

華夏回報證券投資基金

2015 年年度報告

2015 年 12 月 31 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：二〇一六年三月二十九日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2015 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 2015 年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇一六年三月二十九日

§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、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本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 3 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和運用基金資產，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。

本報告中的財務資料經審計，安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）為本基金出具了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	3
§2 基金簡介.....	5
§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況.....	6
3.1 主要會計資料和財務指標.....	6
3.2 基金淨值表現.....	6
3.3 過去三年基金的利潤分配情況.....	8
§4 管理人報告.....	8
§5 託管人報告.....	13
§6 審計報告.....	14
§7 年度財務報表.....	15
7.1 資產負債表.....	15
7.2 利潤表.....	16
7.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	17
7.4 報表附注.....	18
§8 投資組合報告.....	40
8.1 期末基金資產組合情況.....	40
8.2 期末按行業分類的股票投資組合.....	41
8.3 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.....	41
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	45
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	47
8.6 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.....	47
8.7 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.....	48
8.8 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.....	48
8.9 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.....	49
8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明.....	49
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	49
8.12 投資組合報告附注.....	49
§9 基金份額持有人資訊.....	50
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	50
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	50
9.3 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.....	50
§10 開放式基金份額變動.....	50
§11 重大事件揭示.....	51
§12 備查文件目錄.....	55
§13 補充披露.....	57

§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	6,191,477,535.36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，合理配置股票和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和債券品種進行投資，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和風險高於債券基金，低於股票基金。

2.3 基金管理人和基金託管人

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
資訊披露 負責人	姓名	張靜
	聯繫電話	400-818-6666
	電子郵箱	service@ChinaAMC.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 12 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》
登載基金年度報告正文的管理人互聯網網址	www.ChinaAMC.com
基金年度報告備置地點	基金管理人和基金託管人的住所

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
會計師事務所	安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）	北京市東長安街 1 號東方廣場東方經貿城安永大樓 16 層
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 12 層

§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況

3.1 主要會計資料和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料和指標	2015 年	2014 年	2013 年
本期已實現收益	2,205,592,745.92	1,734,219,560.47	1,552,584,424.08
本期利潤	2,025,942,355.08	637,083,993.13	2,332,124,635.31
加權平均基金份額本期利潤	0.3112	0.0790	0.2880
本期加權平均淨值利潤率	23.78%	5.96%	20.25%
本期基金份額淨值增長率	22.20%	7.10%	23.90%
3.1.2 期末資料和指標	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利潤	83,429,821.15	178,214,741.44	311,768,617.95
期末可供分配基金份額利潤	0.0135	0.0252	0.0360
期末基金資產淨值	7,605,525,422.28	9,131,442,606.54	12,461,987,125.51
期末基金份額淨值	1.228	1.293	1.438
3.1.3 累計期末指標	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份額累計淨值增長率	804.69%	640.31%	591.21%

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
過去三個月	5.18%	0.52%	0.39%	0.00%	4.79%	0.52%
過去六個月	-3.76%	0.95%	0.87%	0.00%	-4.63%	0.95%
過去一年	22.20%	1.07%	2.12%	0.00%	20.08%	1.07%
過去三年	62.16%	0.93%	8.09%	0.00%	54.07%	0.93%
過去五年	53.82%	0.85%	14.61%	0.00%	39.21%	0.85%
自基金合同生效起至今	804.69%	1.03%	34.68%	0.00%	770.01%	1.03%

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

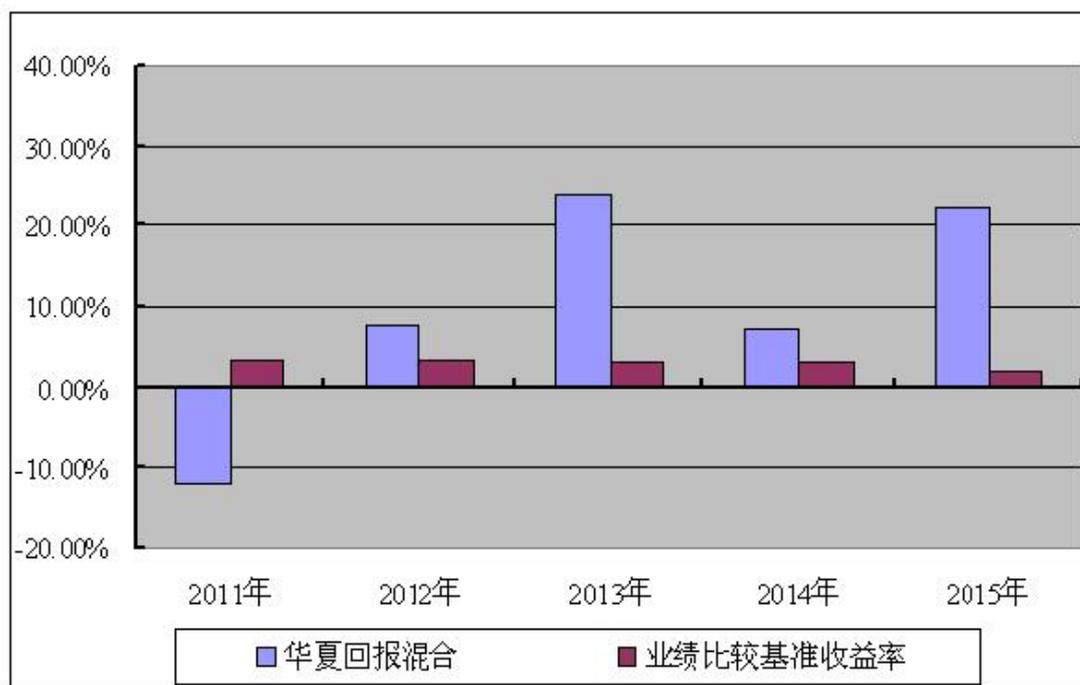
(2003年9月5日至2015年12月31日)



3.2.3 過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

華夏回報證券投資基金

過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的對比圖



3.3 過去三年基金的利潤分配情況

單位：人民幣元

年度	每10份基金份額分紅數	現金形式發放總額	再投資形式發放總額	年度利潤分配合計	備註
2015年	3.450	786,603,349.89	1,483,393,808.28	2,269,997,158.17	-
2014年	2.350	704,951,233.93	1,118,464,541.81	1,823,415,775.74	-
2013年	1.500	482,148,484.74	722,412,447.57	1,204,560,932.31	-
合計	7.300	1,973,703,068.56	3,324,270,797.66	5,297,973,866.22	-

§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、廣州和青島設有分公司，在香港、深圳及上海設有子公司。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。

2015 年，在《中國證券報》主辦的“第十二屆中國基金業金牛獎”評選中，華夏永福養老理財混合榮獲“2014 年度開放式混合型金牛基金”；在《上海證券報》主辦的第十二屆中國“金基金”獎的評選中，華夏永福養老理財混合、華夏滬深 300ETF 獲得“金基金”產品獎；在《證券時報》主辦的“2014 年度中國基金業明星基金獎”評選中，華夏策略混合獲得“五年持續回報積極混合型明星基金獎”。

2015 年，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶的使用便利性和服務體驗：（1）全面改版客服熱線自助語音服務，新增快速查帳、手機綁定等多項功能，為客戶提供更便捷的自助查詢方式；（2）提前網上查詢和自助語音資料更新時間，讓客戶能更及時地瞭解交易資訊；（3）與蘇寧易購、蘇寧金融、網易理財等互聯網平台合作，為客戶購買旗下基金提供更多優惠便捷的交易通道，同時也滿足了網上交易客戶基金交易以外的消費需求。

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	-	9 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	-	11 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	-	5 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	-	8 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。

王海雄	本基金的基金經理、董事總經理	2014-01-02	2015-01-20	22 年	經濟學碩士。曾任海南省國際信託投資公司證券總部總經理助理、證券營業部總經理，金元證券證券營業部總經理、投資管理總部總經理、公司副總裁等。2010 年 12 月加入華夏基金管理有限公司，曾任華夏基金（香港）有限公司副行政總裁等。
李冬卉	本基金的基金經理、股票投資部高級副總裁	2014-05-23	2015-06-26	9 年	英國蘭卡斯特大學金融學碩士。曾任中國國際金融有限公司投資銀行部項目經理、資產管理部研究員等。2010 年 11 月加入華夏基金管理有限公司，曾任研究員、投資經理等。

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》、基金合同和其他有關法律法規，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理和運用基金資產，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》等法規制定了《華夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通過科學、制衡的投資決策體系，加強交易分配環節的內部控制，並通過工作制度、流程和技術手段保證公平交易原則的實現。同時，通過監察稽核、事後分析和資訊披露來保證公平交易過程和結果的監督。

4.3.2 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和組合，制定並嚴格遵守相

應的制度和流程，通過系統和人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本基金管理人嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》和《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

本基金管理人通過統計檢驗的方法對管理的不同投資組合，在不同時間窗下（1日內、3日內、5日內）的本年度同向交易價差進行了專項分析，未發現違反公平交易原則的異常情況。

4.3.3 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和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2015 年，美國經濟繼續緩慢復蘇，歐洲、日本等發達經濟體復蘇態勢呈現較大的不確定性，而以中國為代表的新興經濟體則繼續緩慢回落。美聯儲在 12 月宣佈加息，歐洲、日本則計畫進一步增加量寬，而俄羅斯、巴西等新興經濟體的貨幣壓力陡然增大。經過艱辛的努力，人民幣加入了 SDR，但是面對經濟增長的巨大壓力以及世界金融體系的不確定性，人民幣匯率的未來走勢仍不明確。

2015 年是 A 股市場大幅波動的一年。上半年，貨幣政策明顯趨向寬鬆，無風險利率明顯下降，實體經濟投資機會低迷，資金湧向股市，投資者在極度樂觀情緒的驅動下盲目增加杠杆進一步為市場推波助瀾。指數在 6 月初創出年內高點，但泡沫的破裂也是災難性的，6 月中旬市場開始猛烈調整。4 季度，在管理層的持續大力維穩下，市場情緒逐漸修復，指數企穩，但增量資金匱乏，超跌反彈特徵明顯。全年，上證綜指漲幅明顯落後於創業板綜指漲幅，這種結構性差異既體現了國內宏觀經濟發展階段不可避免的更替，也反映了投資者結構、投資理念的深刻變化。

報告期內，本基金整體操作穩健，重點投資於價值和成長兩類投資標的中中期成長性與估值匹配的個股。本基金在股災中保持了較低的倉位，回撤較低，但在 4 季度的快速反彈中，由於倉位偏低，沒能獲得更高的收益。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.228 元，本報告期份額淨值增長率為 22.20%，同期業績比較基準增長率為 2.12%。

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 2016 年，A 股市場面臨的環境將更加錯綜複雜，不確定因素極多。國內經濟雖然接近見底，但能否破繭重生，將顯著考驗改革的決心和力度；國際政治經濟因素交織，帶來匯率、商品價格的波動等都將給國內政策制定、市場流動性環境和投資者的風險偏好帶來實質性影響。綜上，放低回報預期，在更加嚴格的風險控制下追求更確定的回報將在 2016 年變得非常實際和重要。

珍惜基金份額持有人的每一分投資和每一份信任，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 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

本報告期內，基金管理人持續加強合規管理、風險控制和監察稽核工作。在合規管理方面，公司制定了員工行為規範、員工行為準則，修訂了員工投資行為管理制度，進一步完善合規制度建設；公司開展多種形式的合規培訓，定期進行合規考試，不斷提升員工的合規守法意識；加強事前事中合規風險管理，嚴格審核資訊披露文件、基金宣傳推介材料，防範各類合規風險。在風險管理方面，公司秉承全員風險管理的理念，採取事前防範、事中控制和事後監督等三階段工作，加強對日常投資運作的管理和監控，督促投研交易業務的合規開展；在監察稽核方面，公司定期和不定期開展多項內部稽核，對投資研究、基金交易、市場銷售，後台運作等關鍵業務和崗位進行檢查監督，促進公司業務合規運作、穩健經營。

報告期內，本基金管理人所管理的基金整體運作合法合規。本基金管理人將繼續以風險控制為核心，堅持基金份額持有人利益優先的原則，提高監察稽核工作的科學性和有效性，切實保障基金安全、合規運作。

4.7 管理人對報告期內基金估值程式等事項的說明

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和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出具報告。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和執行的專門機構，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、法律監察工作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。

4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

根據《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及本基金的基金合同等規定，本基金本報告期實施利潤分配 15 次，符合相關法規及基金合同的規定。

4.9 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、基金合同和託管協定的有關規定，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、基金合同和託管協議的規定，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 託管人對本年度報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見

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、準確和完整。

§6 審計報告

安永華明(2016)審字第 60739337_B04 號

華夏回報證券投資基金全體基金份額持有人:

我們審計了後附的華夏回報證券投資基金財務報表,包括 2015 年 12 月 31 日的資產負債表和 2015 年度的利潤表和所有者權益(基金淨值)變動表以及財務報表附注。

6.1 管理層對財務報表的責任

編制和公允列報財務報表是基金管理人華夏基金管理有限公司的責任。這種責任包括:(1)按照企業會計準則的規定編制財務報表,並使其實現公允反映;(2)設計、執行和維護必要的內部控制,以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤而導致的重大錯報。

6.2 註冊會計師的責任

我們的責任是在執行審計工作的基礎上對財務報表發表審計意見。我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。中國註冊會計師審計準則要求我們遵守中國註冊會計師職業道德守則,計畫和執行審計工作以對財務報表是否存在重大錯報獲取合理保證。

審計工作涉及實施審計程式,以獲取有關財務報表金額和披露的審計證據。選擇的審計程式取決於註冊會計師的判斷,包括對由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險的評估。在進行風險評估時,註冊會計師考慮與財務報表編制和公允列報相關的內部控制,以設計恰當的審計程式,但目的並非對內部控制的有效性發表意見。審計工作還包括評價基金管理人選用會計政策的恰當性和作出會計估計的合理性,以及評價財務報表的總體列報。

我們相信,我們獲取的審計證據是充分、適當的,為發表審計意見提供了基礎。

6.3 審計意見

我們認為,上述財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編制,公允反映了華夏回報證券投資基金 2015 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2015 年度的

經營成果和淨值變動情況。

安永華明會計師事務所（特殊普通合夥） 註冊會計師 湯駿 濮曉達

北京市東長安街 1 號東方廣場東方經貿城安永大樓 16 層

2016 年 3 月 7 日

§7 年度財務報表

7.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2015 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	7.4.7.1	438,027,605.72	501,676,355.67
結算備付金		12,062,079.52	19,304,465.63
存出保證金		2,955,841.07	1,422,966.41
交易性金融資產	7.4.7.2	6,996,543,009.19	8,198,939,289.40
其中：股票投資		3,263,829,928.19	5,542,177,210.70
基金投資		-	-
債券投資		3,727,518,081.00	2,648,322,078.70
資產支持證券投資		5,195,000.00	8,440,000.00
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產	7.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	7.4.7.4	199,000,169.50	396,000,834.00
應收證券結算款		79,345,864.85	59,802,357.57
應收利息	7.4.7.5	70,957,661.53	44,536,403.99
應收股利		-	-
應收申購款		10,138,695.00	4,687,483.08
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.6	-	-
資產總計		7,809,030,926.38	9,226,370,155.75
負債和所有者權益	附注號	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
負債：			

短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	7.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券結算款		150,879,430.03	-
應付贖回款		9,941,723.72	42,886,612.00
應付管理人報酬		9,578,577.04	11,875,042.61
應付託管費		1,596,429.50	1,979,173.77
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	7.4.7.7	30,303,377.32	37,096,500.64
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	7.4.7.8	1,127,468.33	1,011,722.03
負債合計		203,505,504.10	94,927,549.21
所有者權益：			
實收基金	7.4.7.9	6,191,477,535.36	7,064,090,326.45
未分配利潤	7.4.7.10	1,414,047,886.92	2,067,352,280.09
所有者權益合計		7,605,525,422.28	9,131,442,606.54
負債和所有者權益總計		7,809,030,926.38	9,226,370,155.75

注：報告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.228 元，基金份額總額 6,191,477,535.36 份。

7.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		2,219,139,644.16	874,857,143.06
1.利息收入		156,910,213.13	153,248,062.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,109,474.91	7,101,156.25
債券利息收入		145,561,656.77	141,283,490.86
資產支持證券利息收入		373,743.60	598,109.59

買入返售金融資產收入		3,865,337.85	4,265,305.64
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		2,234,791,861.16	1,812,779,600.57
其中：股票投資收益	7.4.7.12	2,163,129,205.40	1,743,720,692.32
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.13	19,418,338.91	1,358,529.20
資產支持證券投資收益	7.4.7.14	-	-209,500.00
貴金屬投資收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	52,244,316.85	67,909,879.05
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.18	-179,650,390.84	-1,097,135,567.34
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	7.4.7.19	7,087,960.71	5,965,047.49
減：二、費用		193,197,289.08	237,773,149.93
1.管理人報酬		127,815,286.52	160,780,920.08
2.託管費		21,302,547.65	26,796,819.93
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	7.4.7.20	43,482,449.63	48,447,573.50
5.利息支出		161,185.91	1,306,857.15
其中：賣出回購金融資產支出		161,185.91	1,306,857.15
6.其他費用	7.4.7.21	435,819.37	440,979.27
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		2,025,942,355.08	637,083,993.13
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		2,025,942,355.08	637,083,993.13

7.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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（本期利潤）	-	2,025,942,355.08	2,025,942,355.08

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）	-872,612,791.09	-409,249,590.08	-1,281,862,381.17
其中：1.基金申購款	3,266,451,975.14	1,121,814,397.51	4,388,266,372.65
2.基金贖回款	-4,139,064,766.23	-1,531,063,987.59	-5,670,128,753.82
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）	-	-2,269,997,158.17	-2,269,997,158.17
五、期末所有者權益（基金淨值）	6,191,477,535.36	1,414,047,886.92	7,605,525,422.28
項目	上年度可比期間 2014年1月1日至2014年12月31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）	8,664,732,709.35	3,797,254,416.16	12,461,987,125.51
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數（本期利潤）	-	637,083,993.13	637,083,993.13
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）	-1,600,642,382.90	-543,570,353.46	-2,144,212,736.36
其中：1.基金申購款	1,969,815,169.95	657,833,598.54	2,627,648,768.49
2.基金贖回款	-3,570,457,552.85	-1,201,403,952.00	-4,771,861,504.85
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）	-	-1,823,415,775.74	-1,823,415,775.74
五、期末所有者權益（基金淨值）	7,064,090,326.45	2,067,352,280.09	9,131,442,606.54

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4 財務報表由下列負責人簽署：

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

7.4 報表附注

7.4.1 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）等有關規定和《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。

7.4.2 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 日及其後頒佈和修訂的《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《證券投資基金資訊披露 XBRL 範本第 3 號<年度報告和半年度報告>》和中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 7.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編制。

7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2015 年度的經營成果和基金淨值變動情況等有關資訊。

7.4.4 重要會計政策和會計估計

7.4.4.1 會計年度

本基金會計年度為公曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 記帳基礎幣

本基金的記帳基礎幣為人民幣。

7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類

1、金融資產的分類

金融資產於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、應收款項、可供出售金融資產及持有至到期投資。金融資產的分類取決於本基金對金融資產的持有意圖和持有能力。本基金目前暫無金融資產分類為可供出售金融資產及持有至到期投資。

本基金目前持有的股票投資、債券投資、資產支持證券投資和衍生工具分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。除衍生工具所產生的金融資產在資產負債表中以衍生金融資產列示外，以公允價值計量且其公允價值變動計入損益的金融資產在資產負債表中以交易性金融資產列示。

本基金持有的其他金融資產分類為應收款項，包括銀行存款、買入返售金融資產和各類應收款項等。應收款項是指在活躍市場中沒有報價、回收金額固定或可確定的非衍生金融資產。

2、金融負債的分類

金融負債於初始確認時分類為：以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債及其他金融負債。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債包括交易性金融負債及衍生金融負債等。本基金持有的其他金融負債包括賣出回購金融資產款和各類應付款項等。

7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

金融資產或金融負債於本基金成為金融工具合同的一方時，於交易日按公允價值在資產負債表內確認。以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，取得時發生的相關交易費用計入當期損益；支付的代價款額中包含已宣告但尚未發放的現金股利、債券或資產支持證券起息日或上次除息日至購買日止的利息，單獨確認為應收項目。應收款項和其他金融負債的相關交易費用計入初始確認金

額。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產及金融負債按照公允價值進行後續計量，應收款項和其他金融負債採用實際利率法，以攤余成本進行後續計量。

當收取某項金融資產現金流量的合同權利已終止或該金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬已轉移時，終止確認該金融資產。終止確認的金融資產的成本按移動加權平均法於交易日結轉。

7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則

本基金持有的股票投資、債券投資、資產支持證券投資和衍生工具按如下原則確定公允價值並進行估值：

1、存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易，但最近交易日後經濟環境未發生重大變化且證券發行機構未發生影響證券價格的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。

2、存在活躍市場的金融工具，如估值日無交易且最近交易日後經濟環境發生了重大變化或證券發行機構發生了影響證券價格的重大事件，參考類似投資品種的現行市價及重大變化等因素，調整最近交易市價以確定公允價值。

3、當金融工具不存在活躍市場，採用市場參與者普遍認同且被以往市場實際交易價格驗證具有可靠性的估值技術確定公允價值。估值技術包括參考熟悉情況並自願交易的各方最近進行的市場交易中使用的價格、參照實質上相同的其他金融工具的當前公允價值、現金流量折現法和期權定價模型等。採用估值技術時，盡可能最大程度使用市場參數，減少使用與本基金特定相關的參數。

7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金依法有權抵銷債權債務且交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

7.4.4.7 實收基金

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平准金分攤部分後的餘額。對於曾經實施份額分拆或折算的基金，由於基金份額分拆或折算引起的實收基金份額變動於基金份額分拆日或基金份額折算日根據分拆前或折算前的基

金份額數及確定的分拆或折算比例計算認列。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。對於已開放轉換業務的基金，上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

7.4.4.8 損益平准金

損益平准金包括已實現平准金和未實現平准金。已實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益佔基金淨值比例計算的金額。未實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益佔基金淨值比例計算的金額。損益平准金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤。

7.4.4.9 收入/（損失）的確認和計量

股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益。債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在適用情況下由債券發行企業代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為利息收入。資產支援證券在持有期間收到的款項，根據資產支援證券的預計收益率區分屬於資產支援證券投資本金部分和投資收益部分，將本金部分沖減資產支援證券投資成本，並將投資收益部分確認為利息收入。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；處置時其公允價值與初始確認金額之間的差額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.10 費用的確認和計量

本基金的管理人報酬和託管費在費用涵蓋期間按基金合同約定的費率和計算方法逐日確認。

其他金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，但基金份額持

有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅權益再投資日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資。期末可供分配利潤指期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從所有者權益轉出。

7.4.4.12 其他重要的會計政策和會計估計

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：

1、對於特殊事項停牌股票，根據中國證監會公告[2008]38 號《關於進一步規範證券投資基金估值業務的指導意見》，本基金參考《中國證券業協會基金估值工作小組關於停牌股票估值的參考方法》對重大影響基金資產淨值的特殊事項停牌股票進行估值。

2、對於在鎖定期內的非公開發行股票，根據中國證監會證監會計字[2007]21 號《關於證券投資基金執行〈企業會計準則〉估值業務及份額淨值計價有關事項的通知》之附件《非公開發行有明確鎖定期股票的公允價值的確定方法》，若在證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價低於非公開發行股票的初始投資成本，按估值日證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價估值；若在證券交易所掛牌的同一股票的市場交易收盤價高於非公開發行股票的初始投資成本，按鎖定期內已經過交易天數佔鎖定期內總交易天數的比例將兩者之間差價的一部分確認為估值增值。

3、在銀行間同業市場交易的債券品種，根據中國證監會證監會計字[2007]21 號《關於證券投資基金執行〈企業會計準則〉估值業務及份額淨值計價有關事項的通知》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場債券按現金流量折現法估值，具體估值模型、參數及結果由中央國債登記結算有限責任公司獨立提供。

4、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、資產支援證券和私募債券除外)，於 2015 年 3 月 20 日起按照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。

7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

7.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

7.4.5.2 會計估計變更的說明

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、資產支持證券和私募債券除外)，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。

7.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

7.4.6 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》及其他相關財稅法規和實務操作，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徵收範圍，不徵收營業稅。
- 2、基金買賣股票、債券的差價收入暫免徵營業稅和企業所得稅。
- 3、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，於 2015 年 9 月 8 日前減按 25% 計入應納稅所得額，自 2015 年 9 月 8 日起暫免徵收個人所得稅。
- 4、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。

5、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、企業所得稅和個人所得稅。

7.4.7 重要財務報表項目的說明

7.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

項目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	438,027,605.72	501,676,355.67
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合計	438,027,605.72	501,676,355.67

7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2015年12月31日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	3,042,114,090.93	3,263,829,928.19	221,715,837.26	
貴金屬投資-金交所 黃金合約	-	-	-	
債券	交易所市場	47,825,356.35	49,004,581.00	1,179,224.65
	銀行間市場	3,627,795,207.23	3,678,513,500.00	50,718,292.77
	合計	3,675,620,563.58	3,727,518,081.00	51,897,517.42
資產支持證券	5,195,000.00	5,195,000.00	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合計	6,722,929,654.51	6,996,543,009.19	273,613,354.68	
項目	上年度末 2014年12月31日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	5,111,078,720.53	5,542,177,210.70	431,098,490.17	
貴金屬投資-金交所 黃金合約	-	-	-	
債券	交易所市場	108,044,140.98	134,952,578.70	26,908,437.72
	銀行間市場	2,518,112,682.37	2,513,369,500.00	-4,743,182.37
	合計	2,626,156,823.35	2,648,322,078.70	22,165,255.35
資產支持證券	8,440,000.00	8,440,000.00	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合計	7,745,675,543.88	8,198,939,289.40	453,263,745.52

7.4.7.3 衍生金融資產/負債

本基金本報告期末及上年度末均無衍生金融資產/負債餘額。

7.4.7.4 買入返售金融資產

7.4.7.4.1 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 2015 年 12 月 31 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	99,000,169.50	-
交易所市場買入返售金融資產	100,000,000.00	-
合計	199,000,169.50	-
項目	上年度末 2014 年 12 月 31 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	396,000,834.00	-
交易所市場買入返售金融資產	-	-
合計	396,000,834.00	-

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

本基金本報告期末及上年度末均未持有買斷式逆回購交易中取得的債券。

7.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
應收活期存款利息	157,277.38	118,697.54
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	5,970.17	9,548.84
應收債券利息	70,697,948.32	44,168,045.51
應收買入返售證券利息	9,743.06	100,891.88
應收申購款利息	-	-
應收黃金合約拆借孳息	-	-
其他	86,722.60	139,220.22

合計	70,957,661.53	44,536,403.99
----	---------------	---------------

7.4.7.6 其他資產

本基金本報告期末及上年度末均無其他資產餘額。

7.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市場應付交易費用	30,298,457.82	37,087,196.94
銀行間市場應付交易費用	4,919.50	9,303.70
合計	30,303,377.32	37,096,500.64

7.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	750,000.00	750,000.00
應付贖回費	37,468.33	161,722.03
預提費用	340,000.00	100,000.00
合計	1,127,468.33	1,011,722.03

7.4.7.9 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	7,064,090,326.45	7,064,090,326.45
本期申購	3,266,451,975.14	3,266,451,975.14
本期贖回（以“-”號填列）	-4,139,064,766.23	-4,139,064,766.23
本期末	6,191,477,535.36	6,191,477,535.36

注：2015 年 12 月 31 日基金份額總額 6,191,477,535.36 份，其中 A 類基金份額 6,185,569,443.49 份，H 類基金份額 5,908,091.87 份。

7.4.7.10 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	178,214,741.44	1,889,137,538.65	2,067,352,280.09
本期利潤	2,205,592,745.92	-179,650,390.84	2,025,942,355.08

本期基金份額交易產生的變動數	-30,380,508.04	-378,869,082.04	-409,249,590.08
其中：基金申購款	67,889,000.66	1,053,925,396.85	1,121,814,397.51
基金贖回款	-98,269,508.70	-1,432,794,478.89	-1,531,063,987.59
本期已分配利潤	-2,269,997,158.17	-	-2,269,997,158.17
本期末	83,429,821.15	1,330,618,065.77	1,414,047,886.92

7.4.7.11 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
活期存款利息收入	6,847,868.34	6,805,061.19
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	209,359.43	259,565.04
其他	52,247.14	36,530.02
合計	7,109,474.91	7,101,156.25

7.4.7.12 股票投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
賣出股票成交總額	16,303,523,774.59	17,334,871,674.61
減：賣出股票成本總額	14,140,394,569.19	15,591,150,982.29
買賣股票差價收入	2,163,129,205.40	1,743,720,692.32

7.4.7.13 債券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成交總額	3,285,501,904.02	1,393,539,643.96
減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	3,218,098,459.77	1,346,303,964.54
減：應收利息總額	47,985,105.34	45,877,150.22
買賣債券差價收入	19,418,338.91	1,358,529.20

7.4.7.14 資產支持證券投資收益

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
賣出資產支持證券成交總額	-	6,351,271.23
減：賣出資產支持證券成本總額	-	6,560,000.00
減：應收利息總額	-	771.23
資產支持證券投資收益	-	-209,500.00

7.4.7.15 貴金屬投資收益

7.4.7.15.1 貴金屬投資收益項目構成

本基金本報告期及上年度可比期間均無貴金屬投資收益。

7.4.7.15.2 貴金屬投資——買賣貴金屬差價收入

本基金本報告期及上年度可比期間均無貴金屬投資收益。

7.4.7.15.3 貴金屬投資——贖回差價收入

本基金本報告期及上年度可比期間均無貴金屬投資收益。

7.4.7.15.4 貴金屬投資——申購差價收入

本基金本報告期及上年度可比期間均無貴金屬投資收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——買賣權證差價收入

本基金本報告期及上年度可比期間均無買賣權證差價收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本報告期及上年度可比期間均無其他衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
股票投資產生的股利收益	52,244,316.85	67,909,879.05
基金投資產生的股利收益	-	-
合計	52,244,316.85	67,909,879.05

7.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
1.交易性金融資產	-179,650,390.84	-1,097,135,567.34
——股票投資	-209,382,652.91	-1,220,326,525.71
——債券投資	29,732,262.07	123,190,958.37
——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	-179,650,390.84	-1,097,135,567.34

7.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
基金贖回費收入	7,087,960.71	5,965,047.49
其他	-	-
合計	7,087,960.71	5,965,047.49

7.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
交易所市場交易費用	43,451,074.63	48,443,936.00
銀行間市場交易費用	31,375.00	3,637.50
合計	43,482,449.63	48,447,573.50

7.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
審計費用	100,000.00	100,000.00
信息披露費	240,000.00	240,000.00
銀行費用	59,169.37	73,579.27

銀行間帳戶維護費	36,000.00	27,000.00
其他	650.00	400.00
合計	435,819.37	440,979.27

7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

7.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

7.4.8.2 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。

7.4.9 關聯方關係

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
山東省農村經濟開發投資公司	基金管理人的股東
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股東
青島海鵬科技投資有限公司	基金管理人的股東
南方工業資產管理有限責任公司	基金管理人的股東

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。

7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期間 2014年1月1日至2014年12月31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	699,309,336.76	2.47%	2,474,452,214.03	7.74%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期間 2014年1月1日至2014年12月31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	20.37%	32,017,206.00	49.36%

7.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期間 2014年1月1日至2014年12月31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	45.44%	304,400,000.00	3.07%

7.4.10.1.5 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2015年1月1日至2015年12月31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	636,651.09	2.64%	636,651.09	2.10%
關聯方名稱	上年度可比期間 2014年1月1日至2014年12月31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	2,252,735.53	8.21%	990,213.36	2.67%

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、經手費和由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。

該類佣金協定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和市場信息服務。

7.4.10.2 關聯方報酬

7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日

當期發生的基金應支付的管理費	127,815,286.52	160,780,920.08
其中：支付銷售機構的客戶維護費	11,098,825.64	12,920,691.17

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支付，不屬於從基金資產中支付的費用項目。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
當期發生的基金應支付的託管費	21,302,547.65	26,796,819.93

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。

7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

單位：人民幣元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
銀行間市場交 易的各關聯方 名稱	債券交易金額		基金逆回購		基金正回購	
	基金買入	基金賣出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中國銀行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期間 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
銀行間市場交 易的各關聯方 名稱	債券交易金額		基金逆回購		基金正回購	
	基金買入	基金賣出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中國銀行	-	-	188,000,000.00	13,185.75	-	-

7.4.10.4 各關聯方投資本基金的情況

7.4.10.4.1 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 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31日
期初持有的基金份額	-	-
期間申購/買入總份額	16,278,317.76	-
期間因分拆變動份額	-	-
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%	-

注：本報告期“期間申購/買入總份額”為轉換入份額，根據本基金管理人制定的轉換業務規則，上述轉入適用的轉入基金前端申購費率為 1.00%。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2015年1月1日至 2015年12月31日		上年度可比期間 2014年1月1日至 2014年12月31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	438,027,605.72	6,847,868.34	501,676,355.67	6,805,061.19

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。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利潤分配情況

單位：人民幣元

序號	權益 登記日	除息日	每 10 份基 金份 額分 紅數	現金形式 發放總額	再投資形式 發放總額	本期利潤分配 合計	備註
1	2015-01-14	2015-01-14	0.275	67,584,574.37	124,040,845.28	191,625,419.65	-
2	2015-02-04	2015-02-04	0.275	67,200,300.42	124,775,895.20	191,976,195.62	-

3	2015-03-10	2015-03-10	0.250	60,906,701.28	114,466,645.55	175,373,346.83	-
4	2015-03-24	2015-03-24	0.250	60,271,371.31	114,926,455.29	175,197,826.60	-
5	2015-04-01	2015-04-01	0.250	59,546,022.64	115,869,670.65	175,415,693.29	-
6	2015-04-14	2015-04-14	0.250	58,937,629.49	115,258,917.36	174,196,546.85	-
7	2015-05-06	2015-05-06	0.250	56,891,400.88	108,809,087.16	165,700,488.04	-
8	2015-05-26	2015-05-26	0.225	49,465,229.89	93,703,048.26	143,168,278.15	-
9	2015-06-10	2015-06-10	0.225	48,330,345.52	90,694,627.48	139,024,973.00	-
10	2015-06-17	2015-06-17	0.225	47,899,835.72	90,772,893.63	138,672,729.35	-
11	2015-06-26	2015-06-26	0.225	47,974,312.23	90,571,516.25	138,545,828.48	-
12	2015-07-07	2015-07-07	0.200	42,487,887.42	79,433,203.23	121,921,090.65	-
13	2015-07-15	2015-07-15	0.200	42,449,585.06	79,429,005.44	121,878,590.50	-
14	2015-07-30	2015-07-30	0.200	43,551,743.95	81,029,289.02	124,581,032.97	-
15	2015-11-25	2015-11-25	0.150	33,106,409.71	59,612,708.48	92,719,118.19	-
合計	-	-	3.450	786,603,349.89	1,483,393,808.28	2,269,997,158.17	-

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限證券

7.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

本基金本報告期末未持有因認購新發/增發證券而流通受限的證券。

7.4.12.2 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
002371	七星電子	2015-10-08	重大事項	19.28	2016-01-11	21.21	18,143	1,021,340.75	349,797.04	-
002537	海立美達	2015-08-17	重大事項	15.33	2016-01-11	21.21	1,457,120	24,201,018.58	22,337,649.60	-
300081	恒信移動	2015-11-26	重大事項	47.84	-	-	5	68.04	239.20	-
300331	蘇大維格	2015-11-16	重大事項	25.69	-	-	16,060	257,211.00	412,581.40	-
600584	長電科技	2015-11-30	重大事項	22.94	-	-	1,162,200	22,028,288.05	26,660,868.00	-
600654	中安消	2015-12-14	重大事項	28.84	-	-	100,000	3,667,659.00	2,884,000.00	-

600690	青島海爾	2015-10-19	重大事項	11.66	2016-02-01	8.93	217,276	2,424,994.81	2,533,438.16	-
600978	宜華木業	2015-06-18	重大事項	21.31	2016-01-21	20.10	3,200,000	18,416,785.04	68,192,000.00	-

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。

7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

截至本報告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

截至本報告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具風險及管理

7.4.13.1 風險管理政策和組織架構

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、法律監察部、稽核部、風險管理部和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、投資決策委員會和風險管理委員會，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和定量分析的方法，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、模型和日常的量化報告，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查和評估，並制定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

7.4.13.2 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和交易對手庫，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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.4 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存續期、Beta 值等指標來衡量市場風險。

7.4.13.4.1 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存續期等方法對上述利率風險進行管理。

7.4.13.4.1.1 承受利率風險

單位：人民幣元

本期末 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	-	-	-	-
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
銀行存款	501,676,355.67	-	-	501,676,355.67
結算備付金	19,304,465.63	-	-	19,304,465.63
結算保證金	1,422,966.41	-	-	1,422,966.41

債券投資	1,229,354,681.90	1,359,087,396.80	59,880,000.00	2,648,322,078.70
資產支持證券	8,440,000.00	-	-	8,440,000.00
買入返售金融資產	396,000,834.00	-	-	396,000,834.00
應收直銷申購款	223,516.04	-	-	223,516.04
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。

7.4.13.4.1.2 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 （2015 年 12 月 31 日）	上年度末 （2014 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 個基點	15,298,874.50	9,805,029.52
利率上升 25 個基點	-15,188,059.58	-9,773,978.62	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率和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和分析，以對風險進行跟蹤和控制。

7.4.13.4.3.1 承受其他價格風險

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	3,263,829,928.19	42.91	5,542,177,210.70	60.69

交易性金融資產-貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產-權證投資	-	-	-	-
合計	3,263,829,928.19	42.91	5,542,177,210.70	60.69

7.4.13.4.3.2 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 （2015 年 12 月 31 日）	上年度末 （2014 年 12 月 31 日）
	+5%	163,109,900.66	123,256,975.24
	-5%	-163,109,900.66	-123,256,975.24

7.4.14 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 各層次金融工具公允價值

截至 2015 年 12 月 31 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 3,149,300,972.43 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。（截至 2014 年 12 月 31 日止：第一層次的餘額為 5,617,121,799.00 元，第二層次的餘額為 2,581,817,490.40 元，第三層次的餘額為

0 元。)

7.4.14.3 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，本基金將相關股票和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、資產支持證券和私募債券除外)，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。

7.4.14.4 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。

§8 投資組合報告

8.1 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	3,263,829,928.19	41.80
	其中：股票	3,263,829,928.19	41.80
2	固定收益投資	3,732,713,081.00	47.80
	其中：債券	3,727,518,081.00	47.73
	資產支持證券	5,195,000.00	0.07
3	貴金屬投資	-	-
4	金融衍生品投資	-	-
5	買入返售金融資產	199,000,169.50	2.55
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
6	銀行存款和結算備付金合計	450,089,685.24	5.76
7	其他各項資產	163,398,062.45	2.09
8	合計	7,809,030,926.38	100.00

8.2 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	48,065,473.95	0.63
B	採礦業	-	-
C	製造業	2,046,420,813.45	26.91
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	117,844,273.90	1.55
E	建築業	181,233,218.51	2.38
F	批發和零售業	74,426,057.38	0.98
G	交通運輸、倉儲和郵政業	111,829,378.16	1.47
H	住宿和餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	218,145,683.26	2.87
J	金融業	392,216,618.46	5.16
K	房地產業	13,540,976.56	0.18
L	租賃和商務服務業	922,120.29	0.01
M	科學研究和技術服務業	57,841,224.60	0.76
N	水利、環境和公共設施管理業	362.39	0.00
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	1,343,727.28	0.02
S	綜合	-	-
	合計	3,263,829,928.19	42.91

8.3 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	000423	東阿阿膠	5,613,141	293,567,274.30	3.86
2	600036	招商銀行	9,999,845	179,897,211.55	2.37
3	600612	老鳳祥	4,100,414	177,383,909.64	2.33
4	002051	中工國際	6,635,062	168,066,120.46	2.21
5	600004	白雲機場	7,543,392	107,342,468.16	1.41
6	002662	京威股份	4,290,800	94,397,600.00	1.24
7	600587	新華醫療	2,260,209	82,113,392.97	1.08
8	600060	海信電器	3,999,983	78,679,665.61	1.03
9	600398	海瀾之家	5,073,489	70,825,906.44	0.93

10	600718	東軟集團	2,205,771	68,489,189.55	0.90
11	600978	宜華木業	3,200,000	68,192,000.00	0.90
12	601166	興業銀行	3,700,000	63,159,000.00	0.83
13	002508	老闆電器	1,256,389	56,474,685.55	0.74
14	300335	迪森股份	2,981,851	55,283,517.54	0.73
15	300007	漢威電子	1,529,033	52,292,928.60	0.69
16	300195	長榮股份	2,164,276	51,704,553.64	0.68
17	600289	億陽信通	2,442,569	48,118,609.30	0.63
18	600900	長江電力	3,500,000	47,460,000.00	0.62
19	601328	交通銀行	7,145,936	46,019,827.84	0.61
20	000910	大亞科技	2,778,000	45,948,120.00	0.60
21	002595	豪邁科技	1,999,874	45,377,141.06	0.60
22	600521	華海藥業	1,762,780	44,756,984.20	0.59
23	002230	科大訊飛	1,200,000	44,460,000.00	0.58
24	300310	宜通世紀	668,250	41,652,022.50	0.55
25	002587	奧拓電子	2,636,289	41,257,922.85	0.54
26	002426	勝利精密	1,577,103	41,036,220.06	0.54
27	300076	GQY 視訊	1,217,228	40,923,205.36	0.54
28	000729	燕京啤酒	4,717,660	38,826,341.80	0.51
29	600449	寧夏建材	3,447,617	38,613,310.40	0.51
30	600525	長園集團	2,000,000	37,660,000.00	0.50
31	002321	華英農業	2,834,010	37,437,272.10	0.49
32	601318	中國平安	1,000,000	36,000,000.00	0.47
33	600843	上工申貝	2,100,000	35,217,000.00	0.46
34	002116	中國海誠	1,966,200	34,919,712.00	0.46
35	000401	冀東水泥	3,199,945	34,879,400.50	0.46
36	000333	美的集團	1,051,649	34,515,120.18	0.45
37	000938	紫光股份	348,605	34,295,759.90	0.45
38	600337	美克家居	2,167,740	33,860,098.80	0.45
39	600686	金龍汽車	1,749,746	33,577,625.74	0.44
40	600303	曙光股份	2,122,150	32,575,002.50	0.43
41	002215	諾普信	1,551,047	29,749,081.46	0.39
42	600016	民生銀行	3,000,000	28,920,000.00	0.38
43	601939	建設銀行	4,999,966	28,899,803.48	0.38
44	601607	上海醫藥	1,399,915	27,872,307.65	0.37
45	600584	長電科技	1,162,200	26,660,868.00	0.35
46	300202	聚龍股份	799,990	25,751,678.10	0.34

47	000100	TCL 集團	6,000,000	25,560,000.00	0.34
48	600176	中國巨石	999,947	25,408,653.27	0.33
49	300073	當升科技	610,372	23,700,744.76	0.31
50	300008	上海佳豪	861,711	22,921,512.60	0.30
51	002537	海立美達	1,457,120	22,337,649.60	0.29
52	002456	歐菲光	699,961	21,712,790.22	0.29
53	600298	安琪酵母	699,684	21,284,387.28	0.28
54	002588	史坦萊	614,469	19,988,676.57	0.26
55	600171	上海貝嶺	900,000	19,071,000.00	0.25
56	600600	青島啤酒	499,905	16,596,846.00	0.22
57	300147	香雪製藥	641,280	16,038,412.80	0.21
58	000651	格力電器	700,000	15,645,000.00	0.21
59	600642	申能股份	2,000,000	15,100,000.00	0.20
60	300156	神霧環保	279,839	13,989,151.61	0.18
61	300390	天華超淨	298,610	13,252,311.80	0.17
62	002717	嶺南園林	299,902	13,165,697.80	0.17
63	000418	小天鵝 A	535,314	12,847,536.00	0.17
64	600048	保利地產	1,000,000	10,640,000.00	0.14
65	002467	二六三	499,941	10,493,761.59	0.14
66	600598	北大荒	635,545	9,361,577.85	0.12
67	300204	舒泰神	261,100	9,253,384.00	0.12
68	600000	浦發銀行	499,797	9,131,291.19	0.12
69	002668	奧馬電器	100,000	8,330,000.00	0.11
70	600126	杭鋼股份	1,000,000	8,110,000.00	0.11
71	002348	高樂股份	455,711	7,988,613.83	0.11
72	300146	湯臣倍健	199,901	7,696,188.50	0.10
73	000963	華東醫藥	89,514	7,336,567.44	0.10
74	002085	萬豐奧威	200,000	6,436,000.00	0.08
75	002009	天奇股份	300,000	6,225,000.00	0.08
76	002665	首航節能	199,918	6,097,499.00	0.08
77	002172	澳洋科技	400,000	5,952,000.00	0.08
78	002094	青島金王	184,900	5,759,635.00	0.08
79	002387	黑牛食品	300,000	5,604,000.00	0.07
80	603108	潤達醫療	49,978	5,126,743.24	0.07
81	000828	東莞控股	353,300	4,486,910.00	0.06
82	002389	南洋科技	200,000	4,076,000.00	0.05
83	000567	海德股份	100,000	2,900,000.00	0.04

84	600654	中安消	100,000	2,884,000.00	0.04
85	002472	雙環傳動	98,300	2,624,610.00	0.03
86	600690	青島海爾	217,276	2,533,438.16	0.03
87	002599	盛通股份	50,000	2,037,000.00	0.03
88	002572	索菲亞	36,819	1,586,898.90	0.02
89	300291	華錄百納	37,721	1,342,867.60	0.02
90	002299	聖農發展	57,600	1,266,624.00	0.02
91	600138	中青旅	39,559	922,120.29	0.01
92	300496	中科創達	6,560	918,465.60	0.01
93	300271	華宇軟體	16,578	787,123.44	0.01
94	603936	博敏電子	12,448	638,333.44	0.01
95	300331	蘇大維格	16,060	412,581.40	0.01
96	002371	七星電子	18,143	349,797.04	0.00
97	300493	潤欣科技	7,248	299,632.32	0.00
98	002780	三夫戶外	3,566	222,304.44	0.00
99	600999	招商證券	8,732	189,484.40	0.00
100	300383	光環新網	230	12,813.30	0.00
101	600446	金證股份	252	12,395.88	0.00
102	300491	通合科技	500	7,545.00	0.00
103	300017	網宿科技	110	6,598.90	0.00
104	600694	大商股份	90	4,646.70	0.00
105	300182	捷成股份	165	3,960.00	0.00
106	600085	同仁堂	80	3,568.80	0.00
107	600535	天士力	87	3,560.04	0.00
108	600588	用友網路	89	2,831.09	0.00
109	600476	湘郵科技	53	2,080.25	0.00
110	600463	空港股份	75	1,400.25	0.00
111	000151	中成股份	51	1,246.44	0.00
112	603001	奧康國際	35	1,176.70	0.00
113	600976	健民集團	33	1,116.39	0.00
114	601519	大智慧	87	1,115.34	0.00
115	600406	國電南瑞	65	1,084.20	0.00
116	600104	上汽集團	49	1,039.78	0.00
117	002241	歌爾聲學	30	1,038.00	0.00
118	600007	中國國貿	52	976.56	0.00
119	600802	福建水泥	88	975.04	0.00
120	300130	新國都	26	969.02	0.00

121	600825	新華傳媒	72	859.68	0.00
122	600151	航太機電	69	852.84	0.00
123	600335	國機汽車	42	787.08	0.00
124	600483	福能股份	44	756.36	0.00
125	600222	太龍藥業	74	696.34	0.00
126	601208	東材科技	67	627.79	0.00
127	002559	亞威股份	32	509.12	0.00
128	600566	濟川藥業	15	414.90	0.00
129	300070	碧水源	7	362.39	0.00
130	601633	長城汽車	21	252.84	0.00
131	600081	東風科技	11	247.06	0.00
132	300081	恒信移動	5	239.20	0.00
133	600285	羚銳製藥	16	212.00	0.00
134	002520	日發精機	6	158.70	0.00
135	600887	伊利股份	8	131.44	0.00

8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

8.4.1 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	000423	東阿阿膠	527,393,414.78	5.78
2	002051	中工國際	346,095,444.54	3.79
3	600036	招商銀行	278,628,166.75	3.05
4	002410	廣聯達	224,862,437.52	2.46
5	600887	伊利股份	216,044,999.33	2.37
6	600999	招商證券	212,849,195.96	2.33
7	600612	老鳳祥	209,772,786.34	2.30
8	300271	華宇軟體	179,910,340.73	1.97
9	600872	中炬高新	173,861,879.42	1.90
10	601318	中國平安	164,343,024.72	1.80
11	600837	海通證券	152,290,359.66	1.67
12	600376	首開股份	150,801,923.34	1.65
13	600048	保利地產	149,943,261.44	1.64
14	601166	興業銀行	128,946,972.30	1.41
15	600518	康美藥業	119,707,794.10	1.31
16	000002	萬科 A	110,442,157.01	1.21
17	600398	海瀾之家	106,686,559.20	1.17

18	000910	大亞科技	105,455,785.15	1.15
19	600004	白雲機場	103,590,802.60	1.13
20	000049	德賽電池	99,894,775.41	1.09

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。

8.4.2 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	600887	伊利股份	425,421,949.55	4.66
2	002051	中工國際	388,166,030.37	4.25
3	002065	東華軟體	337,543,099.68	3.70
4	300271	華宇軟體	328,883,830.43	3.60
5	600376	首開股份	297,045,784.88	3.25
6	002410	廣聯達	289,444,554.95	3.17
7	600406	國電南瑞	281,398,522.40	3.08
8	600837	海通證券	278,812,684.18	3.05
9	601633	長城汽車	273,863,270.67	3.00
10	601318	中國平安	265,656,744.34	2.91
11	000423	東阿阿膠	243,395,158.61	2.67
12	600019	寶鋼股份	226,276,199.34	2.48
13	002400	省廣股份	222,189,427.66	2.43
14	002116	中國海誠	209,739,409.71	2.30
15	600690	青島海爾	205,769,618.75	2.25
16	600999	招商證券	201,677,096.36	2.21
17	600872	中炬高新	191,461,800.12	2.10
18	601601	中國太保	180,019,590.90	1.97
19	600518	康美藥業	179,757,818.53	1.97
20	601628	中國人壽	174,134,945.00	1.91

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。

8.4.3 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	12,071,429,939.59
賣出股票收入（成交）總額	16,303,523,774.59

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。

8.5 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	62,526,000.00	0.82
2	央行票據	-	-
3	金融債券	3,289,695,500.00	43.25
	其中：政策性金融債	3,289,695,500.00	43.25
4	企業債券	76,450,581.00	1.01
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	298,846,000.00	3.93
7	可轉債（可交換債）	-	-
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	3,727,518,081.00	49.01

8.6 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	150413	15 農發 13	6,200,000	620,682,000.00	8.16
2	150411	15 農發 11	3,200,000	320,928,000.00	4.22
3	150416	15 農發 16	2,800,000	280,644,000.00	3.69
4	090205	09 國開 05	2,200,000	220,814,000.00	2.90
5	110221	11 國開 21	2,200,000	220,242,000.00	2.90
6	150205	15 國開 05	2,000,000	208,620,000.00	2.74
7	150403	15 農發 03	1,800,000	180,360,000.00	2.37
8	110216	11 國開 16	1,600,000	165,648,000.00	2.18
9	150202	15 國開 02	1,600,000	160,192,000.00	2.11
10	140228	14 國開 28	1,000,000	105,410,000.00	1.39
11	120401	12 農發 01	1,000,000	103,510,000.00	1.36
12	120412	12 農發 12	1,000,000	103,270,000.00	1.36
13	150201	15 國開 01	1,000,000	102,480,000.00	1.35
14	110316	11 進出 16	900,000	91,152,000.00	1.20

15	110024	11 付息國債 24	600,000	62,526,000.00	0.82
16	150304	15 進出 04	500,000	52,135,000.00	0.69
17	1182346	11 中化工 MTN2	500,000	50,985,000.00	0.67
18	100215	10 國開 15	450,000	45,468,000.00	0.60
19	140222	14 國開 22	400,000	44,996,000.00	0.59
20	122149	12 石化 01	439,470	44,957,781.00	0.59
21	150404	15 農發 04	400,000	41,676,000.00	0.55
22	140229	14 國開 29	300,000	32,208,000.00	0.42
23	1382111	13 國網 MTN1	300,000	31,344,000.00	0.41
24	1382176	13 航機電 MTN1	300,000	31,224,000.00	0.41
25	120303	12 進出 03	300,000	31,089,000.00	0.41
26	140201	14 國開 01	300,000	30,954,000.00	0.41
27	1182226	11 首鋼 MTN1	300,000	30,567,000.00	0.40
28	110318	11 進出 18	300,000	30,408,000.00	0.40
29	130212	13 國開 12	300,000	30,282,000.00	0.40
30	150301	15 進出 01	300,000	30,027,000.00	0.39
31	080216	08 國開 16	250,000	26,497,500.00	0.35
32	1382269	13 渝保稅 MTN1	200,000	21,012,000.00	0.28
33	1382131	13 鎮國投 MTN2	200,000	20,942,000.00	0.28
34	1282449	12 滇健工 MTN1	200,000	20,854,000.00	0.27
35	1182344	11 首鋼 MTN2	200,000	20,352,000.00	0.27
36	1182078	11 蘇國資 MTN2	200,000	20,298,000.00	0.27
37	1182029	11 新中泰 MTN1	200,000	20,276,000.00	0.27
38	1382188	13 吉利 MTN1	200,000	20,188,000.00	0.27
39	1280076	12 蕪湖建投債 01	150,000	16,845,000.00	0.22
40	101356006	13 馬城投 MTN001	100,000	10,804,000.00	0.14
41	088005	08 國網債 02	100,000	10,601,000.00	0.14
42	110402	11 農發 02	100,000	10,003,000.00	0.13
43	122957	09 蓉工投	40,000	4,046,800.00	0.05

8.7 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	5,195,000.00	0.07

8.8 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。

8.9 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。

8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

8.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉和損益詳情

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.10.2 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。

8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

8.11.1 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。

8.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉和損益詳情

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.3 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。

8.12 投資組合報告附注

8.12.1 報告期內，本基金投資決策程式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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,955,841.07
2	應收證券結算款	79,345,864.85
3	應收股利	-
4	應收利息	70,957,661.53
5	應收申購款	10,138,695.00
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	163,398,062.45

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

§9 基金份額持有人資訊

9.1 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
291,635	21,230.23	27,888,118.92	0.45%	6,163,589,416.44	99.55%

9.2 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	3,119,884.40	0.05%

9.3 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、基金投資和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

§10 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	7,064,090,326.45
本報告期基金總申購份額	3,266,451,975.14
減：本報告期基金總贖回份額	4,139,064,766.23
本報告期基金分拆變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	6,191,477,535.36

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人於 2015 年 3 月 5 日發佈公告，劉義先生任華夏基金管理有限公司副總經理。

本基金管理人於 2015 年 5 月 9 日發佈公告，陽琨先生、李一梅女士任華夏基金管理有限公司副總經理，林浩先生、吳志軍先生不再擔任華夏基金管理有限公司副總經理。

本基金管理人於 2015 年 8 月 1 日發佈公告，湯曉東先生任華夏基金管理有限公司總經理，周璿女士任華夏基金管理有限公司督察長。

2015 年 4 月 1 日，李愛華先生不再擔任中國銀行股份有限公司託管業務部總經理職務。上述人事變動已按相關規定備案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本基金管理人於 2015 年 3 月 19 日發佈公告，對國家工商行政管理總局商標評審委員會作出的商標駁回複審決定向北京智慧財產權法院提起行政訴訟。該案件已於 2015 年 7 月 20 日獲得勝訴判決。

本報告期內無涉及本基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

11.4 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。

11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金本報告期應支付給安永華明會計師事務所（特殊普通合伙）的報酬為 100,000 元人民幣。截至本報告期末，該事務所已向本基金提供 8 年的審計服務。

11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人報告期內收到中國證券監督管理委員會北京監管局（以下簡稱“北京證監局”）《關於對華夏基金管理有限公司採取責令整改及暫不受理行政許可的行政監管措施的決定》：決定自責令整改行政監管措施生效之日起六個月內，暫不受理公司發行的公募基金產品註冊申請，已受理的公募基金產品註冊申

請中止審查，對相關責任人採取行政監管措施。公司已在規定時間完成整改，並已通過北京證監局的現場整改驗收，2015年8月12日整改期結束。

本報告期內託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員未受到任何稽查或處罰。

11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

11.7.1 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	
國都證券	1	5,117,122,262.55	18.04%	3,677,081.22	15.23%	-
申萬宏源證券	1	4,175,113,479.52	14.72%	3,802,576.30	15.75%	-
中國銀河證券	1	3,350,664,991.24	11.81%	3,050,443.41	12.64%	-
廣發證券	1	3,031,809,634.40	10.69%	2,769,522.55	11.47%	-
西南證券	2	2,698,468,628.97	9.51%	2,105,513.58	8.72%	-
長江證券	1	2,261,936,670.90	7.97%	2,071,251.98	8.58%	-
川財證券	1	1,877,849,341.78	6.62%	1,364,529.20	5.65%	-
國泰君安證券	2	1,313,312,259.48	4.63%	1,223,086.89	5.07%	-
海通證券	1	1,125,303,566.46	3.97%	1,024,476.26	4.24%	-
安信證券	1	1,083,954,762.05	3.82%	998,530.79	4.14%	-
東方證券	1	1,081,578,038.22	3.81%	990,509.35	4.10%	-
中信證券	3	699,309,336.76	2.47%	636,651.09	2.64%	-
信達證券	1	390,236,724.01	1.38%	277,224.16	1.15%	-
中金公司	1	160,976,143.95	0.57%	146,552.66	0.61%	-

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、公司和證券市場研究報告，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，能及時提供準確的資訊資訊和服務。

② 券商專用交易單元選擇程式：

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和研究實力進行評估，確定選用交易單元的券商。

ii 協定簽署及通知託管人

本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協定，並通知基金託管人。

③除本表列示外，本基金還選擇了民族證券、瑞銀證券、中銀國際證券、南京證券和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在上述租用的券商交易單元中，中信證券的交易單元為本基金本期新增的交易單元，本期沒有剔除的券商交易單元。

11.7.2 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
申萬宏源證券	-	-	400,000,000.00	9.09%
廣發證券	34,501,382.90	47.97%	1,700,000,000.00	38.63%
西南證券	1,992,000.00	2.77%	-	-
川財證券	-	-	101,000,000.00	2.29%
國泰君安證券	20,782,400.00	28.89%	-	-
東方證券	-	-	200,000,000.00	4.54%
中信證券	14,651,625.50	20.37%	2,000,000,000.00	45.44%

11.8 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	華夏回報證券投資基金第五十八次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-01-09
2	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	2015-01-12
3	華夏基金管理有限公司關於調整華夏回報證券投資基金基金經理的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-01-22
4	華夏回報證券投資基金第五十九次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-02-02
5	華夏回報證券投資基金第六十次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-05
6	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-05
7	華夏回報證券投資基金第六十一次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-18

8	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-19
9	華夏基金管理有限公司關於增聘華夏回報證券投資基金基金經理的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-19
10	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增蘇州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	2015-03-26
11	華夏回報證券投資基金第六十二次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-03-27
12	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增太平洋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	2015-03-31
13	華夏回報證券投資基金第六十三次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-04-08
14	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	2015-04-27
15	華夏回報證券投資基金第六十四次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-05-04
16	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-05-09
17	華夏回報證券投資基金第六十五次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-05-21
18	華夏基金管理有限公司關於在中國工商銀行股份有限公司開通旗下部分開放式基金基金轉換業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-06-04
19	華夏回報證券投資基金第六十六次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-06-08
20	華夏回報證券投資基金第六十七次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-06-15
21	華夏回報證券投資基金第六十八次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-06-23
22	華夏基金管理有限公司關於調整華夏回報證券投資基金基金經理的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-06-27
23	華夏回報證券投資基金第六十九次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-02
24	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	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-02
25	華夏基金管理有限公司關於公司、高管及基金經理投資旗下基金相關事宜的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-06
26	華夏回報證券投資基金第七十次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-10
27	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增泉州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	2015-07-15
28	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增中信期貨有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-20

29	華夏回報證券投資基金第七十一次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-07-27
30	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-08-01
31	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	2015-08-22
32	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陸金所資產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	2015-09-01
33	華夏基金管理有限公司關於深圳分公司經營場所變更的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-09-11
34	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增北京恒天明澤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	2015-10-14
35	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增北京樂融多源投資諮詢有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-10-21
36	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匯付金融服務有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-11-13
37	華夏基金管理有限公司關於成都分公司經營場所變更的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-11-20
38	華夏回報證券投資基金第七十二次分紅公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-11-20
39	華夏基金管理有限公司關於增聘華夏回報證券投資基金基金經理的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-11-21
40	華夏基金管理有限公司關於南京分公司經營場所變更的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-11-24
41	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金在杭州數米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	2015-11-25
42	華夏基金管理有限公司關於華夏資本管理有限公司變更相關事項的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-12-01
43	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增諾亞正行（上海）基金銷售投資顧問有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-12-18
44	華夏基金管理有限公司關於指數熔斷機制實施後旗下基金業務配套工作安排的公告	中國證監會指定報刊及網站	2015-12-31

§12 備查文件目錄

12.1 備查文件目錄

12.1.1 中國證監會核准基金募集的文件；

12.1.2 《華夏回報證券投資基金基金合同》；

12.1.3 《華夏回報證券投資基金託管協議》；

12.1.4 法律意見書；

12.1.5 基金管理人業務資格批件、營業執照；

12.1.6 基金託管人業務資格批件、營業執照。

12.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人和/或基金託管人的住所。

12.3 查閱方式

投資者可到基金管理人和/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

二〇一六年三月二十九日

§13 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）
(1) 股票投資		
上市投資		
中國(100%)		
東阿阿膠	5,613,141	293,567,274.30
招商銀行	9,999,845	179,897,211.55
老鳳祥	4,100,414	177,383,909.64
中工國際	6,635,062	168,066,120.46
白雲機場	7,543,392	107,342,468.16
京威股份	4,290,800	94,397,600.00
新華醫療	2,260,209	82,113,392.97
海信電器	3,999,983	78,679,665.61
海瀾之家	5,073,489	70,825,906.44
東軟集團	2,205,771	68,489,189.55
宜華木業	3,200,000	68,192,000.00
興業銀行	3,700,000	63,159,000.00
老闆電器	1,256,389	56,474,685.55
迪森股份	2,981,851	55,283,517.54
漢威電子	1,529,033	52,292,928.60
長榮股份	2,164,276	51,704,553.64
億陽信通	2,442,569	48,118,609.30
長江電力	3,500,000	47,460,000.00
交通銀行	7,145,936	46,019,827.84
大亞科技	2,778,000	45,948,120.00
豪邁科技	1,999,874	45,377,141.06
華海藥業	1,762,780	44,756,984.20
科大訊飛	1,200,000	44,460,000.00
宜通世紀	668,250	41,652,022.50
奧拓電子	2,636,289	41,257,922.85
勝利精密	1,577,103	41,036,220.06
GQY 視訊	1,217,228	40,923,205.36
燕京啤酒	4,717,660	38,826,341.80
寧夏建材	3,447,617	38,613,310.40
長園集團	2,000,000	37,660,000.00
華英農業	2,834,010	37,437,272.10
中國平安	1,000,000	36,000,000.00

上工申貝	2,100,000	35,217,000.00
中國海誠	1,966,200	34,919,712.00
冀東水泥	3,199,945	34,879,400.50
美的集團	1,051,649	34,515,120.18
紫光股份	348,605	34,295,759.90
美克家居	2,167,740	33,860,098.80
金龍汽車	1,749,746	33,577,625.74
曙光股份	2,122,150	32,575,002.50
諾普信	1,551,047	29,749,081.46
民生銀行	3,000,000	28,920,000.00
建設銀行	4,999,966	28,899,803.48
上海醫藥	1,399,915	27,872,307.65
長電科技	1,162,200	26,660,868.00
聚龍股份	799,990	25,751,678.10
TCL 集團	6,000,000	25,560,000.00
中國巨石	999,947	25,408,653.27
當升科技	610,372	23,700,744.76
上海佳豪	861,711	22,921,512.60
海立美達	1,457,120	22,337,649.60
歐菲光	699,961	21,712,790.22
安琪酵母	699,684	21,284,387.28
史坦萊	614,469	19,988,676.57
上海貝嶺	900,000	19,071,000.00
青島啤酒	499,905	16,596,846.00
香雪製藥	641,280	16,038,412.80
格力電器	700,000	15,645,000.00
申能股份	2,000,000	15,100,000.00
神霧環保	279,839	13,989,151.61
天華超淨	298,610	13,252,311.80
嶺南園林	299,902	13,165,697.80
小天鵝 A	535,314	12,847,536.00
保利地產	1,000,000	10,640,000.00
二六三	499,941	10,493,761.59
北大荒	635,545	9,361,577.85
舒泰神	261,100	9,253,384.00
浦發銀行	499,797	9,131,291.19
奧馬電器	100,000	8,330,000.00
杭鋼股份	1,000,000	8,110,000.00
高樂股份	455,711	7,988,613.83
湯臣倍健	199,901	7,696,188.50
華東醫藥	89,514	7,336,567.44
萬豐奧威	200,000	6,436,000.00
天奇股份	300,000	6,225,000.00

首航節能	199,918	6,097,499.00
澳洋科技	400,000	5,952,000.00
青島金王	184,900	5,759,635.00
黑牛食品	300,000	5,604,000.00
潤達醫療	49,978	5,126,743.24
東莞控股	353,300	4,486,910.00
南洋科技	200,000	4,076,000.00
海德股份	100,000	2,900,000.00
中安消	100,000	2,884,000.00
雙環傳動	98,300	2,624,610.00
青島海爾	217,276	2,533,438.16
盛通股份	50,000	2,037,000.00
索菲亞	36,819	1,586,898.90
華錄百納	37,721	1,342,867.60
聖農發展	57,600	1,266,624.00
中青旅	39,559	922,120.29
中科創達	6,560	918,465.60
華宇軟體	16,578	787,123.44
博敏電子	12,448	638,333.44
蘇大維格	16,060	412,581.40
七星電子	18,143	349,797.04
潤欣科技	7,248	299,632.32
三夫戶外	3,566	222,304.44
招商證券	8,732	189,484.40
光環新網	230	12,813.30
金證股份	252	12,395.88
通合科技	500	7,545.00
網宿科技	110	6,598.90
大商股份	90	4,646.70
捷成股份	165	3,960.00
同仁堂	80	3,568.80
天士力	87	3,560.04
用友網路	89	2,831.09
湘郵科技	53	2,080.25
空港股份	75	1,400.25
中成股份	51	1,246.44
奧康國際	35	1,176.70
健民集團	33	1,116.39
大智慧	87	1,115.34
國電南瑞	65	1,084.20
上汽集團	49	1,039.78
歌爾聲學	30	1,038.00
中國國貿	52	976.56

福建水泥	88	975.04
新國都	26	969.02
新華傳媒	72	859.68
航太機電	69	852.84
國機汽車	42	787.08
福能股份	44	756.36
太龍藥業	74	696.34
東材科技	67	627.79
亞威股份	32	509.12
濟川藥業	15	414.90
碧水源	7	362.39
長城汽車	21	252.84
東風科技	11	247.06
恒信移動	5	239.20
羚銳製藥	16	212.00
日發精機	6	158.70
伊利股份	8	131.44
合計		3,263,829,928.19
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
15 農發 13	6,200,000	620,682,000.00
15 農發 11	3,200,000	320,928,000.00
15 農發 16	2,800,000	280,644,000.00
09 國開 05	2,200,000	220,814,000.00
11 國開 21	2,200,000	220,242,000.00
15 國開 05	2,000,000	208,620,000.00
15 農發 03	1,800,000	180,360,000.00
11 國開 16	1,600,000	165,648,000.00
15 國開 02	1,600,000	160,192,000.00
14 國開 28	1,000,000	105,410,000.00
12 農發 01	1,000,000	103,510,000.00
12 農發 12	1,000,000	103,270,000.00
15 國開 01	1,000,000	102,480,000.00
11 進出 16	900,000	91,152,000.00
11 付息國債 24	600,000	62,526,000.00
15 進出 04	500,000	52,135,000.00
11 中化工 MTN2	500,000	50,985,000.00
10 國開 15	450,000	45,468,000.00
14 國開 22	400,000	44,996,000.00
12 石化 01	439,470	44,957,781.00
15 農發 04	400,000	41,676,000.00

14 國開 29	300,000	32,208,000.00
13 國網 MTN1	300,000	31,344,000.00
13 航機電 MTN1	300,000	31,224,000.00
12 進出 03	300,000	31,089,000.00
14 國開 01	300,000	30,954,000.00
11 首鋼 MTN1	300,000	30,567,000.00
11 進出 18	300,000	30,408,000.00
13 國開 12	300,000	30,282,000.00
15 進出 01	300,000	30,027,000.00
08 國開 16	250,000	26,497,500.00
13 渝保稅 MTN1	200,000	21,012,000.00
13 鎮國投 MTN2	200,000	20,942,000.00
12 滇建工 MTN1	200,000	20,854,000.00
11 首鋼 MTN2	200,000	20,352,000.00
11 蘇國資 MTN2	200,000	20,298,000.00
11 新中泰 MTN1	200,000	20,276,000.00
13 吉利 MTN1	200,000	20,188,000.00
12 蕪湖建投債 01	150,000	16,845,000.00
13 馬城投 MTN001	100,000	10,804,000.00
08 國網債 02	100,000	10,601,000.00
11 農發 02	100,000	10,003,000.00
09 蓉工投	40,000	4,046,800.00
合計		3,727,518,081.00
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(100%)		
13 隧道 02	100,000	5,195,000.00
合計		5,195,000.00
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		99,000,169.50
交易所市場買入返售金融資產		100,000,000.00
合計		199,000,169.50
總投資資產		7,195,543,178.69
銀行存款和結算備付金		450,089,685.24
其他各項資產		163,398,062.45
合計		7,809,030,926.38

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	占基金資產淨值的比例 (%) 2015 年 12 月 31 日	占基金資產淨值的比例 (%) 2014 年 12 月 31 日
1	股票	42.91	60.69
2	債券	49.01	29.00
3	資產支持證券	0.07	0.09
4	買入返售金融資產	2.62	4.34