富基金销售有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B

法定代表人：许宁

电话：010-85610733

传真：010-85622351

联系人：彭雪琳

网址：<https://www.htfund.com/>

客户服务电话：400-829-1218

（28）上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

电话：021-50712782

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

网址：www.520fund.com.cn

客户服务电话：400-821-0203

（29）凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402（750000）

办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼（100000）

法定代表人：程刚

电话：010-58160168

传真：010-58160173

联系人：张旭

网址：www.fengfd.com

客户服务电话：400-810-5919

（30）上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

电话：15201924977

传真：021-52975270

联系人：兰敏

网址：www.66zichan.com

客户服务电话：400-166-6788

（31）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：李春光

电话：0411-88891212-317

传真：0411-84396536

联系人：张晓辉

网址：www.haojiyoujijin.com

客户服务电话：400-0411-001

（32）上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132-801

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

网址：www.zhongzhengfund.com

客户服务电话：400-6767-523

（33）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：姜颖

网址：www.hongdianfund.com

客户服务电话：400-618-0707

（34）大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

电话：13671788303

传真：021-20324199

联系人：刘璐

网址：www.dtfunds.com

客户服务电话：400-928-2266

（35）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-89629021

传真：020-89629011

联系人：吴煜浩

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

（36）和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座

法定代表人：王旋

电话：0371-85518396

传真：0371-85518397

联系人：胡静华

网址：www.hgccpb.com

客户服务电话：4000-555-671

（37）奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

联系人：叶健

网址：www.ifastps.com.cn

客户服务电话：400-684-0500

（38）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区显龙山路19号1幢4层1座401

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

电话：010-89188692

传真：010-89180000

联系人：黄立影

网址：<http://fund.jd.com/>

客户服务电话：95118、400-098-8511

（39）中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人：弭洪军

电话：021-33357030

传真：021-63353736

联系人：李娜

网址：www.cmiwm.com

客户服务电话：400-876-5716

（40）深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层

法定代表人：赖任军

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

联系人：刘昕霞

网址：www.jfzinv.com

客户服务电话：400-930-0660

（41）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：袁永姣

网址：<https://danjuanapp.com>

客户服务电话：400-159-9288

（42）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

电话：010-60833754

传真：0755-83217421

联系人：刘宏莹

网址：www.citicsf.com

客户服务电话：400-990-8826

（43）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

网址：www.gtja.com

客户服务电话：95521

（44）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

（45）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：李颖

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

（46）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

传真：010-60836029

联系人：郑慧

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

（47）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：陈宇

网址：www.swhysc.com

客户服务电话：95523、400-889-5523

（48）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

传真：021-38565955

联系人：乔琳雪

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

（49）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.95579.com

客户服务电话：95579、400-888-8999

（50）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

客户服务电话：95517

（51）湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

网址：www.xcsc.com

客户服务电话：95351

（52）万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

法定代表人：张建军

电话：020-38286588

传真：020-22373718-1013

联系人：王鑫

网址：www.wlzq.com.cn

客户服务电话：95322

（53）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区滨水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

传真：022-28451892

联系人：蔡霆

网址：www.ewww.com.cn

客户服务电话：400-651-5988

（54）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

联系人：刘晓明

网址：<http://sd.citics.com>

客户服务电话：95548

（55）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路181号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：www.dwzq.com.cn

客户服务电话：95330

（56）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：尹旭航

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

（57）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人：郭军瑞

网址：www.foundersc.com

客户服务电话：95571

（58）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

联系人：李春芳

网址：www.cgws.com

客户服务电话：400-666-6888、0755-33680000

（59）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169081

传真：021-22169134

联系人：刘晨

网址：www.ebscn.com

客户服务电话：95525、400-888-8788

（60）东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：95360

（61）南京证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路389号

办公地址：江苏省南京市江东中路389号

法定代表人：步国旬

电话：025-58519523

传真：025-83369725

联系人：王万君

网址：www.njzq.com.cn

客户服务电话：95386

（62）上海证券有限责任公司

住所：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：龚德雄

电话：021-51539888

传真：021-65217206

联系人：张瑾

网址：www.962518.com

客户服务电话：400-891-8918

（63）新时代证券股份有限公司

住所：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：叶顺德

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：田芳芳

网址：www.xsdzq.cn

客户服务电话：95399

（64）大同证券有限责任公司

住所：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13

法定代表人：董祥

电话：0351-4130322

传真：0351-4192803

联系人：薛津

网址：www.dtsbc.com.cn

客户服务电话：400-712-1212

（65）国联证券股份有限公司

住所：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人：姚志勇

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

联系人：祁昊

网址：www.glsc.com.cn

客户服务电话：95570

（66）浙商证券股份有限公司

住所：杭州市江干区五星路201号

办公地址：杭州市江干区五星路201号浙商证券大楼8楼

法定代表人：吴承根

电话：0571-87901053

传真：0571-87901913

联系人：谢相辉

网址：www.stocke.com.cn

客户服务电话：95345

（67）华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161666

传真：0551-65161600

联系人：范超

网址：www.hazq.com

客户服务电话：95318

（68）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号

法定代表人：何春梅

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

网址：www.ghzq.com.cn

客户服务电话：95563

（69）财富证券有限责任公司

住所：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

法定代表人：蔡一兵

电话：0731-84403347

传真：0731-84403439

联系人：郭静

网址：www.cfzq.com

客户服务电话：95317

（70）中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：菅明军

电话：0371-69099882

传真：0371-65585899

联系人：程月艳、李盼盼、党静

网址：www.ccnew.com

客户服务电话：95377

（71）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人：-

电话：010-84183389

传真：010-84183311-3389

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

客户服务电话：400-818-8118

（72）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

（73）中银国际证券股份有限公司

住所：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：宁敏

电话：021-20328000

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

网址：www.bocichina.com.cn

客户服务电话：400-620-8888

（74）华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街198号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

电话：010-58124967

传真：028-86150040

联系人：谢国梅

网址：www.hx168.com.cn

客户服务电话：95584

（75）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
(830002)

法定代表人：韩志谦

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

联系人：王怀春

网址：www.hysec.com

客户服务电话：400-800-0562

(76) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

传真：021-20315125

联系人：许曼华

网址：www.zts.com.cn

客户服务电话：95538

(77) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：李强

客户服务电话：400-832-3000

传真：0755-83199511

联系人：王雯

网址：www.csco.com.cn

(78) 第一创业证券股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

电话：0755-25831754

传真：0755-23838750

联系人：毛诗莉

网址：www.firstcapital.com.cn

客户服务电话：95358

（79）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：马贤清

网址：www.jyzq.cn

客户服务电话：95372

（80）西部证券股份有限公司

住所：陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼

办公地址：陕西省西安市东大街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

（81）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：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

网址：www.hfzq.com.cn

客户服务电话：95547

（82）华龙证券股份有限公司

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：95368、400-468-8888（全国）

（83）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

（84）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：021-54967552

传真：021-54967032

联系人：杨莉娟

网址：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：95323、400-109-9918

（85）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：0755-88320851

传真：0755-82026942

联系人：胡芷境

网址：www.china-invs.cn

客户服务电话：400-600-8008、95532

（86）中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层

法定代表人：林炳城

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

联系人：罗艺琳

网址：www.zszq.com

客户服务电话：95329

（87）联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层

法定代表人：严亦斌

电话：0755-83331195

联系人：彭莲

网址：www.lxsec.com

客户服务电话：95564

（88）江海证券有限公司

住所：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

联系人：姜志伟

网址：www.jhzq.com.cn

客户服务电话：400-666-2288

（89）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：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

网址：www.gjq.com.cn

客户服务电话：95310

（90）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

（91）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：福建省厦门市深田路46号深田国际大厦19-20楼

法定代表人：王勇

电话：0592-2079259

传真：0592-2079602

联系人：邱震

网址：www.gwgsc.com

客户服务电话：400-0099-886

（92）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

（93）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：010-85556048

传真：010-85556088

联系人：孙燕波

网址：www.hrsec.com.cn

客户服务电话：95390

（94）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：400-800-5000

（95）万和证券股份有限公司

住所：海口市南沙路49号通信广场二楼

办公地址：深圳市深南大道7028号时代科技大厦20层西

法定代表人：王宜四

电话：0755-82830333

传真：0755-25170807

联系人：郭东彤

网址：www.wanhesec.com

客户服务电话：4008-882-882

（96）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

（97）开源证券股份有限公司

住所：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

电话：029-88447611

传真：029-88447611

联系人：曹欣

网址：www.kysec.cn

客户服务电话：95325、400-860-8866

（98）联储证券有限责任公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层

法定代表人：吕春卫

电话：010-86499427

传真：010-86499401

联系人：丁倩云

网址：www.lczq.com

客户服务电话：400-620-6868

（99）玄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：马永谔

电话：13752528013

传真：021-50701053

联系人：卢亚博

网址：http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xybx

客户服务电话：400-080-8208

（100）阳光人寿保险股份有限公司

住所：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

网址：<http://fund.sinosig.com/>

客户服务电话：95510

（101）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：毛淮平

电话：-

传真：010-88066214

联系人：张静

网址：www.amcfortune.com

客户服务电话：400-817-5666

3、基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回的销售机构，并在基金管理人网站公示。
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。

（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：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号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办注册会计师：王珊珊、马剑英

四、基金的名称

本基金名称：华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金。

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

通过风险均衡方法进行资产配置，积极管理，力求有效控制风险，实现基金资产长期持续增值。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、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、政府支持机构债券、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）、衍生品（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券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：股票投资占基金资产的比例为0%-40%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金以风险均衡作为主要资产配置策略，通过平衡各资产类别对整个组合风险贡献，合理确定本基金在股票、债券等资产上的投资比例，为更好地适应不断变化的市场环境，本基金还将动态调整各类资产的配置比例。

在基于风险均衡资产配置策略应用过程中，本基金将保持整个投资组合相对稳定的市场风险暴露，以达到长期稳定、相对积极的波动水平，获得良好的风险调整后的收益。

（二）股票投资策略

本基金股票投资策略分为主动量化股票投资策略和基于风险均衡的股票投资策略。

1、主动量化股票投资策略

本基金充分发挥基金管理人的选股优势，以多因子模型和事件驱动模型为基础，并辅以其他量化投资手段构建投资组合，力求寻找具有稳定收益的投资组合。量化多因子模型包含公司基本面、技术指标、市场情绪等可量化的因素，如价值因子、动量因子、成长因子、情绪因子等。事件驱动模型以深入研究上市公司增发、定期报告、业绩预告、大股东/高管增减持、限售股解禁、股票质押等上市公司事件为基础，分析特殊事件的动机、操作流程、预期结果和对公司股价的影响，进而构建相应的投资策略。

2、基于风险均衡的股票投资策略

本基金将风险均衡策略自下而上的应用于同一行业内的股票和不同的行业中，在既定风险下追求更好的风险调整后收益。

（三）固定收益品种投资策略

本基金固定收益品种投资策略分为主动固定收益品种投资策略和基于风险均衡的固定收益品种投资策略。

1、主动固定收益品种投资策略

本基金将分析和判断国际、国内宏观经济形势、资金供求曲线、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的配置结构，精选债券，获取收益。

（1）债券类属配置策略

本基金根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。

（2）久期调整策略

债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策

等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期，达到增加收益或减少损失的目的。

当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

（3）收益率曲线配置策略

本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素，确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。

（4）可转换公司债券投资策略

本基金将着重对可转债对应的基础股票的分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择，并在对应可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。

（5）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。

2、基于风险均衡的固定收益品种投资策略

本基金将风险均衡应用在期限、券种等债券核心要素方面，结合收益率曲线变动预测，动态调整不同期限、品种债券之间的风险配置比例，以追求更好的风险调整后收益水平。

（四）资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。

（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，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货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。

（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。

（八）股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，结合期权定价模型，选择估值合理的股票期权合约。

本基金投资股票期权，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股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

未来，根据市场情况，基金管理人在履行适当的程序后，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： $\text{中证 800 指数收益率} \times 20\% + \text{上证国债指数收益率} \times 80\%$ 。

中证 800 指数是中证指数有限公司编制的，反应沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数，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中证 800 指数或上证国债指数的编制及发布、或中证

800 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中证 800 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，无需召开基金份额持有人大会。

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 2019 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	62,648,990.00	16.65
	其中：股票	62,648,990.00	16.65
2	固定收益投资	133,648,769.60	35.51
	其中：债券	133,648,769.60	35.51
	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	122,910,374.87	32.66
	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	53,854,761.11	14.31
7	其他各项资产	3,312,342.73	0.88
8	合计	376,375,238.31	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	-	-
B	采矿业	2,609,565.00	0.76
C	制造业	16,110,242.00	4.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,816,517.00	0.82
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	859,327.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	670,208.00	0.20
J	金融业	36,537,410.00	10.64
K	房地产业	1,965,964.00	0.57
L	租赁和商务服务业	1,001,745.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	78,012.00	0.02
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	综合	-	-
	合计	62,648,990.00	18.24

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	601318	中国平安	124,600	11,040,806.00	3.21
2	600519	贵州茅台	5,300	5,215,200.00	1.52
3	601166	兴业银行	213,700	3,908,573.00	1.14
4	600016	民生银行	427,900	2,717,165.00	0.79
5	600887	伊利股份	70,800	2,365,428.00	0.69
6	600000	浦发银行	202,400	2,364,032.00	0.69
7	601211	国泰君安	114,500	2,101,075.00	0.61

8	600276	恒瑞医药	30,600	2,019,600.00	0.59
9	601328	交通银行	320,000	1,958,400.00	0.57
10	601688	华泰证券	81,700	1,823,544.00	0.53

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,036,572.60	5.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	36,740,162.60	10.70
	其中：政策性金融债	36,740,162.60	10.70
4	企业债券	50,489,000.00	14.70
5	企业短期融资券	20,112,000.00	5.85
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,271,034.40	2.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	133,648,769.60	38.91

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	018009	国开 1803	137,900	14,911,127.00	4.34
2	019547	16 国债 19	152,580	13,985,482.80	4.07
3	018006	国开 1702	115,000	11,741,500.00	3.42
4	143772	18 诚通 02	100,000	10,176,000.00	2.96
5	143807	18 电投 07	100,000	10,166,000.00	2.96

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

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IH1907	沪深 300 期货 IH1907 合约	-4	-3,495,600.00	-95,629.09	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
IH1912	沪深 300 期货 IH1912 合约	-7	-6,096,300.00	-247,680.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					-343,309.09
股指期货投资本期收益(元)					-172,450.91
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-343,309.09

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在风险可控的前提下，根据基金合同规定投资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，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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	982,153.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,268,794.66
5	应收申购款	61,394.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,312,342.73

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。

华夏睿磐泰荣混合 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
2017年12月27日至 2017年12月31日	0.19%	0.08%	-0.11%	0.19%	0.30%	-0.11%
2018年1月1日至	0.85%	0.14%	-1.65%	0.27%	2.50%	-0.13%

2018年12月31日						
2019年1月1日至 2019年6月30日	6.11%	0.39%	6.51%	0.32%	-0.40%	0.07%

华夏睿磐泰荣混合 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
2017年12月27日至 2017年12月31日	0.18%	0.08%	-0.11%	0.19%	0.29%	-0.11%
2018年1月1日至 2018年12月31日	0.54%	0.14%	-1.65%	0.27%	2.19%	-0.13%
2019年1月1日至 2019年6月30日	5.95%	0.39%	6.51%	0.32%	-0.56%	0.07%

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）除法律法规、中国证监会另有规定外，《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、律师费和诉讼费。
- （6）基金份额持有人大会费用。
- （7）基金的证券/期货账户等相关账户的开户费用。
- （8）基金的证券/期货交易费用（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、相关账户费用及其他类似性质的费用等）。
- （9）基金的银行汇划费用、银行账户维护费用。
- （10）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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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 0.30%。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

各类别基金份额的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

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一次性支付给登记机构，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。

上述“1、基金费用的种类”中第（4）—（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) 投资者在申购A类基金份额时需交纳前端申购费。

A类基金份额申购费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
50万元以下	0.8%
50万元以上（含50万元）-200万元以下	0.6%
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）	1,000.00元/笔

申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记等各项费用。

- (2) 投资者申购C类基金份额时，申购费为0。

(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。

A 类基金份额赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
7 天以内	1.5%
7 天（含）-30 天	0.75%
30天（含）-365天	0.5%
365 天（含）以上	0

C 类基金份额的赎回费率如下：

持有期限	赎回费率
7 天以内	1.5%
7 天（含）-30 天	0.5%
30 天（含）以上	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。

（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，基金管理人可根据法律法规要求对基金申购费率、赎回费率等进行适当费率优惠。

（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：

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

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

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

申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

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：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额净值}$$

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 A 类基金份额净值为 1.2300 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 A 类基金份额计算如下：

	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）	0.8%	0.6%	0.4%
净申购金额（ $c=a/(1+b)$ ）	992.06	497,017.89	1,992,031.87
前端申购费（ $d=a-c$ ）	7.94	292.11	768.13
基金份额净值（e）	1.2300	1.2300	1.2300
申购份额（ $f=c/e$ ）	806.55	404,079.59	1,619,538.11

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A类基金份额计算如下：

	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
基金份额净值（d）	1.2300
申购份额（ $e=c/d$ ）	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，则申购获得的 C 类基金份额计算如下：

$$\text{申购份额} = 5,000,000.00 / 1.2500 = 4,000,000.00 \text{ 份}$$

（2）赎回金额的计算

当投资者赎回基金份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

例三：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 A 类基金份额，持有期限半年，该日 A 类基金份额净值为 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 10,000.00 \times 1.2500 = 12,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0.5\% = 62.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 62.50 = 12,437.50 \text{ 元}$$

例四：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 C 类基金份额，持有期限 30 天，该日 C 类

基金份额净值为 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{净赎回金额} = 10,000.00 \times 1.2500 = 12,500.00 \text{元}$$

(3) 本基金分为 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金两类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，由此产生的误差计入基金财产。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。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。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，具体如下：

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，且转出基金申购费率适用固定费用。

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”中例八。

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对于货币基金的基金份额转出情况的补充说明

对于货币型基金，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）

（4）上述费用另有优惠的，从其规定。

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整基金转换的有关业务规则。

（5）业务举例

例一：假定投资者在 T 日转出 1,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额（A）	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值（B）	1.200
转出总金额（C=A*B）	1,200.00
转出基金赎回费率（D）	0.5%
转出基金费用（E=C*D）	6.00

转换金额 (F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率 (G)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额 (H=F/(1+G))	1,188.06
转入基金费用 (I=F-H)	5.94
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	913.89

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	6.00
转换金额 (F=C-E)	1,194.00
转入时收取申购费率 (G)	0.00%
净转入金额 (H=F/(1+G))	1,194.00
转入基金费用 (I=F-H)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	918.46

例二：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用比例费率，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	1,000.00
净转入金额 (H=F-G)	11,939,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,183,846.15

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转

入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,184,615.38

例三：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	6.00
转换金额 (F=C-E)	1,194.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	1,194.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	796.00

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，此时赎回乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。

则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (K)	796.00
赎回日基金份额净值 (L)	1.300
赎回总金额 (M=K*L)	1,034.80
赎回费用 (N)	0.00
适用后端申购费率 (O)	1.2%

后端申购费 ($P=K*I*O/(1+O)$)	14.16
赎回金额 ($Q=M-N-P$)	1,020.64

例四：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 ($C=A*B$)	1,300.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 ($E=C*D$)	6.50
转换金额 ($F=C-E$)	1,293.50
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 ($H=F-G$)	1,293.50
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 ($J=H/I$)	862.33

例五：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），甲基金申购费率适用固定费用，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.2%，赎回费率为 0.5%。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金申购费率适用比例费率，乙基金前端申购费率最高档为 1.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 ($C=A*B$)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 ($E=C*D$)	60,000.00
转换金额 ($F=C-E$)	11,940,000.00
转入时收取申购费率 (G)	$1.5\%-1.2\%=0.3\%$
净转入金额 ($H=F/(1+G)$)	11,904,287.14
转入基金费用 ($I=F-H$)	35,712.86
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 ($K=H/J$)	9,157,143.95

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金申购费率适用比例费率，丙基金前端申购费率最高档为 1.0%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入时收取申购费率 (G)	0.00%
净转入金额 (H=F/(1+G))	11,940,000.00
转入基金费用 (I=F-H)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=H/J)	9,184,615.38

例六：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份甲基金基金份额（前端收费模式），该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金赎回费率为 0.5%。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 500 元，乙基金适用的申购费用为 1,000 元，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	1,000-500=500.00
净转入金额 (H=F-G)	11,939,500.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,184,230.77

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），甲基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金适用的申购费用为 500 元，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	0.00

净转入金额 (H=F-G)	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.300
转入基金份额 (J=H/I)	9,184,615.38

例七：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有的前端收费基金甲 10,000,000 份，转入后端收费基金乙，甲基金申购费率适用固定费用，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。甲基金适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	60,000.00
转换金额 (F=C-E)	11,940,000.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	11,940,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	7,960,000.00

若投资者在 2011 年 1 月 1 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期在 1 年之内，适用后端申购费率为 1.2%，此时赎回乙基金不收取赎回费，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (K)	7,960,000.00
赎回日基金份额净值 (L)	1.300
赎回总金额 (M=K*L)	10,348,000.00
赎回费用 (N)	0.00
适用后端申购费率 (O)	1.2%
后端申购费 (P=K*I*O/(1+O))	141,581.03
赎回金额 (Q=M-N-P)	10,206,418.97

例八：假定投资者在 T 日转出前端收费基金甲 10,000,000 份，转入不收取申购费用基金乙，甲基金申购费率适用固定费用。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	13,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
转出基金费用 (E=C*D)	65,000.00

转换金额 (F=C-E)	12,935,000.00
转入基金费用 (G)	0.00
净转入金额 (H=F-G)	12,935,000.00
转入基金 T 日基金份额净值 (I)	1.500
转入基金份额 (J=H/I)	8,623,333.33

例九：假定投资者在 T 日转出 1,000 份持有期为半年的甲基金基金份额(后端收费模式)，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	19.45
转出基金费用 (I=E+H)	25.45
转换金额 (J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率 (K)	2.0%-1.5%=0.5%
净转入金额 (L=J/(1+K))	1,168.71
转入基金费用 (M=J-L)	5.84
转入基金 T 日基金份额净值 (N)	1.300
转入基金份额 (O=L/N)	899.01

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	19.45
转出基金费用 (I=E+H)	25.45
转换金额 (J=C-I)	1,174.55
转入时收取申购费率 (K)	0.00%

净转入金额 (L=J/(1+K))	1,174.55
转入基金费用 (M=J-L)	0.00
转入基金 T 日基金份额净值 (N)	1.300
转入基金份额 (O=L/N)	903.50

例十：假定投资者在 T 日转出 10,000,000 份持有期为半年的甲基金基金份额（后端收费模式），转出时适用甲基金后端申购费率为 1.8%，该日甲基金基金份额净值为 1.200 元。甲基金前端申购费率最高档为 1.5%，赎回费率为 0.5%。申购日甲基金基金份额净值为 1.100 元。

①若 T 日转入乙基金（前端收费模式），且乙基金适用的申购费用为 1,000 元，乙基金前端申购费率最高档为 2.0%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	60,000.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	194,499.02
转出基金费用 (I=E+H)	254,499.02
转换金额 (J=C-I)	11,745,500.98
转入基金费用 (K)	1,000.00
净转入金额 (L=J-K)	11,744,500.98
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.300
转入基金份额 (N=L/M)	9,034,231.52

②若 T 日转入丙基金（前端收费模式），且丙基金适用的申购费用为 1,000 元，丙基金前端申购费率最高档为 1.2%，该日丙基金基金份额净值为 1.300 元。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	60,000.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.8%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	194,499.02

转出基金费用 (I=E+H)	254,499.02
转换金额 (J=C-I)	11,745,500.98
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	11,745,500.98
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.300
转入基金份额 (N=L/M)	9,035,000.75

例十一：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，转出时适用甲基金后端申购费率为 1.0%，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。申购当日甲基金基金份额净值为 1.100 元，适用赎回费率为 0.5%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.50
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.0%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	10.89
转出基金费用 (I=E+H)	17.39
转换金额 (J=C-I)	1,282.61
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	1,282.61
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.500
转入基金份额 (N=L/M)	855.07

若投资者在 2012 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 2 年半，适用后端申购费率为 1.2%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (O)	855.07
赎回日基金份额净值 (P)	1.300
赎回总金额 (Q=O*P)	1,111.59
赎回费率 (R)	0.5%
赎回费 (S=Q*R)	5.56
适用后端申购费率 (T)	1.2%
后端申购费 (U=O*M*T/(1+T))	15.21
赎回金额 (V=Q-S-U)	1,090.82

例十二：假定投资者在 T 日转出持有期为 3 年的后端收费基金甲 1,000 份，转入不收取

申购费用基金乙。T日甲、乙基金基金份额净值分别为1.200、1.500元。申购当日甲基金基金份额净值为1.100元，赎回费率为0.5%，转出时适用甲基金后端申购费率为1.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金赎回费率 (D)	0.5%
赎回费 (E=C*D)	6.00
申购日转出基金基金份额净值 (F)	1.100
适用后端申购费率 (G)	1.0%
后端申购费 (H=A×F×G/(1+G))	10.89
转出基金费用 (I=E+H)	16.89
转换金额 (J=C-I)	1,183.11
转入基金费用 (K)	0.00
净转入金额 (L=J-K)	1,183.11
转入基金 T 日基金份额净值 (M)	1.500
转入基金份额 (N=L/M)	788.74

例十三：假定投资者在 T 日转出持有期为 146 天的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，此时转出不收取赎回费。乙基金适用申购费率为 2.0%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金费用 (D)	0.00
转换金额 (E=C-D)	1,200.00
销售服务费率 (F)	0.3%
转入基金申购费率 (G)	2.0%
收取的申购费率 (H=G-F*转出基金的持有时间 (单位为年))	1.88%
净转入金额 (I=E/(1+H))	1,177.86
转入基金费用 (J=E-I)	22.14
转入基金 T 日基金份额净值 (K)	1.300
转入基金份额 (L=I/K)	906.05

例十四：假定投资者在 T 日转出持有期为 10 天的不收取申购费用基金甲 10,000,000 份，转入前端收费基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.300 元。甲基金销售服务费率为 0.3%，此时转出不收取赎回费。乙基金适用固定申购费 1,000.00 元。则转出基金

费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	10,000,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	12,000,000.00
转出基金费用 (D)	0.00
转换金额 (E=C-D)	12,000,000.00
销售服务费率 (F)	0.3%
转入基金申购费用 (G)	1,000.00
转入基金费用 (H=G-E*F*转出基金的持有时间 (单位为年))	13.70
净转入金额 (I=E-H)	11,999,986.30
转入基金 T 日基金份额净值 (J)	1.300
转入基金份额 (K=I/J)	9,230,758.69

例十五：假定投资者在 2010 年 3 月 15 日成功提交了基金转换申请，转出持有 60 天的不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入后端收费基金乙，该日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.200、1.500 元。2010 年 3 月 16 日这笔转换确认成功。此时转出甲基金不收取赎回费。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.200
转出总金额 (C=A*B)	1,200.00
转出基金费用 (D)	0.00
转换金额 (E=C-D)	1,200.00
转入基金费用 (F)	0.00
净转入金额 (G=E-F)	1,200.00
转入基金 T 日基金份额净值 (H)	1.500
转入基金份额 (I=G/H)	800.00

若投资者在 2013 年 9 月 15 日赎回乙基金，则赎回时乙基金持有期为 3 年半，适用后端申购费率为 1.0%，且乙基金赎回费率为 0.5%，该日乙基金基金份额净值为 1.300 元。则赎回金额计算如下：

项目	费用计算
赎回份额 (J)	800.00
赎回日基金份额净值 (K)	1.300
赎回总金额 (L=J*K)	1,040.00
赎回费率 (M)	0.5%
赎回费 (N=L*M)	5.20
适用后端申购费率 (O)	1.0%
后端申购费 (P=J*H*O/(1+O))	11.88

赎回金额 (Q=L-N-P)	1,022.92
----------------	----------

例十六：假定投资者在 T 日转出不收取申购费用基金甲 1,000 份，转入不收取申购费用基金乙。T 日甲、乙基金基金份额净值分别为 1.300、1.500 元。甲基金赎回费率为 0.1%。则转出基金费用、转入基金费用及份额计算如下：

项目	费用计算
转出份额 (A)	1,000.00
转出基金 T 日基金份额净值 (B)	1.300
转出总金额 (C=A*B)	1,300.00
转出基金赎回费率 (D)	0.1%
转出基金费用 (E=C*D)	1.30
转换金额 (F=C-E)	1,298.70
转入基金费用 (F)	0.00
净转入金额 (G=E-F)	1,298.70
转入基金 T 日基金份额净值 (H)	1.500
转入基金份额 (I=G/H)	865.80

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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，对本基金原招募说明书或招募说明书（更新）进行了更新，本次重大更新事项为依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订“基金信息披露”章节及相关内容，并对包括但不限于基金管理人、基金托管人等其他信息一并更新。主要更新内容如下：

（一）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新“重要提示”、“绪言”、“释义”等章节中《信息披露办法》的名称、新增有关产品资料概要的释义与相关内容。

（二）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新“基金的信息披露”章节。

（三）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新全文中有关信息披露文件备案的描述。

（四）更新“基金管理人信息”、“基金托管人信息”、“基金销售机构及相关服务机构”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”、“其他应披露事项”。

（五）根据 2019 年 2 季报及半年报更新“基金投资组合报告”和“基金的业绩”。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年十月二十一日