

# 華夏回報證券投資基金 2016 年半年度報告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

報告送出日期：二〇一六年八月二十七日

華夏回報證券投資基金（“**本基金**”）

2016 年半年度報告

向香港投資者提供的資料

本基金是根據香港《證券及期貨條例》（「**證券及期貨條例**」）第 104 條在香港獲得證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）認可。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業利弊或其表現作出保證。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或投資者類別。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

補充披露部分只編備以供在香港派發。補充披露部分載有本基金投資組合的額外詳情，其必須連同本基金的 2016 年半年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇一六年八月二十七日

## §1 重要提示及目錄

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性及完整性承擔個別及連帶的法律責任。本半年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2016 年 8 月 25 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理及運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告中財務資料未經審計。

本報告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	2
§2 基金簡介 .....	4
§3 主要財務指標及基金淨值表現.....	5
3.1 主要會計資料及財務指標.....	5
3.2 基金淨值表現.....	5
§4 管理人報告 .....	6
§5 託管人報告 .....	11
§6 半年度財務會計報告（未經審計） .....	12
6.1 資產負債表.....	12
6.2 利潤表 .....	14
6.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	15
6.4 報表附注.....	16
§7 投資組合報告.....	36
7.1 期末基金資產組合情況.....	36
7.2 期末按行業分類的股票投資組合 .....	36
7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資詳情 .....	37
7.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	42
7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合 .....	44
7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資詳情 .....	44
7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資詳情 .....	45
7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資詳情 .....	45
7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資詳情 .....	46
7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明 .....	46
7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明 .....	46
7.12 投資組合報告附注.....	46
§8 基金份額持有人資訊.....	47
8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	47
8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	47
8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況 .....	47
§9 開放式基金份額變動.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
§11 備查文件目錄.....	51
§12 補充披露 .....	53

## §2 基金簡介

### 2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001	002002
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003年9月5日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	6,241,301,191.94份	
基金合同存續期	不定期	

### 2.2 基金產品說明

投資目標	儘量避免基金資產損失，追求每年較高的絕對回報。
投資策略	正確判斷市場走勢，合理配置股票及債券等投資工具的比例，準確選擇具有投資價值的股票品種及債券品種進行投資，可以在儘量避免基金資產損失的前提下實現基金每年較高的絕對回報。
業績比較基準	本基金業績比較基準為絕對回報標準，為同期一年期定期存款利率。
風險收益特徵	本基金在證券投資基金中屬於中等風險的品種，其長期平均的預期收益及風險高於債券基金，低於股票基金。

### 2.3 基金管理人及基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	張靜	王永民
	聯繫電話	400-818-6666	010-66594896
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客戶服務電話		400-818-6666	95566
傳真		010-63136700	010-66594942
註冊地址		北京市順義區天竺空港工業區 A 區	北京市西城區復興門內 大街 1 號
辦公地址		北京市西城區金融大街 33 號通 泰大廈 B 座 8 層	北京市西城區復興門內 大街 1 號
郵遞區號		100033	100818
法定代表人		楊明輝	田國立

## 2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《中國證券報》、《上海證券報》、《證券時報》
登載基金半年度報告正文的管理人互聯網網址	<a href="http://www.ChinaAMC.com">www.ChinaAMC.com</a>
基金半年度報告備置地點	基金管理人及基金託管人的住所

## 2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
註冊登記機構	華夏基金管理有限公司	北京市西城區金融大街 33 號通泰大廈 B 座 8 層

## §3 主要財務指標及基金淨值表現

### 3.1 主要會計資料及財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料及指標	報告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已實現收益	-286,484,684.13
本期利潤	-404,882,294.52
加權平均基金份額本期利潤	-0.0647
本期加權平均淨值利潤率	-5.76%
本期基金份額淨值增長率	-5.37%
3.1.2 期末資料及指標	報告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利潤	-201,868,047.89
期末可供分配基金份額利潤	-0.0323
期末基金資產淨值	7,254,335,798.57
期末基金份額淨值	1.162
3.1.3 累計期末指標	報告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份額累計淨值增長率	756.07%

注：①所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水準要低於所列數字。

②本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

③期末可供分配利潤為期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數。

### 3.2 基金淨值表現

#### 3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
過去一個月	2.56%	0.59%	0.12%	0.00%	2.44%	0.59%
過去三個月	2.11%	0.70%	0.37%	0.00%	1.74%	0.70%
過去六個月	-5.37%	1.15%	0.75%	0.00%	-6.12%	1.15%
過去一年	-8.94%	1.05%	1.62%	0.00%	-10.56%	1.05%
過去三年	38.14%	0.98%	7.35%	0.00%	30.79%	0.98%
自基金合同生效起至今	756.07%	1.04%	35.42%	0.00%	720.65%	1.04%

### 3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

#### 華夏回報證券投資基金

#### 份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

(2003年9月5日至2016年6月30日)



## §4 管理人報告

### 4.1 基金管理人及基金經理情況

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

華夏基金管理有限公司成立於 1998 年 4 月 9 日，是經中國證監會批准成立

的首批全國性基金管理公司之一。公司總部設在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、廣州及青島設有分公司，在香港、深圳、上海設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人，以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資人謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心基金業績統計報告，在基金分類排名中（截至 2016 年 6 月 30 日資料），華夏策略混合在 75 隻靈活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 8，華夏滬深 300 指數增強 A 在 39 隻增強指數股票型基金中排名第 11；固定收益類產品中，華夏理財 30 天債券在 41 隻短期理財債券型基金中排名第 9，華夏薪金寶貨幣在 194 隻貨幣型基金中排名第 13。

在《中國證券報》主辦的第十三屆中國基金業金牛獎的評選中，華夏基金獲得“2015 年度被動投資金牛基金公司”獎。在《上海證券報》主辦的第十三屆中國“金基金”獎評選中，華夏基金獲得“2015 年度金基金·債券投資回報基金管理公司”獎。

在客戶服務方面，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性及服務體驗：（1）實現資產證明及對帳單自動獲取，客戶可以自助提交申請並查詢辦理進度，業務處理更加高效；（2）網上交易平台上線交通銀行、招商銀行、民生銀行、郵政儲蓄銀行等快捷支付方式及華夏財富系統，並與滴滴出行合作推出滴滴金桔寶理財，拓寬客戶交易通道，增加交易便利性；（3）

開展“130 萬人定投的華夏紅利”、“客戶個性化白皮書”、“你定，我投”、“書寫華夏印象，見證一個行業”等活動，為客戶提供多樣化的關懷服務。

#### 4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
蔡向陽	本基金的基金經理、股票投資部高級副總裁	2014-05-28	-	10 年	中國農業大學金融學碩士。曾任天相投資顧問有限公司、新華資產管理股份有限公司研究員等。2007 年 10 月加入華夏基金管理有限公司，曾任研究員、基金經理助理、投資經理等。
王怡歡	本基金的基金經理、股票投資部執行總經理	2015-01-20	-	12 年	北京大學經濟學碩士。2004 年 6 月加入華夏基金管理有限公司，曾任行業研究員、行業研究主管、基金經理助理等。
代瑞亮	本基金的基金經理、股票投資部總監	2015-03-17	-	6 年	北京大學金融學碩士。2010 年 7 月加入華夏基金管理有限公司，曾任研究員、基金經理助理等。
陳偉彥	本基金的基金經理、股票投資部高級副總裁	2015-11-19	-	9 年	廈門大學統計學碩士。曾任華泰聯合證券有限責任公司研究員等。2010 年 3 月加入華夏基金管理有限公司，曾任研究員、基金經理助理等。

注：①上述任職日期、離任日期根據本基金管理人對外披露的任免日期填寫。

②證券從業的含義遵從行業協會《證券業從業人員資格管理辦法》的相關規定。

#### 4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《中華人民共和國證券投資基金法》、

《公開募集證券投資基金運作管理辦法》、《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《基金管理公司開展投資、研究活動防控內幕交易指導意見》、基金合同及其他有關法律法規，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理及運用基金資產，在嚴格控制投資風險的基礎上，為基金份額持有人謀求最大利益，沒有損害基金份額持有人利益的行為。

#### 4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

##### 4.3.1 公平交易制度的執行情況

本基金管理人一貫公平對待旗下管理的所有基金及組合，制定並嚴格遵守相應的制度及流程，通過系統及人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本公司嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》及《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

##### 4.3.2 異常交易行為的專項說明

報告期內未發現本基金存在異常交易行為。

報告期內，未出現涉及本基金的交易所公開競價同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該證券當日成交量 5% 的情況。

#### 4.4 管理人對報告期內基金的投資策略及業績表現的說明

##### 4.4.1 報告期內基金投資策略及運作分析

上半年，美國未進行加息，歐元區及日本實施負利率政策，A 股加入 MSCI 推遲，英國脫歐，人民幣匯率又一次突破了 6.6。國內方面，宏觀經濟總體平穩，最大的亮點來自地產行業，一線城市及部分二線城市房地產價格快速上漲，值得注意的是，居民中長期貸款在地產銷售中的比重快速上升，槓桿水準的絕對值也達到了歷史最高位，一定程度上表明房地產行業的槓桿風險通過

去庫存的過程實現了從企業部門向居民部門的轉移。此外，PPI 負值缺口迅速收窄，CPI 總體平穩，這表示通縮得到了一定程度的緩解，國內經濟的短期基本面及企業盈利水準得到一定改善。

市場方面，1 季度，A 股市場大幅下跌，2 季度則呈現弱勢震盪的格局，新能源汽車、OLED、半導體、物聯網等主題階段性構成了市場全部的賺錢效應，市場二八現象十分明顯。

投資操作上，本基金在年初保持了較低倉位，在指數快速下跌時損失相對較小，並在低位增持了部分穩定成長類及價值類個股，獲得了一定收益，2 季度，本基金主要配置了銀行、建築、醫療、消費、通訊等領域個股。

#### 4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份額淨值為 1.162 元，本報告期份額淨值增長率為-5.37%，同期業績比較基準增長率為 0.75%。

#### 4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望下半年，預計財政政策將繼續發力，貨幣政策仍將處於寬鬆週期中，中國經濟將維持穩定，但週邊的不確定性將有所增加。A 股市場方面，由於減持解禁的增加，流入資金有限，不存在整體機會，在弱市過程中，仍需找到真實成長個股來抵禦市場風險。投資策略上，本基金將重點關注性價比高的個股，“自下而上”精選個股。

珍惜基金份額持有人的每一分投資及每一份信任，本基金將繼續奉行華夏基金管理有限公司“為信任奉獻回報”的經營理念，規範運作，審慎投資，勤勉盡責地為基金份額持有人謀求長期、穩定的回報。

#### 4.6 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人應嚴格按照新準則、中國證監會相關規定及基金合同關於估值的約定，對基金所持有的投資品種進行估值。本基金託管人根據法律法規要求履行估值及淨值計算的覆核責任。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在 0.25% 以上時對所採用的相關估值模型、假設及參數的適當性發表審核意見並發出報告。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。其中，本基金管理人為了確保估值工作的合規開展，建立了負責估值工作決策及執行的專門機構，組成人員包括主管基金運營的公司領導或其授權人、督察長、投資風控工作負責人、證券研究工作負責人、合規負責人及基金會計工作負責人等，以上人員具有豐富的風控、證券研究、合規、會計方面的專業經驗。同時，根據基金管理公司制定的相關制度，估值工作決策機構的成員中不包括基金經理。本報告期內，參與估值流程各方之間無重大利益衝突。

#### 4.7 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

本基金本報告期未進行利潤分配，符合相關法規及基金合同的規定。

#### 4.8 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

## §5 託管人報告

### 5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，中國銀行股份有限公司（以下稱“本託管人”）在華夏回報證券投資基金（以下稱“本基金”）的託管過程中，嚴格遵守《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同及託管協議的有關規定，不存在損害基金

份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了應盡的義務。

## 5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期內，本託管人根據《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同及託管協議的規定，對本基金管理人的投資運作進行了必要的監督，對基金資產淨值的計算、基金份額申購贖回價格的計算以及基金費用開支等方面進行了認真地覆核，未發現本基金管理人存在損害基金份額持有人利益的行為。

## 5.3 託管人對本半年度報告中財務資訊等內容的真實、準確及完整發表意見

本報告中的財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告（注：財務會計報告中的“金融工具風險及管理”部分未在託管人覆核範圍內）、投資組合報告等資料真實、準確及完整。

## §6 半年度財務會計報告（未經審計）

### 6.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2016 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>資產：</b>			
銀行存款	6.4.7.1	689,138,667.78	438,027,605.72
結算備付金		2,472,251.49	12,062,079.52
存出保證金		1,931,934.51	2,955,841.07
交易性金融資產	6.4.7.2	6,408,442,546.21	6,996,543,009.19
其中：股票投資		3,667,917,814.71	3,263,829,928.19

基金投資		-	-
債券投資		2,737,018,731.50	3,727,518,081.00
資產支持證券投資		3,506,000.00	5,195,000.00
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產	6.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	6.4.7.4	49,500,194.25	199,000,169.50
應收證券清算款		103,883,433.05	79,345,864.85
應收利息	6.4.7.5	44,992,692.12	70,957,661.53
應收股利		-	-
應收申購款		496,118.68	10,138,695.00
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	6.4.7.6	-	-
資產總計		7,300,857,838.09	7,809,030,926.38
<b>負債及所有者權益</b>	<b>附注號</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>負債：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	6.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		6,554,332.21	150,879,430.03
應付贖回款		9,544,143.37	9,941,723.72
應付管理人報酬		8,799,336.21	9,578,577.04
應付託管費		1,466,556.03	1,596,429.50
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	6.4.7.7	19,374,206.34	30,303,377.32
應交稅費		78,498.16	78,498.16
應付利息		-	-
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	6.4.7.8	704,967.20	1,127,468.33
負債合計		46,522,039.52	203,505,504.10
<b>所有者權益：</b>			
實收基金	6.4.7.9	6,241,301,191.94	6,191,477,535.36
未分配利潤	6.4.7.10	1,013,034,606.63	1,414,047,886.92
所有者權益合計		7,254,335,798.57	7,605,525,422.28

負債及所有者權益總計		7,300,857,838.09	7,809,030,926.38
------------	--	------------------	------------------

注：報告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份額淨值 1.162 元，基金份額總額 6,241,301,191.94 份。

## 6.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-330,819,477.63	2,468,774,438.61
1.利息收入		52,320,963.72	75,695,739.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,937,766.83	3,506,569.48
債券利息收入		49,067,004.25	68,152,856.10
資產支持證券利息收入		118,982.51	211,160.83
買入返售金融資產收入		197,210.13	3,825,152.96
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-265,276,035.35	1,848,115,903.86
其中：股票投資收益	6.4.7.12	-286,443,815.93	1,790,214,062.90
基金投資收益		-	-
債券投資收益	6.4.7.13	217,450.03	20,087,694.84
資產支持證券投資收益	6.4.7.14	-	-
貴金屬投資收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	20,950,330.55	37,814,146.12
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	6.4.7.18	-118,397,610.39	539,559,939.63
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	6.4.7.19	533,204.39	5,402,855.75
<b>減：二、費用</b>		74,062,816.89	109,372,488.87
1.管理人報酬		52,451,982.12	70,380,892.26
2.託管費		8,741,996.99	11,730,148.62
3.銷售服務費		-	-

4.交易費用	6.4.7.20	12,663,242.84	27,038,347.04
5.利息支出		-	36.25
其中：賣出回購金融資產支出		-	36.25
6.其他費用	6.4.7.21	205,594.94	223,064.70
三、利潤總額(虧損總額以“-”號填列)		-404,882,294.52	2,359,401,949.74
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤(淨虧損以“-”號填列)		-404,882,294.52	2,359,401,949.74

## 6.3 所有者權益(基金淨值)變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2016年1月1日至2016年6月30日

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	6,191,477,535.36	1,414,047,886.92	7,605,525,422.28
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利潤)	-	-404,882,294.52	-404,882,294.52
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數(淨值減少以“-”號填列)	49,823,656.58	3,869,014.23	53,692,670.81
其中：1.基金申購款	427,800,176.05	52,425,171.98	480,225,348.03
2.基金贖回款	-377,976,519.47	-48,556,157.75	-426,532,677.22
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-	-
五、期末所有者權益(基金淨值)	6,241,301,191.94	1,013,034,606.63	7,254,335,798.57
項目	上年度可比期間 2015年1月1日至2015年6月30日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益(基金淨值)	7,064,090,326.45	2,067,352,280.09	9,131,442,606.54
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數(本期利	-	2,359,401,949.74	2,359,401,949.74

潤)			
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”號填列）	-924,500,842.11	-435,401,291.28	-1,359,902,133.39
其中：1.基金申購款	2,111,609,896.79	850,596,322.33	2,962,206,219.12
2.基金贖回款	-3,036,110,738.90	-1,285,997,613.61	-4,322,108,352.51
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動（淨值減少以“-”號填列）	-	-1,808,897,325.86	-1,808,897,325.86
五、期末所有者權益（基金淨值）	6,139,589,484.34	2,182,455,612.69	8,322,045,097.03

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 6.1 至 6.4 財務報表由下列負責人簽署：

<u>楊明輝</u>	<u>汪貴華</u>	<u>汪貴華</u>
基金管理人負責人	主管會計工作負責人	會計機構負責人

## 6.4 報表附注

### 6.4.1 基金基本情況

華夏回報證券投資基金（以下簡稱“本基金”）經中國證券監督管理委員會（以下簡稱“中國證監會”）證監基金字[2003]86 號《關於同意華夏回報證券投資基金設立的批復》核准，由基金發起人華夏基金管理有限公司依照《證券投資基金管理暫行辦法》（於 2004 年 9 月 16 日廢止，由《中華人民共和國證券投資基金法》取代）、《開放式證券投資基金試點辦法》（已廢止）等有關規定及《華夏回報證券投資基金基金契約》（於 2004 年 10 月 15 日改為《華夏回報證券投資基金基金合同》）發起，並於 2003 年 9 月 5 日募集成立。本基金為契約型開放式，存續期限不定，首次設立募集不包括認購資金利息共募集 3,796,885,823.40 元，業經普華永道中天會計師事務所有限公司普華永道驗字（2003）第 112 號驗資報告予以驗證。有關基金設立等文件已按規定向中國證

監會備案。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司，基金託管人為中國銀行股份有限公司。根據基金管理人 2015 年 7 月 2 日刊登的《華夏基金管理有限公司關於修訂華夏回報證券投資基金基金合同的公告》，本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 類基金份額類別。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》、《華夏回報證券投資基金基金合同》等有關規定，本基金的投資範圍限於具有良好流動性的金融工具，包括國內依法公開發行上市的股票、債券、權證、資產支援證券及中國證監會允許基金投資的其他金融工具。其中債券包括國債、金融債、企業（公司）債（包括可轉債）等。

#### 6.4.2 會計報表的編制基礎

本基金的財務報表按照財政部於 2006 年 2 月 15 日及其後頒佈及修訂的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則及其他相關規定(以下合稱“企業會計準則”)、中國證券投資基金業協會(以下簡稱“中國基金業協會”)於 2012 年 11 月 16 日頒佈的《證券投資基金會計核算業務指引》、中國證監會發佈的《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和半年度報告>》及中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 6.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編制。

#### 6.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的財務狀況以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期間的經營成果及基金淨值變動情況等有關資訊。

#### 6.4.4 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本基金本報告期會計報表所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度會計報表所採用的會計政策、會計估計一致。

#### 6.4.5 會計政策及會計估計變更以及差錯更正的說明

##### 6.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

##### 6.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

##### 6.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容及更正金額。

#### 6.4.6 稅項

根據財政部、國家稅務總局財稅[2002]128 號《關於開放式證券投資基金有關稅收問題的通知》、財稅[2004]78 號《關於證券投資基金稅收政策的通知》、財稅[2005]103 號《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《財政部、國家稅務總局關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》及其他相關財稅法規及實務操作，主要稅項列示如下：

1、以發行基金方式募集資金不屬於營業稅或增值稅徵收範圍，不徵收營業稅或增值稅。

2、基金買賣股票、債券的差價收入暫免徵營業稅及企業所得稅。

3、存款利息收入不徵收增值稅。

4、國債、地方政府債及政策性金融債券利息收入、質押式買入返售金融商品利息收入、基金買賣股票、債券的差價收入免徵增值稅。

5、對基金取得的股票的股息、紅利收入、債券的利息收入，由上市公司、債券發行企業在向基金派發股息、紅利收入、利息收入時代扣代繳 20% 的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50% 計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暫免徵收個人所得稅。

6、基金賣出股票按 0.1% 的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。

7、基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免徵收印花稅、企業所得稅及個人所得稅。

#### 6.4.7 重要財務報表項目的說明

##### 6.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	689,138,667.78
定期存款	-
其他存款	-
合計	689,138,667.78

##### 6.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末

		2016年6月30日		
		成本	公允價值	公允價值變動
股票		3,548,407,916.70	3,667,917,814.71	119,509,898.01
貴金屬投資-金交所黃金合約		-	-	-
債券	交易所市場	43,817,356.35	44,584,231.50	766,875.15
	銀行間市場	2,657,495,528.87	2,692,434,500.00	34,938,971.13
	合計	2,701,312,885.22	2,737,018,731.50	35,705,846.28
資產支持證券		3,506,000.00	3,506,000.00	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合計		6,253,226,801.92	6,408,442,546.21	155,215,744.29

#### 6.4.7.3 衍生金融資產/負債

本基金本報告期末無衍生金融資產/負債餘額。

#### 6.4.7.4 買入返售金融資產

##### 6.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
銀行間同業市場買入返售金融資產	49,500,194.25	-
合計	49,500,194.25	-

##### 6.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

本基金本報告期末未持有買斷式逆回購交易中取得的債券。

#### 6.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
應收活期存款利息	159,130.81
應收定期存款利息	-
應收其他存款利息	-

應收結算備付金利息	1,111.77
應收債券利息	44,768,805.91
應收買入返售證券利息	6,532.33
應收申購款利息	-
應收黃金合約拆借孳息	-
其他	57,111.30
合計	44,992,692.12

#### 6.4.7.6 其他資產

本基金本報告期末無其他資產餘額。

#### 6.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
交易所市場應付交易費用	19,369,623.59
銀行間市場應付交易費用	4,582.75
合計	19,374,206.34

#### 6.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年6月30日
應付券商交易單元保證金	500,000.00
應付贖回費	35,896.48
預提費用	169,070.72
合計	704,967.20

#### 6.4.7.9 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份額(份)	帳面金額
上年度末	6,191,477,535.36	6,191,477,535.36
本期申購	427,800,176.05	427,800,176.05
本期贖回(以“-”號填列)	-377,976,519.47	-377,976,519.47

本期末	6,241,301,191.94	6,241,301,191.94
-----	------------------	------------------

#### 6.4.7.10 未分配利潤

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	83,429,821.15	1,330,618,065.77	1,414,047,886.92
本期利潤	-286,484,684.13	-118,397,610.39	-404,882,294.52
本期基金份額交易產生的變動數	1,186,815.09	2,682,199.14	3,869,014.23
其中：基金申購款	-7,226,124.78	59,651,296.76	52,425,171.98
基金贖回款	8,412,939.87	-56,969,097.62	-48,556,157.75
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	-201,868,047.89	1,214,902,654.52	1,013,034,606.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	2,841,858.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
結算備付金利息收入	77,882.62
其他	18,025.49
合計	2,937,766.83

#### 6.4.7.12 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
賣出股票成交總額	4,198,770,529.54
減：賣出股票成本總額	4,485,214,345.47
買賣股票差價收入	-286,443,815.93

#### 6.4.7.13 債券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成交總額	2,423,762,531.59
減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	2,375,255,409.97
減：應收利息總額	48,289,671.59
買賣債券差價收入	217,450.03

#### 6.4.7.14 資產支持證券投資收益

本基金本報告期無資產支持證券投資收益。

#### 6.4.7.15 貴金屬投資收益

##### 6.4.7.15.1 貴金屬投資收益項目構成

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

##### 6.4.7.15.2 貴金屬投資——買賣貴金屬差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

##### 6.4.7.15.3 貴金屬投資——贖回差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

##### 6.4.7.15.4 貴金屬投資——申購差價收入

本基金本報告期無貴金屬投資收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

本基金本報告期無買賣權證差價收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本報告期無其他衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投資產生的股利收益	20,950,330.55
基金投資產生的股利收益	-
合計	20,950,330.55

#### 6.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1.交易性金融資產	-118,397,610.39
——股票投資	-102,205,939.25
——債券投資	-16,191,671.14
——資產支持證券投資	-
——基金投資	-
——貴金屬投資	-
2.衍生工具	-
——權證投資	-
3.其他	-
合計	-118,397,610.39

#### 6.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金贖回費收入	533,204.39
合計	533,204.39

#### 6.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市場交易費用	12,648,442.84
銀行間市場交易費用	14,800.00
合計	12,663,242.84

#### 6.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
審計費用	49,726.04
信息披露費	119,344.68
銀行間帳戶維護費	18,000.00
銀行費用	17,924.22
其他	600.00
合計	205,594.94

#### 6.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

##### 6.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

##### 6.4.8.2 資產負債表日後事項

截至財務報表批准日，本基金無資產負債表日後事項。

#### 6.4.9 關聯方關係

##### 6.4.9.1 本報告期存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況

本基金本報告期不存在控制關係或其他重大利害關係的關聯方發生變化的情況。

##### 6.4.9.2 本報告期與基金發生關聯交易的各關聯方

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金發起人、基金管理人、基金註冊登記機構、基金銷售機構
中國銀行股份有限公司("中國銀行")	基金託管人、基金銷售機構
中信證券股份有限公司("中信證券")	基金管理人的股東、基金銷售機構

注：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

#### 6.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

##### 6.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2016年1月1日至2016年6月30 日		上年度可比期間 2015年1月1日至2015年6月30 日	
	成交金額	佔當期股票成交 總額的比例	成交金額	佔當期股票成交 總額的比例
中信證券	2,417,993,735.88	26.31%	699,309,336.76	4.10%

#### 6.4.10.1.2 權證交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方交易單元進行權證交易。

#### 6.4.10.1.3 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2016年1月1日至2016年6月30 日		上年度可比期間 2015年1月1日至2015年6月30 日	
	成交金額	佔當期債券成交 總額的比例	成交金額	佔當期債券成交 總額的比例
中信證券	-	-	14,651,625.50	28.65%

#### 6.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年6月30日	
	成交金額	佔當期債券回購 成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購 成交總額的比例
中信證券	-	-	2,000,000,000.00	49.99%

#### 6.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	當期佣金	佔當期佣金 總量的比例	期末應付佣金餘 額	佔期末應付佣金 總額的比例

中信證券	1,776,160.41	23.26%	858,386.42	4.43%
關聯方名稱	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	當期佣金	佔當期佣金 總量的比例	期末應付佣金餘 額	佔期末應付佣金 總量的比例
中信證券	636,651.09	4.34%	636,651.09	1.93%

注：上述佣金按市場佣金率計算，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取證管費、經手費及由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。

該類佣金協議的服務範圍還包括佣金收取方為本基金提供的證券投資研究成果及市場訊息服務。

#### 6.4.10.2 關聯方報酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
當期發生的基金應支付的管理費	52,451,982.12	70,380,892.26
其中：支付銷售機構的客戶維護費	4,622,882.75	6,052,685.16

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.5%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬=前一日基金資產淨值×1.5%/當年天數。

③客戶維護費是指基金管理人與基金銷售機構約定的用以向基金銷售機構支付客戶服務及銷售活動中產生的相關費用，該費用按照代銷機構所代銷基金的份額保有量作為基數進行計算，從基金管理人收取的基金管理費中列支，不屬於從基金資產中列支的費用項目。

##### 6.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	--	---

當期發生的基金應支付的託管費	8,741,996.99	11,730,148.62
----------------	--------------	---------------

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.25% 的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費 = 前一日基金資產淨值 × 0.25% / 當年天數。

#### 6.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

本基金本報告期及上年度可比期間均未與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易。

#### 6.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況

##### 6.4.10.4.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

份額單位：份

項目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
期初持有的基金份額	16,278,317.76	-
期間申購/買入總份額	-	-
期間因拆分變動份額	-	-
減：期間贖回/賣出總份額	-	-
期末持有的基金份額	16,278,317.76	-
期末持有的基金份額佔基金總份額比例	0.26%	-

##### 6.4.10.4.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

本基金本報告期末及上年度末均無除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況。

##### 6.4.10.5 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
-------	--	---

	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國銀行活期存款	689,138,667.78	2,841,858.72	1,125,334,128.97	3,339,454.34

注：本基金的活期銀行存款由基金託管人中國銀行保管，按銀行同業利率計息。

#### 6.4.10.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

本基金本報告期及上年度可比期間均未通過關聯方購買其承銷的證券。

#### 6.4.11 利潤分配情況

本基金本報告期無利潤分配事項。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限證券

##### 6.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

6.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	可流通日	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量（單位：股）	期末成本總額	期末估值總額	備註
601966	玲瓏輪胎	2016-06-24	2016-07-06	新發流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新發流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大國創	2016-06-30	2016-07-08	新發流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	豐元股份	2016-06-29	2016-07-07	新發流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

金額單位：人民幣元

股票代碼	股票名稱	停牌日期	停牌原因	期末估值單價	復牌日期	復牌開盤單價	數量（股）	期末成本總額	期末估值總額	備註
600843	上工申貝	2016-02-18	重大事項	13.71	2016-07-26	15.08	1,935,400	27,484,561.62	26,534,334.00	-
002387	黑牛食品	2016-05-25	重大事項	18.36	2016-08-03	17.55	983,066	14,582,536.35	18,049,091.76	-
000401	冀東水泥	2016-04-06	重大	10.60	2016-07-14	11.32	1,245,600	13,312,366.00	13,203,360.00	-

			事項							
600654	中安消	2016-05-19	重大事項	21.50	2016-08-08	20.39	450,000	12,297,211.00	9,675,000.00	-
300351	永貴電器	2016-06-29	重大事項	33.93	2016-07-04	33.30	200,000	5,732,526.00	6,786,000.00	-
002576	通達動力	2016-06-14	重大事項	18.83	-	-	292,300	6,483,516.51	5,504,009.00	-
002355	興民鋼圈	2016-05-12	重大事項	19.35	-	-	200,000	4,063,387.00	3,870,000.00	-
002587	奧拓電子	2016-04-19	重大事項	14.45	2016-07-28	14.00	261,994	3,748,703.89	3,785,813.30	-
002389	南洋科技	2016-02-03	重大事項	12.95	-	-	200,000	3,725,681.00	2,590,000.00	-
601611	中國核建	2016-06-30	重大事項	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
002101	廣東鴻圖	2016-05-03	重大事項	21.62	-	-	6,630	147,124.80	143,340.60	-
300508	維宏股份	2016-06-30	重大事項	254.50	2016-07-06	242.00	92	1,847.36	23,414.00	-
300503	昊志機電	2016-06-30	重大事項	84.72	2016-07-05	87.77	168	1,296.96	14,232.96	-

注：上述股票的復牌日期及復牌開盤單價更新截至本財務報表批准日。

#### 6.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

##### 6.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

截至本報告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金沒有因從事銀行間市場債券正回購交易形成的賣出回購證券款餘額。

##### 6.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

截至本報告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金沒有因從事交易所市場債券正回購交易形成的賣出回購證券款餘額。

#### 6.4.13 金融工具風險及管理

##### 6.4.13.1 風險管理政策及組織架構

本基金一貫的風險管理政策是使基金投資風險可測、可控、可承擔。本基金管理人建立了由風險管理委員會、督察長、法律部、合規部、稽核部、風險

管理部及相關業務部門構成的多層次風險管理架構體系。風險管理團隊在識別、衡量投資風險後，通過正式報告的方式，將分析結果及時傳達給基金經理、投資總監、投資決策委員會及風險管理委員會，協助制定風險控制決策，實現風險管理目標。

本基金管理人主要通過定性分析及定量分析的方法，估測各種金融工具風險可能產生的損失。本基金管理人從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重性；從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用的金融工具特徵，通過特定的風險量化指標、模型及日常的量化報告，確定風險損失的限度及相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查及評估，並制定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

#### 6.4.13.2 信用風險

信用風險是指由於基金所投資債券的發行人出現違約、拒絕支付到期本息，債券發行人信用評級降低導致債券價格下降，或基金在交易過程中發生交收違約，而造成基金資產損失的可能性。

本基金管理人通過信用分析團隊建立了內部評級體系及交易對手庫，對發行人及債券投資進行內部評級，對交易對手的資信狀況進行充分評估、設定授信額度，以控制可能出現的信用風險。

#### 6.4.13.3 流動性風險

流動性風險是在市場或持有資產流動性不足的情況下，基金管理人可能無法迅速、低成本地調整基金投資組合，從而對基金收益造成不利影響。

本基金管理人通過限制投資集中度來管理投資品種變現的流動性風險。本基金所投資的證券在證券交易所或銀行間市場交易，除在“6.4.12 期末本基金

持有的流通受限證券”中列示的部分基金資產流通暫時受限制的情況外，其餘均能及時變現。

#### 6.4.13.4 市場風險

市場風險是指由於市場變化或波動所引起的資產損失的可能性，本基金管理人通過監測組合久期、Beta 值等指標來衡量市場風險。

##### 6.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指利率變動引起組合中資產特別是債券投資的市場價格變動，從而影響基金投資收益的風險。

本基金管理人定期對組合中債券投資部分面臨的利率風險進行監控，並通過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 承受利率風險

單位：人民幣元

本期末 2016年6月30日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	689,138,667.78	-	-	689,138,667.78
結算備付金	2,472,251.49	-	-	2,472,251.49
結算保證金	1,931,934.51	-	-	1,931,934.51
債券投資	1,131,915,231.50	739,934,500.00	865,169,000.00	2,737,018,731.50
資產支持證券	3,506,000.00	-	-	3,506,000.00
買入返售金融資產	49,500,194.25	-	-	49,500,194.25
應收直銷申購款	14,212.95	-	-	14,212.95
賣出回購金融資產款	-	-	-	-
上年度末 2015年12月31日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	438,027,605.72	-	-	438,027,605.72
結算備付金	12,062,079.52	-	-	12,062,079.52
結算保證金	2,955,841.07	-	-	2,955,841.07
債券投資	2,362,446,800.00	817,500,281.00	547,571,000.00	3,727,518,081.00
資產支持證券	-	5,195,000.00	-	5,195,000.00

買入返售金融資產	199,000,169.50	-	-	199,000,169.50
應收直銷申購款	170,736.54	-	-	170,736.54
賣出回購金融資產款	-	-	-	-

注：本表所示為本基金生息資產及負債的公允價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

#### 6.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

假設	1、該利率敏感性分析資料結果為基於本基金報表日組合持有固定收益類資產的利率風險狀況測算的理論變動值對基金資產淨值的影響金額。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度變動 25 個基點，其他市場變數均不發生變化。		
	3、此項影響並未考慮基金經理為降低利率風險而可能採取的風險管理活動。		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	利率下降 25 個基點	19,596,122.95	15,298,874.50
利率上升 25 個基點	-19,267,258.27	-15,188,059.58	

#### 6.4.13.4.2 外匯風險

本基金持有的金融工具以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

#### 6.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率及外匯匯率以外的市場因素發生變動時產生的價格波動風險。本基金的其他價格風險主要為市場價格變化或波動所引起的股票資產損失的可能性。

本基金通過投資組合的分散化降低市場價格風險。此外，本基金管理人對本基金所持有的股票價格實施監控，定期運用多種定量方法進行風險度量及分析，以對風險進行跟蹤及控制。

#### 6.4.13.4.3.1 承受其他價格風險

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
交易性金融資產-股票投資	3,667,917,814.71	50.56	3,263,829,928.19	42.91
交易性金融資產-貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產-權證投資	-	-	-	-
合計	3,667,917,814.71	50.56	3,263,829,928.19	42.91

#### 6.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	1、估測組合市場價格風險的資料為滬深 300 指數變動時，股票資產相應的理論變動值對基金資產淨值的影響金額。		
	2、假定滬深 300 指數變化 5%，其他市場變數均不發生變化。		
	3、Beta 係數是根據組合在報表日股票持倉資產在過去 100 個交易日與其對應的指數資料回歸加權得出，對於交易少於 100 個交易日的資產，預設其波動與市場同步。		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	+5%	216,517,188.60	163,109,900.66
	-5%	-216,517,188.60	-163,109,900.66

#### 6.4.14 有助於理解及分析會計報表需要說明的其他事項

##### 6.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法

根據企業會計準則的相關規定，以公允價值計量的金融工具，其公允價值的計量可分為三個層次：

第一層次：對存在活躍市場報價的金融工具，可以相同資產/負債在活躍市場上的報價確定公允價值。

第二層次：對估值日活躍市場無報價的金融工具，可以類似資產/負債在活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值；對估值日不存在活躍市場的金融工具，可以相同或類似資產/負債在非活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值。

第三層次：對無法獲得相同或類似資產可比市場交易價格的金融工具，可以其他反映市場參與者對資產/負債定價時所使用的參數為依據確定公允價值。

#### 6.4.14.2 各層次金融工具公允價值

截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允價值計量的金融工具第一層次的餘額為 3,658,220,454.71 元，第二層次的餘額為 2,750,222,091.50 元，第三層次的餘額為 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一層次的餘額為 3,149,300,972.43 元，第二層次的餘額為 3,847,242,036.76 元，第三層次的餘額為 0 元。）

#### 6.4.14.3 公允價值所屬層次間的重大變動

對於特殊事項停牌的股票、收盤價異常的債券，本基金將相關股票及債券公允價值所屬層次於其進行估值調整之日起從第一層次轉入第二層次或第三層次，於股票復牌、債券收盤價能體現公允價值並恢復市價估值之日起從第二層次或第三層次轉入第一層次。對於持有的非公開發行股票，本基金於限售期內將相關股票公允價值所屬層次列入第二層次，於限售期滿並恢復市價估值之日起從第二層次轉入第一層次。對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券、資產支持證券及私募債券除外)，本基金於 2015 年 3 月 20 日起改為採用中證指數有限公司根據《中國證券投資基金業協會估值核算工作小組關於 2015 年 1 季度固定收益品種的估值處理標準》所獨立提供的估值結果確定公允價值，並將其公允價值從第一層次調整至第二層次。

#### 6.4.14.4 第三層次公允價值本期變動金額

本基金持有的以公允價值計量的金融工具第三層次公允價值本期未發生變動。

## §7 投資組合報告

### 7.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	3,667,917,814.71	50.24
	其中：股票	3,667,917,814.71	50.24
2	固定收益投資	2,740,524,731.50	37.54
	其中：債券	2,737,018,731.50	37.49
	資產支持證券	3,506,000.00	0.05
3	貴金屬投資	-	-
4	金融衍生品投資	-	-
5	買入返售金融資產	49,500,194.25	0.68
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
6	銀行存款及結算備付金合計	691,610,919.27	9.47
7	其他各項資產	151,304,178.36	2.07
8	合計	7,300,857,838.09	100.00

### 7.2 期末按行業分類的股票投資組合

金額單位：人民幣元

代碼	行業類別	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
A	農、林、牧、漁業	17,798,645.43	0.25
B	採礦業	37,733,040.00	0.52
C	製造業	1,941,106,311.79	26.76
D	電力、熱力、燃氣及水生產及供應業	54,630,559.00	0.75
E	建築業	382,934,494.14	5.28
F	批發及零售業	259,822,503.23	3.58
G	交通運輸、倉儲及郵政業	121,917,328.90	1.68
H	住宿及餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體及資訊技術服務業	285,330,527.72	3.93
J	金融業	292,189,039.81	4.03
K	房地產業	193,063,346.09	2.66
L	租賃及商務服務業	28,449,390.00	0.39
M	科學研究及技術服務業	28,992,399.40	0.40

N	水利、環境及公共設施管理業	3,530,128.00	0.05
O	居民服務、修理及其他服務業	-	-
P	教育	5,435,222.00	0.07
Q	衛生及社會工作	-	-
R	文化、體育及娛樂業	14,984,879.20	0.21
S	綜合	-	-
	合計	3,667,917,814.71	50.56

## 7.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量（股）	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	002051	中工國際	15,897,738	312,708,506.46	4.31
2	300017	網宿科技	3,251,441	218,496,835.20	3.01
3	600276	恒瑞醫藥	5,098,841	204,514,512.51	2.82
4	601012	隆基股份	13,446,975	175,483,023.75	2.42
5	000963	華東醫藥	2,205,109	148,624,346.60	2.05
6	600036	招商銀行	8,100,000	141,750,000.00	1.95
7	600612	老鳳祥	2,923,514	119,425,546.90	1.65
8	000423	東阿阿膠	1,501,147	79,305,596.01	1.09
9	300156	神霧環保	3,465,043	71,310,584.94	0.98
10	600376	首開股份	6,397,675	71,142,146.00	0.98
11	600004	白雲機場	5,294,930	64,915,841.80	0.89
12	000729	燕京啤酒	7,846,460	59,554,631.40	0.82
13	601607	上海醫藥	3,281,627	59,233,367.35	0.82
14	600060	海信電器	2,861,348	50,588,632.64	0.70
15	002595	豪邁科技	2,354,587	50,317,524.19	0.69
16	300269	聯建光電	1,810,020	47,024,319.60	0.65
17	600337	美克家居	3,582,456	46,607,752.56	0.64
18	600900	長江電力	3,619,100	45,202,559.00	0.62
19	300310	宜通世紀	1,167,708	44,594,768.52	0.61
20	002119	康強電子	2,073,202	42,417,712.92	0.58
21	002456	歐菲光	1,394,717	41,144,151.50	0.57
22	300195	長榮股份	2,164,276	40,147,319.80	0.55
23	000687	華訊方舟	1,980,000	39,204,000.00	0.54
24	000902	新洋豐	3,048,508	38,136,835.08	0.53
25	002508	老闆電器	1,020,949	37,540,294.73	0.52

26	601021	春秋航空	747,215	35,821,487.10	0.49
27	600683	京投發展	3,725,400	34,422,696.00	0.47
28	600132	重慶啤酒	2,199,952	33,417,270.88	0.46
29	002668	奧馬電器	539,300	32,827,191.00	0.45
30	300232	洲明科技	2,044,341	32,402,804.85	0.45
31	601318	中國平安	1,000,000	32,040,000.00	0.44
32	000581	威孚高科	1,462,100	29,475,936.00	0.41
33	603766	隆鑫通用	1,449,912	29,317,220.64	0.40
34	000402	金融街	3,003,393	29,192,979.96	0.40
35	600600	青島啤酒	999,882	29,066,569.74	0.40
36	300008	天海防務	868,318	28,914,989.40	0.40
37	002094	青島金王	1,082,100	28,902,891.00	0.40
38	600398	海瀾之家	2,555,789	28,880,415.70	0.40
39	601328	交通銀行	5,000,936	28,155,269.68	0.39
40	002081	金螳螂	2,699,987	27,053,869.74	0.37
41	600298	安琪酵母	1,499,210	26,745,906.40	0.37
42	601668	中國建築	5,000,000	26,600,000.00	0.37
43	600843	上工申貝	1,935,400	26,534,334.00	0.37
44	600171	上海貝嶺	1,524,988	26,489,041.56	0.37
45	601688	華泰證券	1,400,000	26,488,000.00	0.37
46	600566	濟川藥業	1,028,300	26,468,442.00	0.36
47	300202	聚龍股份	1,049,990	25,420,257.90	0.35
48	601166	興業銀行	1,600,000	24,384,000.00	0.34
49	002043	兔寶寶	2,200,000	22,066,000.00	0.30
50	300296	利亞德	687,629	21,770,334.14	0.30
51	300263	隆華節能	1,900,000	21,242,000.00	0.29
52	600029	南方航空	3,000,000	21,180,000.00	0.29
53	002180	艾派克	722,725	20,619,344.25	0.28
54	600138	中青旅	984,400	19,018,608.00	0.26
55	002588	史丹利	1,500,000	18,525,000.00	0.26
56	000567	海德股份	574,528	18,183,811.20	0.25
57	002387	黑牛食品	983,066	18,049,091.76	0.25
58	600137	浪莎股份	600,000	17,574,000.00	0.24
59	600585	海螺水泥	1,200,000	17,448,000.00	0.24
60	002572	索菲亞	309,084	17,314,885.68	0.24
61	600622	嘉寶集團	1,222,450	16,808,687.50	0.23
62	600521	華海藥業	670,388	16,303,836.16	0.22

63	002142	寧波銀行	1,099,960	16,257,408.80	0.22
64	000928	中鋼國際	1,254,253	15,778,502.74	0.22
65	002616	長青集團	707,400	14,643,180.00	0.20
66	600123	蘭花科創	2,000,000	14,360,000.00	0.20
67	002529	海源機械	680,000	13,933,200.00	0.19
68	002032	蘇泊爾	401,054	13,816,310.30	0.19
69	002038	雙鷺藥業	444,400	13,411,992.00	0.18
70	000401	冀東水泥	1,245,600	13,203,360.00	0.18
71	002450	康得新	758,862	12,976,540.20	0.18
72	002367	康力電梯	807,600	12,437,040.00	0.17
73	601939	建設銀行	2,599,966	12,349,838.50	0.17
74	600885	宏發股份	392,000	12,038,320.00	0.17
75	600259	廣晟有色	200,000	11,452,000.00	0.16
76	601169	北京銀行	1,000,000	10,370,000.00	0.14
77	002085	萬豐奧威	600,000	10,314,000.00	0.14
78	002598	山東章鼓	861,600	10,253,040.00	0.14
79	300054	鼎龍股份	400,000	10,008,000.00	0.14
80	600371	萬向德農	599,901	9,718,396.20	0.13
81	600654	中安消	450,000	9,675,000.00	0.13
82	002295	精藝股份	600,000	9,420,000.00	0.13
83	002665	首航節能	1,167,969	9,215,275.41	0.13
84	000910	大亞科技	567,098	8,761,664.10	0.12
85	600048	保利地產	983,441	8,487,095.83	0.12
86	300335	迪森股份	500,000	8,305,000.00	0.11
87	000983	西山煤電	1,000,000	8,150,000.00	0.11
88	600266	北京城建	600,000	7,494,000.00	0.10
89	002321	華英農業	729,671	6,873,500.82	0.09
90	300351	永貴電器	200,000	6,786,000.00	0.09
91	600201	生物股份	245,600	6,712,248.00	0.09
92	002701	奧瑞金	720,000	6,357,600.00	0.09
93	600197	伊力特	421,585	6,340,638.40	0.09
94	300336	新文化	237,400	5,930,252.00	0.08
95	601888	中國國旅	130,900	5,756,982.00	0.08
96	300271	華宇軟件	300,000	5,676,000.00	0.08
97	002533	金杯電工	417,300	5,604,339.00	0.08
98	300424	航新科技	82,000	5,553,040.00	0.08
99	002317	眾生藥業	461,100	5,528,589.00	0.08

100	002576	通達動力	292,300	5,504,009.00	0.08
101	600661	新南洋	193,700	5,435,222.00	0.07
102	002470	金正大	671,200	5,403,160.00	0.07
103	300287	飛利信	400,000	5,360,000.00	0.07
104	600605	匯通能源	275,000	5,304,750.00	0.07
105	600085	同仁堂	173,700	5,174,523.00	0.07
106	300133	華策影視	324,960	5,059,627.20	0.07
107	002205	國統股份	200,023	4,768,548.32	0.07
108	000333	美的集團	200,000	4,744,000.00	0.07
109	002662	京威股份	313,213	4,732,648.43	0.07
110	001979	招商蛇口	319,600	4,554,300.00	0.06
111	601992	金隅股份	585,200	4,535,300.00	0.06
112	000779	三毛派神	200,000	4,490,000.00	0.06
113	002444	巨星科技	200,000	4,064,000.00	0.06
114	002739	萬達院線	50,000	3,995,000.00	0.06
115	002355	興民鋼圈	200,000	3,870,000.00	0.05
116	002587	奧拓電子	261,994	3,785,813.30	0.05
117	600348	陽泉煤業	592,000	3,771,040.00	0.05
118	002400	省廣股份	260,000	3,673,800.00	0.05
119	002454	松芝股份	200,000	3,636,000.00	0.05
120	000888	峨眉山 A	293,200	3,530,128.00	0.05
121	601155	新城控股	299,960	2,777,629.60	0.04
122	002389	南洋科技	200,000	2,590,000.00	0.04
123	002599	盛通股份	66,200	2,371,284.00	0.03
124	603085	天成自控	50,000	2,086,500.00	0.03
125	000820	金城股份	100,000	1,800,000.00	0.02
126	603899	晨光文具	100,000	1,770,000.00	0.02
127	600587	新華醫療	69,547	1,605,840.23	0.02
128	002410	廣聯達	100,000	1,430,000.00	0.02
129	002479	富春環保	100,000	1,123,000.00	0.02
130	600257	大湖股份	100,000	1,113,000.00	0.02
131	002271	東方雨虹	61,700	1,063,091.00	0.01
132	601611	中國核建	37,059	775,274.28	0.01
133	002378	章源鎢業	57,001	595,660.45	0.01
134	002797	第一創業	9,763	394,522.83	0.01
135	002172	澳洋科技	30,609	328,434.57	0.00
136	600596	新安股份	43,200	314,928.00	0.00

137	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.00
138	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
139	601966	玲瓏輪胎	15,341	199,126.18	0.00
140	002101	廣東鴻圖	6,630	143,340.60	0.00
141	300511	雪榕生物	1,407	93,748.41	0.00
142	300512	中亞股份	922	92,126.24	0.00
143	603131	上海滬工	1,263	76,664.10	0.00
144	603339	四方冷鏈	1,368	74,446.56	0.00
145	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
146	300518	盛訊達	1,306	61,186.10	0.00
147	603779	威龍股份	1,376	57,736.96	0.00
148	603959	百利科技	1,382	57,283.90	0.00
149	603101	匯嘉時代	1,746	52,065.72	0.00
150	002795	永和智控	710	48,336.80	0.00
151	002799	環球印務	1,080	47,131.20	0.00
152	300510	金冠電氣	668	45,130.08	0.00
153	603029	天鵝股份	793	35,391.59	0.00
154	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
155	300474	景嘉微	222	33,493.14	0.00
156	603528	多倫科技	280	27,437.20	0.00
157	002792	通宇通訊	444	26,551.20	0.00
158	002802	洪匯新材	1,629	24,565.32	0.00
159	300508	維宏股份	92	23,414.00	0.00
160	603909	合誠股份	1,095	20,126.10	0.00
161	300503	昊志機電	168	14,232.96	0.00
162	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
163	300491	通合科技	100	10,368.00	0.00
164	300505	川金諾	170	10,278.20	0.00
165	002789	建藝集團	135	9,676.80	0.00
166	300520	科大國創	926	9,306.30	0.00
167	603798	康普頓	143	9,136.27	0.00
168	603028	賽福天	298	8,764.18	0.00
169	300506	名家匯	164	8,664.12	0.00
170	002793	東音股份	127	8,256.27	0.00
171	603726	朗迪集團	123	6,217.65	0.00
172	002805	豐元股份	971	5,631.80	0.00
173	600588	用友網路	89	1,742.62	0.00

174	600406	國電南瑞	65	869.05	0.00
175	601519	大智慧	87	799.53	0.00
176	600151	航天機電	69	779.70	0.00
177	603001	奧康國際	35	744.10	0.00
178	300383	光環新網	16	606.40	0.00
179	002559	亞威股份	32	472.00	0.00
180	300081	恒信移動	13	221.00	0.00
181	002520	日發精機	9	132.84	0.00

#### 7.4 報告期內股票投資組合的重大變動

##### 7.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例（%）
1	300017	網宿科技	212,324,788.18	2.79
2	600276	恒瑞醫藥	199,881,401.04	2.63
3	002051	中工國際	196,944,025.02	2.59
4	601012	隆基股份	189,224,123.17	2.49
5	000963	華東醫藥	161,031,851.07	2.12
6	600266	北京城建	143,535,459.41	1.89
7	600376	首開股份	113,357,219.92	1.49
8	600303	曙光股份	108,725,078.76	1.43
9	000423	東阿阿膠	94,590,841.30	1.24
10	601021	春秋航空	89,370,999.92	1.18
11	002092	中泰化學	75,854,695.38	1.00
12	000938	紫光股份	75,777,967.07	1.00
13	601318	中國平安	66,201,709.00	0.87
14	600718	東軟集團	64,814,448.37	0.85
15	300156	神霧環保	64,537,402.76	0.85
16	300007	漢威電子	61,743,540.01	0.81
17	002546	新聯電子	55,567,661.83	0.73
18	601688	華泰證券	55,142,883.45	0.73
19	600036	招商銀行	54,770,784.86	0.72
20	300073	當升科技	52,475,703.27	0.69

注：“買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票詳情

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例 (%)
1	000423	東阿阿膠	284,195,156.74	3.74
2	600303	曙光股份	137,062,522.56	1.80
3	600266	北京城建	136,924,465.42	1.80
4	002092	中泰化學	88,333,356.30	1.16
5	000938	紫光股份	83,931,058.85	1.10
6	600718	東軟集團	82,133,474.62	1.08
7	600036	招商銀行	80,001,688.55	1.05
8	300007	漢威電子	75,567,645.39	0.99
9	002546	新聯電子	73,877,395.47	0.97
10	002662	京威股份	73,278,689.85	0.96
11	600587	新華醫療	70,677,552.45	0.93
12	601318	中國平安	65,673,466.69	0.86
13	002230	科大訊飛	63,079,166.96	0.83
14	600525	長園集團	61,496,101.68	0.81
15	300073	當升科技	60,761,203.27	0.80
16	600060	海信電器	55,726,765.15	0.73
17	000910	大亞科技	55,256,055.82	0.73
18	600398	海瀾之家	54,480,098.98	0.72
19	002051	中工國際	53,275,781.63	0.70
20	600559	老白乾酒	50,883,730.03	0.67

注：“賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	4,991,508,171.24
賣出股票收入（成交）總額	4,198,770,529.54

注：“買入股票成本”、“賣出股票收入”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

7.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	國家債券	62,520,000.00	0.86
2	央行票據	-	-
3	金融債券	2,266,953,500.00	31.25
	其中：政策性金融債	2,266,953,500.00	31.25
4	企業債券	71,598,231.50	0.99
5	企業短期融資券	100,198,000.00	1.38
6	中期票據	235,749,000.00	3.25
7	可轉債（可交換債）	-	-
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	2,737,018,731.50	37.73

7.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有債券投資詳情

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量（張）	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	160408	16 農發 08	2,200,000	221,298,000.00	3.05
2	150205	15 國開 05	2,000,000	207,020,000.00	2.85
3	160414	16 農發 14	2,000,000	200,040,000.00	2.76
4	160304	16 進出 04	2,000,000	199,840,000.00	2.75
5	110216	11 國開 16	1,600,000	163,904,000.00	2.26
6	150416	15 農發 16	1,300,000	130,000,000.00	1.79
7	140228	14 國開 28	1,000,000	104,740,000.00	1.44
8	120401	12 農發 01	1,000,000	102,610,000.00	1.41
9	120412	12 農發 12	1,000,000	102,510,000.00	1.41
10	150201	15 國開 01	1,000,000	101,610,000.00	1.40
11	160207	16 國開 07	1,000,000	99,690,000.00	1.37
12	110316	11 進出 16	800,000	80,248,000.00	1.11
13	011699152	16 中核建 SCP001	800,000	80,192,000.00	1.11
14	130228	13 國開 28	800,000	80,048,000.00	1.10
15	160204	16 國開 04	700,000	69,916,000.00	0.96

16	110024	11 付息國債 24	600,000	62,520,000.00	0.86
17	150304	15 進出 04	500,000	51,885,000.00	0.72
18	150220	15 國開 20	500,000	50,740,000.00	0.70
19	1182346	11 中化工 MTN2	500,000	50,535,000.00	0.70
20	100215	10 國開 15	450,000	45,252,000.00	0.62
21	140222	14 國開 22	400,000	44,704,000.00	0.62
22	122149	12 石化 01	439,470	44,584,231.50	0.61
23	150404	15 農發 04	400,000	41,464,000.00	0.57
24	140229	14 國開 29	300,000	31,848,000.00	0.44
25	1382111	13 國網 MTN1	300,000	30,897,000.00	0.43
26	1382176	13 航機電 MTN1	300,000	30,855,000.00	0.43
27	120303	12 進出 03	300,000	30,816,000.00	0.42
28	140201	14 國開 01	300,000	30,486,000.00	0.42
29	1182226	11 首鋼 MTN1	300,000	30,366,000.00	0.42
30	130212	13 國開 12	300,000	30,066,000.00	0.41
31	080216	08 國開 16	250,000	26,112,500.00	0.36
32	1382269	13 渝保稅 MTN1	200,000	20,812,000.00	0.29
33	1282449	12 滇建工 MTN1	200,000	20,782,000.00	0.29
34	1382131	13 鎮國投 MTN2	200,000	20,640,000.00	0.28
35	1182344	11 首鋼 MTN2	200,000	20,230,000.00	0.28
36	110318	11 進出 18	200,000	20,106,000.00	0.28
37	011699403	16 津城建 SCP001	200,000	20,006,000.00	0.28
38	1280076	12 蕪湖建投債 01	150,000	16,602,000.00	0.23
39	101356006	13 馬城投 MTN001	100,000	10,632,000.00	0.15
40	088005	08 國網債 02	100,000	10,412,000.00	0.14

7.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資詳情

金額單位：人民幣元

序號	證券代碼	證券名稱	數量（份）	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
1	123501	13 隧道 02	100,000	3,506,000.00	0.05

7.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資詳情

本基金本報告期末未持有貴金屬。

## 7.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資詳情

本基金本報告期末未持有權證。

## 7.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

### 7.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉及損益詳情

本基金本報告期末無股指期貨投資。

### 7.10.2 本基金投資股指期貨的投資政策

本基金本報告期末無股指期貨投資。

## 7.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

### 7.11.1 本期國債期貨投資政策

本基金本報告期末無國債期貨投資。

### 7.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉及損益詳情

本基金本報告期末無國債期貨投資。

### 7.11.3 本期國債期貨投資評價

本基金本報告期末無國債期貨投資。

## 7.12 投資組合報告附注

7.12.1 報告期內，本基金投資決策程序符合相關法律法規的要求，未發現本基金投資的前十名證券的發行主體本期出現被監管部門立案調查，或在報告編制日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

7.12.2 基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

7.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
----	----	----

1	存出保證金	1,931,934.51
2	應收證券清算款	103,883,433.05
3	應收股利	-
4	應收利息	44,992,692.12
5	應收申購款	496,118.68
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	151,304,178.36

#### 7.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券詳情

本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。

#### 7.12.6 投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入的原因，分項之及與合計項之間可能存在尾數差異。

## §8 基金份額持有人資訊

### 8.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

持有人戶數（戶）	戶均持有的基金份額	持有人結構			
		機構投資者		個人投資者	
		持有份額	佔總份額比例	持有份額	佔總份額比例
287,178	21,733.21	35,958,805.42	0.58%	6,205,342,386.52	99.42%

### 8.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	持有份額總數（份）	佔基金總份額比例
基金管理人所有從業人員持有本基金	3,126,823.95	0.05%

### 8.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

項目	持有基金份額總量的數量區間（萬份）

本公司高級管理人員、基金投資及研究部門負責人持有本開放式基金	>100
本基金基金經理持有本開放式基金	>100

## §9 開放式基金份額變動

單位：份

基金合同生效日（2003年9月5日）基金份額總額	3,796,885,823.40
本報告期期初基金份額總額	6,191,477,535.36
本報告期基金總申購份額	427,800,176.05
減：本報告期基金總贖回份額	377,976,519.47
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	6,241,301,191.94

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份額持有人大會決議

本報告期內，本基金未召開基金份額持有人大會。

### 10.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

根據本基金管理人發佈的相關公告，孫毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任華夏基金管理有限公司副總經理，自 2016 年 6 月 30 日起不再擔任華夏基金管理有限公司副總經理。

本報告期內，本基金託管人的專門基金託管部門未發生重大人事變動。

### 10.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期無涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

### 10.4 基金投資策略的改變

本基金本報告期投資策略未發生改變。

### 10.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本報告期內本基金所聘用的會計師事務所未發生改變。

### 10.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人、基金託管人涉及託管業務的部門及其高級管理人員在本報告期內未受到任何處分。

### 10.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

#### 10.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及佣金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的佣金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	佣金	佔當期佣金總量的比例	
中信證券	3	2,417,993,735.88	26.31%	1,776,160.41	23.26%	-
中國銀河證券	1	1,571,607,656.10	17.10%	1,463,639.97	19.17%	-
中金公司	1	900,852,814.54	9.80%	838,964.13	10.99%	-
川財證券	1	810,626,056.05	8.82%	592,809.54	7.76%	-
西南證券	2	809,190,326.75	8.81%	591,760.64	7.75%	-
長江證券	1	715,701,748.38	7.79%	666,533.38	8.73%	-
廣發證券	1	712,139,882.51	7.75%	663,213.03	8.69%	-
國泰君安證券	2	634,563,723.81	6.91%	590,969.76	7.74%	-
國都證券	1	588,785,705.05	6.41%	430,578.75	5.64%	-
瑞銀證券	1	27,221,470.30	0.30%	19,907.11	0.26%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

i 經營行為規範，在近一年內無重大違規行為。

ii 公司財務狀況良好。

iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

iv 有較強的研究能力，能及時、全面、定期提供品質較高的宏觀、行業、公司及證券市場研究報告，並能根據基金投資的特殊要求，提供專門的研究報告。

v 建立了廣泛的資訊網路，能及時提供準確的信息資訊及服務。

② 券商專用交易單元選擇程序：

i 對交易單元候選券商的研究服務進行評估

本基金管理人組織相關人員依據交易單元選擇標準對交易單元候選券商的服務品質及

研究實力進行評估，確定選用交易單元的券商。

ii 協議簽署及通知託管人

本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議，並通知基金託管人。

③除本表列示外，本基金還選擇了安信證券、東方證券、海通證券、民族證券、南京證券、申萬宏源證券、信達證券、興業證券的交易單元作為本基金交易單元，本報告期無股票交易及應付佣金。

④本報告期內，本基金租用的券商交易單元未發生變更。

10.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		回購交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期回購成交總額的比例
川財證券	-	-	100,000,000.00	25.00%
廣發證券	-	-	300,000,000.00	75.00%

10.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷當日旗下基金申購、贖回等業務安排的提示性公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-04
2	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-04
3	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷當日旗下基金申購、贖回等業務安排的提示性公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-07
4	華夏基金管理有限公司關於公司董事、監事、高級管理人員及其他從業人員在子公司兼職等情況的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-13
5	華夏基金管理有限公司關於調整中國建設銀行儲蓄卡基金電子交易優惠費率的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-21
6	華夏基金管理有限公司關於設立上海華夏財富投資管理有限公司的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-01-30
7	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增聯訊證券股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-02-18

8	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增江蘇江南農村商業銀行股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-03
9	華夏基金管理有限公司關於公司董事、監事、高級管理人員及其他從業人員在子公司兼職等情況的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-04
10	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增上海華夏財富投資管理有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-04
11	關於華夏基金管理有限公司旗下部分開放式基金在大同證券有限責任公司開通定期定額申購業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-03-08
12	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-04-15
13	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增深圳眾祿金融控股股份有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-10
14	關於停止支付寶基金專戶電子交易開戶及認購、申購、定期定額申購等業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-13
15	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增上海中正達廣投資管理有限公司、北京匯成基金銷售有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-24
16	關於華夏回報證券投資基金等基金基金經理的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-25
17	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金在上海天天基金銷售有限公司調整申購、贖回數額限制的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-05-26

## §11 備查文件目錄

### 11.1 備查文件目錄

11.1.1 中國證監會核准基金募集的文件；

11.1.2 《華夏回報證券投資基金基金合同》；

11.1.3 《華夏回報證券投資基金託管協議》；

11.1.4 法律意見書；

11.1.5 基金管理人業務資格批件、營業執照；

11.1.6 基金託管人業務資格批件、營業執照。

## 11.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人及/或基金託管人的住所。

## 11.3 查閱方式

投資者可到基金管理人及/或基金託管人的住所免費查閱備查文件。在支付複印費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

華夏基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日

## §12 補充披露

## 補充披露 1：期末基金資產組合情況

名稱	數量(股)	公允價值(人民幣元)
<b>(1)股票投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
中工國際	15,897,738	312,708,506.46
網宿科技	3,251,441	218,496,835.20
恒瑞醫藥	5,098,841	204,514,512.51
隆基股份	13,446,975	175,483,023.75
華東醫藥	2,205,109	148,624,346.60
招商銀行	8,100,000	141,750,000.00
老鳳祥	2,923,514	119,425,546.90
東阿阿膠	1,501,147	79,305,596.01
神霧環保	3,465,043	71,310,584.94
首開股份	6,397,675	71,142,146.00
白雲機場	5,294,930	64,915,841.80
燕京啤酒	7,846,460	59,554,631.40
上海醫藥	3,281,627	59,233,367.35
海信電器	2,861,348	50,588,632.64
豪邁科技	2,354,587	50,317,524.19
聯建光電	1,810,020	47,024,319.60
美克家居	3,582,456	46,607,752.56
長江電力	3,619,100	45,202,559.00
宜通世紀	1,167,708	44,594,768.52
康強電子	2,073,202	42,417,712.92
歐菲光	1,394,717	41,144,151.50
長榮股份	2,164,276	40,147,319.80
華訊方舟	1,980,000	39,204,000.00
新洋豐	3,048,508	38,136,835.08
老闆電器	1,020,949	37,540,294.73
春秋航空	747,215	35,821,487.10
京投發展	3,725,400	34,422,696.00
重慶啤酒	2,199,952	33,417,270.88
奧馬電器	539,300	32,827,191.00
洲明科技	2,044,341	32,402,804.85
中國平安	1,000,000	32,040,000.00
威孚高科	1,462,100	29,475,936.00
隆鑫通用	1,449,912	29,317,220.64
金融街	3,003,393	29,192,979.96

青島啤酒	999,882	29,066,569.74
天海防務	868,318	28,914,989.40
青島金王	1,082,100	28,902,891.00
海瀾之家	2,555,789	28,880,415.70
交通銀行	5,000,936	28,155,269.68
金螳螂	2,699,987	27,053,869.74
安琪酵母	1,499,210	26,745,906.40
中國建築	5,000,000	26,600,000.00
上工申貝	1,935,400	26,534,334.00
上海貝嶺	1,524,988	26,489,041.56
華泰證券	1,400,000	26,488,000.00
濟川藥業	1,028,300	26,468,442.00
聚龍股份	1,049,990	25,420,257.90
興業銀行	1,600,000	24,384,000.00
兔寶寶	2,200,000	22,066,000.00
利亞德	687,629	21,770,334.14
隆華節能	1,900,000	21,242,000.00
南方航空	3,000,000	21,180,000.00
艾派克	722,725	20,619,344.25
中青旅	984,400	19,018,608.00
史丹利	1,500,000	18,525,000.00
海德股份	574,528	18,183,811.20
黑牛食品	983,066	18,049,091.76
浪莎股份	600,000	17,574,000.00
海螺水泥	1,200,000	17,448,000.00
索菲亞	309,084	17,314,885.68
嘉寶集團	1,222,450	16,808,687.50
華海藥業	670,388	16,303,836.16
寧波銀行	1,099,960	16,257,408.80
中鋼國際	1,254,253	15,778,502.74
長青集團	707,400	14,643,180.00
蘭花科創	2,000,000	14,360,000.00
海源機械	680,000	13,933,200.00
蘇泊爾	401,054	13,816,310.30
雙鷺藥業	444,400	13,411,992.00
冀東水泥	1,245,600	13,203,360.00
康得新	758,862	12,976,540.20
康力電梯	807,600	12,437,040.00
建設銀行	2,599,966	12,349,838.50
宏發股份	392,000	12,038,320.00
廣晟有色	200,000	11,452,000.00
北京銀行	1,000,000	10,370,000.00
萬豐奧威	600,000	10,314,000.00

山東章鼓	861,600	10,253,040.00
鼎龍股份	400,000	10,008,000.00
萬向德農	599,901	9,718,396.20
中安消	450,000	9,675,000.00
精藝股份	600,000	9,420,000.00
首航節能	1,167,969	9,215,275.41
大亞科技	567,098	8,761,664.10
保利地產	983,441	8,487,095.83
迪森股份	500,000	8,305,000.00
西山煤電	1,000,000	8,150,000.00
北京城建	600,000	7,494,000.00
華英農業	729,671	6,873,500.82
永貴電器	200,000	6,786,000.00
生物股份	245,600	6,712,248.00
奧瑞金	720,000	6,357,600.00
伊力特	421,585	6,340,638.40
新文化	237,400	5,930,252.00
中國國旅	130,900	5,756,982.00
華宇軟件	300,000	5,676,000.00
金杯電工	417,300	5,604,339.00
航新科技	82,000	5,553,040.00
眾生藥業	461,100	5,528,589.00
通達動力	292,300	5,504,009.00
新南洋	193,700	5,435,222.00
金正大	671,200	5,403,160.00
飛利信	400,000	5,360,000.00
匯通能源	275,000	5,304,750.00
同仁堂	173,700	5,174,523.00
華策影視	324,960	5,059,627.20
國統股份	200,023	4,768,548.32
美的集團	200,000	4,744,000.00
京威股份	313,213	4,732,648.43
招商蛇口	319,600	4,554,300.00
金隅股份	585,200	4,535,300.00
三毛派神	200,000	4,490,000.00
巨星科技	200,000	4,064,000.00
萬達院線	50,000	3,995,000.00
興民鋼圈	200,000	3,870,000.00
奧拓電子	261,994	3,785,813.30
陽泉煤業	592,000	3,771,040.00
省廣股份	260,000	3,673,800.00
松芝股份	200,000	3,636,000.00
峨眉山 A	293,200	3,530,128.00

新城控股	299,960	2,777,629.60
南洋科技	200,000	2,590,000.00
盛通股份	66,200	2,371,284.00
天成自控	50,000	2,086,500.00
金城股份	100,000	1,800,000.00
晨光文具	100,000	1,770,000.00
新華醫療	69,547	1,605,840.23
廣聯達	100,000	1,430,000.00
富春環保	100,000	1,123,000.00
大湖股份	100,000	1,113,000.00
東方雨虹	61,700	1,063,091.00
中國核建	37,059	775,274.28
章源鎢業	57,001	595,660.45
第一創業	9,763	394,522.83
澳洋科技	30,609	328,434.57
新安股份	43,200	314,928.00
久之洋	1,473	258,025.41
小康股份	8,662	206,761.94
玲瓏輪胎	15,341	199,126.18
廣東鴻圖	6,630	143,340.60
雪榕生物	1,407	93,748.41
中亞股份	922	92,126.24
上海滬工	1,263	76,664.10
四方冷鏈	1,368	74,446.56
三德科技	1,354	63,461.98
盛訊達	1,306	61,186.10
威龍股份	1,376	57,736.96
百利科技	1,382	57,283.90
匯嘉時代	1,746	52,065.72
永和智控	710	48,336.80
環球印務	1,080	47,131.20
金冠電氣	668	45,130.08
天鵝股份	793	35,391.59
哈森股份	2,372	34,394.00
景嘉微	222	33,493.14
多倫科技	280	27,437.20
通宇通訊	444	26,551.20
洪匯新材	1,629	24,565.32
維宏股份	92	23,414.00
合誠股份	1,095	20,126.10
昊志機電	168	14,232.96
新宏泰	1,602	13,600.98
通合科技	100	10,368.00

川金諾	170	10,278.20
建藝集團	135	9,676.80
科大國創	926	9,306.30
康普頓	143	9,136.27
賽福天	298	8,764.18
名家匯	164	8,664.12
東音股份	127	8,256.27
朗迪集團	123	6,217.65
豐元股份	971	5,631.80
用友網路	89	1,742.62
國電南瑞	65	869.05
大智慧	87	799.53
航天機電	69	779.70
奧康國際	35	744.10
光環新網	16	606.40
亞威股份	32	472.00
恒信移動	13	221.00
日發精機	9	132.84
<b>合計</b>		<b>3,667,917,814.71</b>
<b>(2)債券投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
16 農發 08	2,200,000	221,298,000.00
15 國開 05	2,000,000	207,020,000.00
16 農發 14	2,000,000	200,040,000.00
16 進出 04	2,000,000	199,840,000.00
11 國開 16	1,600,000	163,904,000.00
15 農發 16	1,300,000	130,000,000.00
14 國開 28	1,000,000	104,740,000.00
12 農發 01	1,000,000	102,610,000.00
12 農發 12	1,000,000	102,510,000.00
15 國開 01	1,000,000	101,610,000.00
16 國開 07	1,000,000	99,690,000.00
11 進出 16	800,000	80,248,000.00
16 中核建 SCP001	800,000	80,192,000.00
13 國開 28	800,000	80,048,000.00
16 國開 04	700,000	69,916,000.00
11 付息國債 24	600,000	62,520,000.00
15 進出 04	500,000	51,885,000.00
15 國開 20	500,000	50,740,000.00
11 中化工 MTN2	500,000	50,535,000.00
10 國開 15	450,000	45,252,000.00

14 國開 22	400,000	44,704,000.00
12 石化 01	439,470	44,584,231.50
15 農發 04	400,000	41,464,000.00
14 國開 29	300,000	31,848,000.00
13 國網 MTN1	300,000	30,897,000.00
13 航機電 MTN1	300,000	30,855,000.00
12 進出 03	300,000	30,816,000.00
14 國開 01	300,000	30,486,000.00
11 首鋼 MTN1	300,000	30,366,000.00
13 國開 12	300,000	30,066,000.00
08 國開 16	250,000	26,112,500.00
13 渝保稅 MTN1	200,000	20,812,000.00
12 滇建工 MTN1	200,000	20,782,000.00
13 鎮國投 MTN2	200,000	20,640,000.00
11 首鋼 MTN2	200,000	20,230,000.00
11 進出 18	200,000	20,106,000.00
16 津城建 SCP001	200,000	20,006,000.00
12 蕪湖建投債 01	150,000	16,602,000.00
13 馬城投 MTN001	100,000	10,632,000.00
08 國網債 02	100,000	10,412,000.00
<b>合計</b>		<b>2,737,018,731.50</b>
<b>(3)資產支持證券投資</b>		
<b>上市投資</b>		
<b>中國(100%)</b>		
13 隧道 02	100,000	3,506,000.00
<b>合計</b>		<b>3,506,000.00</b>
<b>(4)買入返售金融資產</b>		
銀行間同業市場買入返售金融資產		49,500,194.25
交易所市場買入返售金融資產		-
<b>合計</b>		<b>49,500,194.25</b>
<b>總投資資產</b>		<b>6,457,942,740.46</b>
<b>銀行存款和結算備付金</b>		<b>691,610,919.27</b>
<b>其他各項資產</b>		<b>151,304,178.36</b>
<b>合計</b>		<b>7,300,857,838.09</b>

## 補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的比	佔基金資產淨值的比
		例 (%)	例 (%)
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
1	股票	50.56	42.91
2	債券	37.73	49.01
3	資產支持證券	0.05	0.07
4	買入返售金融資產	0.68	2.62