

華夏回報證券投資基金 2016 年年度報告

2016 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：二〇一七年三月二十九日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2016 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 年度報告一併閱覽。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇一七年三月二十九日

§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 2017 年 3 月 27 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）為本基金作出了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄.....	1
§2 基金簡介.....	3
§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況.....	4
3.1 主要會計資料和財務指標.....	4
3.2 基金淨值表現.....	5
3.3 過去三年基金的利潤分配情況.....	6
§4 管理人報告.....	6
§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.....	17
7.3 所有者權益（基金淨值）變動表.....	18
7.4 報表附註.....	19
§8 投資組合報告.....	45
8.1 期末基金資產組合情況.....	45
8.2 期末按行業分類的股票投資組合.....	46
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明細.....	46
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動.....	50
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合.....	52
8.6 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明細.....	52
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明細.....	52
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明細.....	53
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明細.....	53
8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明.....	53
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明.....	53
8.12 投資組合報告附註.....	53
§9 基金份額持有人資訊.....	54
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構.....	54
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況.....	54
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.....	55
§10 開放式基金份額變動.....	55
§11 重大事件揭示.....	55
§12 備查文件目錄.....	60
§13 補充披露.....	62

§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	5,931,077,616.27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
信息披露 負責人	姓名	張靜	王永民
	聯絡電話	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）	北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層 01-12 室
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、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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已實現收益	-71,543,169.09	2,205,592,745.92	1,734,219,560.47
本期利潤	-262,031,257.05	2,025,942,355.08	637,083,993.13
加權平均基金份額本期利潤	-0.0424	0.3112	0.0790
本期加權平均淨值利潤率	-3.65%	23.78%	5.96%
本期基金份額淨值增長率	-3.58%	22.20%	7.10%
3.1.2 期末資料和指標	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利潤	15,731,841.97	83,429,821.15	178,214,741.44
期末可供分配基金份額利潤	0.0027	0.0135	0.0252
期末基金資產淨值	7,023,985,211.05	7,605,525,422.28	9,131,442,606.54
期末基金份額淨值	1.184	1.228	1.293
3.1.3 累計期末指標	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份額累計淨值增長率	772.28%	804.69%	640.31%

註：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平要低於所列數字。

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	-0.92%	0.38%	0.38%	0.00%	-1.30%	0.38%
過去六個月	1.89%	0.40%	0.75%	0.00%	1.14%	0.40%
過去一年	-3.58%	0.85%	1.50%	0.00%	-5.08%	0.85%
過去三年	26.20%	0.91%	6.59%	0.00%	19.61%	0.91%
過去五年	68.09%	0.86%	12.83%	0.00%	55.26%	0.86%
自基金合同生效起至今	772.28%	1.02%	36.18%	0.00%	736.10%	1.02%

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

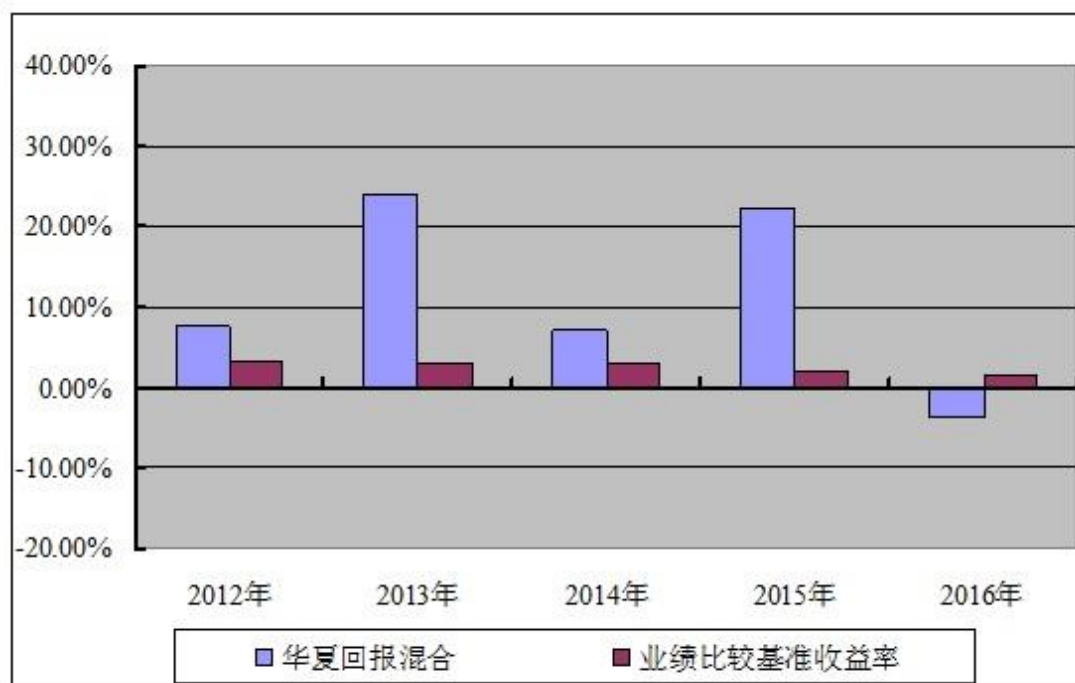
(2003年9月5日至2016年12月31日)



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
2016年	-	-	-	-	-
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	-
合計	5.800	1,491,554,583.82	2,601,858,350.09	4,093,412,933.91	-

§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、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、首批基本養老保險基金投資管理人資格，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 12 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 7，華夏醫療健康混合 A 及華夏興華混合 A 分別在 58 隻偏股型基金（股票上限 95%）中排名第 10 和第 13，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 12；固定收益類產品中，華夏理財 30 天債券在 38 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。

2016 年，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，2016 年，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和服務體驗：（1）改進業務流程，客戶可通過網上交易系統自助辦理退款、重置密碼、上傳換卡資料等業務，還可自助辦理資產證明和蓋章對帳單，業務處理更加高效便捷；（2）增加交易管道，與滴滴出行合作推出滴滴金桔寶理財，並上線華夏財富網上交易系統，增加直銷定投通等功能，為客

戶提供更多優惠便捷的理財管道，提高交易便利性；（3）開展“你定，我投”、“客戶個性化白皮書”、“2016 活期通年底曬帳單”、2016 北京馬拉松等系列宣傳活動，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。
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。
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。

註：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。

③根據本基金管理人發佈的《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》，自 2017 年 2 月 24 日起，代瑞亮先生不再擔任本基金基金經理。

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、事後分析和信息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

2016 年，國際方面，美國特朗普上台，對全球貨幣、商品和金融市場均產生重大影響，美元區經濟復蘇預期加強，美聯儲選擇在 12 月加息，且表述轉向鷹派，美國國債收益率顯著上升，美元指數大幅反彈。國內方面，宏觀經濟企穩復蘇，GDP 全年實現了 6.7% 的增長。價格指數方面，PPI 增速由負轉正，結束了四年的通縮局面，同時 CPI 溫和走高。地產行業迅速回暖，一線及部分二線城市房價快速上漲，但十月份地產調控以後，部分城市的成交量和價格都有所下降，調控在地產銷售環節的效果初步顯現。

金融市場方面，年初 A 股市場遭遇熔断和匯率貶值的雙重衝擊，指數大幅回檔，1 季度後開始震盪上行。商品市場經歷了五年的下跌後大幅反轉，主要工業品種價格大幅度上漲，成為 PPI 大幅超預期的原因之一，同時也帶動股票市場中商品類股票整體跑贏。4 季度國內債券市場遭遇了流動性危機，債券到期收益率全線上行。

報告期內，本基金著力實現可控回撤下的收益率。年初，本基金以低倉位元開局，主要配置了低估值的銀行、建築和消費醫藥類股票，之後隨著市場下跌逐漸提高了倉位，加倉方向主要集中在地產、建築、醫療、食品飲料、通訊、家電、環保等領域，獲得了一定收益。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.184 元，本報告期份額淨值增長率為-3.58%，同期業績比較基準增長率為 1.50%。

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 2017 年，我們認為市場仍將以震盪為主。國內經濟企穩回升、供給側改革逐步深入、國企改革試點等有利因素將給市場帶來一定結構性機會，但 IPO 加快發行、增發解禁數量增加等因素將給估值高的小股票帶來估值收縮壓力。

投資策略上，本基金將回避估值高的偽增長股票，重點選擇並持有增長與估值相匹配的優質股票，方向主要集中在建築、醫藥、食品飲料、環保、家電等行業。

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，公司制定了合規風險管理制度、風險隔離制度、員工違規違紀處理制度，修訂了保密管理制度和員工培訓制度，進一步完善合規制度建設；公司開展多種形式的合規培訓，重點加強了投資研究和基金銷售業務條線的合規教育，不斷提升員工的合規守法意識；強化事前事中合規風險管理，嚴格審核信息披露文件、基金宣傳推介材料，加強了對微信等新媒體宣傳材料的合規審核，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作出報告。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、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。

4.8 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，本基金於 2017 年 1 月 7 日刊登年度分紅公告，並於 2017 年 1 月中旬實施

年度利潤分配，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（註：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(2017)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 2016 年 12 月 31 日的資產負債表和 2016 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註。

6.1 管理層對財務報表的責任

編製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製財務報表，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不存在重大錯報獲取合理保證。

審計工作涉及實施審計程序，以獲取有關財務報表金額和披露的審計證據。選擇的審計程序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製和公允列報相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，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製，公允反映了華夏回報證券投資基金 2016 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2016 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 馬劍英

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層 01-12 室

2017 年 3 月 10 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：2016 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附註號	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款	7.4.7.1	869,268,334.17	438,027,605.72
結算備付金		10,364,439.33	12,062,079.52
存出保證金		721,066.66	2,955,841.07
交易性金融資產	7.4.7.2	6,056,179,451.29	6,996,543,009.19
其中：股票投資		3,363,977,888.68	3,263,829,928.19
基金投資		-	-
債券投資		2,668,646,893.30	3,727,518,081.00
資產支持證券投資		23,554,669.31	5,195,000.00
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	170,000,000.00	199,000,169.50
應收證券清算款		-	79,345,864.85
應收利息	7.4.7.5	53,319,228.74	70,957,661.53
應收股利		-	-
應收申購款		850,636.09	10,138,695.00
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.6	-	-
資產總計		7,160,703,156.28	7,809,030,926.38
負債和所有者權益	附註號	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		-	-
應付證券清算款		101,795,295.85	150,879,430.03
應付贖回款		6,679,272.57	9,941,723.72
應付管理人報酬		9,051,050.96	9,578,577.04
應付託管費		1,508,508.52	1,596,429.50
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用	7.4.7.7	16,980,768.89	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	7.4.7.8	624,550.28	1,127,468.33
負債合計		136,717,945.23	203,505,504.10
所有者權益：			
實收基金	7.4.7.9	5,931,077,616.27	6,191,477,535.36
未分配利潤	7.4.7.10	1,092,907,594.78	1,414,047,886.92
所有者權益合計		7,023,985,211.05	7,605,525,422.28
負債和所有者權益總計		7,160,703,156.28	7,809,030,926.38

註：報告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.184 元，基金份額總額 5,931,077,616.27 份。

7.2 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 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-110,876,249.03	2,219,139,644.16
1.利息收入		103,858,009.39	156,910,213.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,042,786.19	7,109,474.91
債券利息收入		96,553,841.98	145,561,656.77
資產支持證券利息收入		193,356.76	373,743.60
買入返售金融資產收入		1,068,024.46	3,865,337.85
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-25,667,882.52	2,234,791,861.16
其中：股票投資收益	7.4.7.12	-58,293,250.07	2,163,129,205.40
基金投資收益		-	-
債券投資收益	7.4.7.13	-6,272,536.20	19,418,338.91
資產支持證券投資收益	7.4.7.14	-	-
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	38,897,903.75	52,244,316.85
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.18	-190,488,087.96	-179,650,390.84
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	1,421,712.06	7,087,960.71
減：二、費用		151,155,008.02	193,197,289.08
1.管理人報酬		107,594,905.36	127,815,286.52
2.託管費		17,932,484.25	21,302,547.65
3.銷售服務費		-	-
4.交易費用	7.4.7.20	25,208,776.58	43,482,449.63
5.利息支出		724.59	161,185.91
其中：賣出回購金融資產支出		724.59	161,185.91
6.其他費用	7.4.7.21	418,117.24	435,819.37

三、利潤總額(虧損總額以“-”號填列)		-262,031,257.05	2,025,942,355.08
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤(淨虧損以“-”號填列)		-262,031,257.05	2,025,942,355.08

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：2016年1月1日至2016年12月31日

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至2016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)	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)	-	-262,031,257.05	-262,031,257.05
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)	-260,399,919.09	-59,109,035.09	-319,508,954.18
其中：1.基金申購款	708,791,240.33	108,992,981.68	817,784,222.01
2.基金贖回款	-969,191,159.42	-168,102,016.77	-1,137,293,176.19
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)	5,931,077,616.27	1,092,907,594.78	7,023,985,211.05
項目	上年度可比期間 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

報表附註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：

<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

7.4 報表附註

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》核準，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 會計報表的編製基礎

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《證券投資基金信息披露 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註 7.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編製。

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 2016 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2016 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

本基金會計年度為西曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 記帳基本貨幣

本基金的記帳基本貨幣為人民幣。

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；支付的價款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，單獨確認為應收專案。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準金分攤部分後的餘額。對於曾經實施份額拆分或折算的基金，由於基金份額拆分或折算引起的實收基金份額變動於基金份額拆分日或基金份額折算日根據拆分前或折算前的基金份額數及確定的拆分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 損益平準金

損益平準金包括已實現平準金和未實現平準金。已實現平準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。未實現平準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。損益平準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

本基金本報告期無會計估計變更。

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征增值稅試點的通知》、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》、財稅[2016]70 號《財政部、國家稅務總局關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》、財稅[2015]125 號《財政部、國家稅務總局、證監會關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》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、債券的差價收入免徵營業稅或增值稅，暫不徵收企業所得稅。

3、存款利息收入不徵收增值稅。

4、國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免徵增值稅。

5、對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。

6、對基金取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。其中對內地投資者取得上述收入按照 20% 代扣代繳個人所得稅，應納稅所得額按如下方式確認：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，暫免徵收個人所得稅；對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10% 的稅率代扣所得稅。

7、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。

8、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 重要財務報表專案的說明

7.4.7.1 銀行存款

單位：人民幣元

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

活期存款	869,268,334.17	438,027,605.72
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合計	869,268,334.17	438,027,605.72

7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日			
	成本	公允價值	公允價值變動	
股票	3,271,447,216.27	3,363,977,888.68	92,530,672.41	
貴金屬投資-金交所 黃金合約	-	-	-	
債券	交易所市場	343,642,356.35	338,913,393.30	-4,728,963.05
	銀行間市場	2,334,409,942.64	2,329,733,500.00	-4,676,442.64
	合計	2,678,052,298.99	2,668,646,893.30	-9,405,405.69
資產支持證券	23,554,669.31	23,554,669.31	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合計	5,973,054,184.57	6,056,179,451.29	83,125,266.72	
項目	上年度末 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	

7.4.7.3 衍生金融資產/負債

無。

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 2016 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	-	-
交易所市場買入返售金融資產	170,000,000.00	-
合計	170,000,000.00	-
項目	上年度末 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	-

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

7.4.7.5 應收利息

單位：人民幣元

項目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
應收活期存款利息	203,143.61	157,277.38
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	5,141.72	5,970.17
應收債券利息	52,855,239.21	70,697,948.32
應收買入返售證券利息	21,363.85	9,743.06
應收申購款利息	-	-
應收黃金合約拆借孳息	-	-
其他	234,340.35	86,722.60
合計	53,319,228.74	70,957,661.53

7.4.7.6 其他資產

無。

7.4.7.7 應付交易費用

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市場應付交易費用	16,971,566.33	30,298,457.82
銀行間市場應付交易費用	9,202.56	4,919.50
合計	16,980,768.89	30,303,377.32

7.4.7.8 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
應付券商交易單元保證金	500,000.00	750,000.00
應付贖回費	24,550.28	37,468.33
預提費用	100,000.00	340,000.00
合計	624,550.28	1,127,468.33

7.4.7.9 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12月31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	708,791,240.33	708,791,240.33
本期贖回(以“-”號填列)	-969,191,159.42	-969,191,159.42
本期末	5,931,077,616.27	5,931,077,616.27

註：2016年12月31日基金份額總額5,931,077,616.27份，其中A類基金份額5,921,462,205.68份，H類基金份額9,615,410.59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	83,429,821.15	1,330,618,065.77	1,414,047,886.92
本期利潤	-71,543,169.09	-190,488,087.96	-262,031,257.05
本期基金份額交易產生的變動數	3,845,189.91	-62,954,225.00	-59,109,035.09
其中：基金申購款	-9,752,702.39	118,745,684.07	108,992,981.68
基金贖回款	13,597,892.30	-181,699,909.07	-168,102,016.77
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	15,731,841.97	1,077,175,752.81	1,092,907,594.78

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
活期存款利息收入	5,889,588.75	6,847,868.34
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	128,417.66	209,359.43
其他	24,779.78	52,247.14
合計	6,042,786.19	7,109,474.91

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
賣出股票成交總額	8,735,128,507.23	16,303,523,774.59
減：賣出股票成本總額	8,793,421,757.30	14,140,394,569.19
買賣股票差價收入	-58,293,250.07	2,163,129,205.40

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
賣出債券(、債轉股及債券到期兌付)成交總額	3,343,385,011.89	3,285,501,904.02

減：賣出債券（、債轉股及債券到期兌付）成本總額	3,278,769,386.20	3,218,098,459.77
減：應收利息總額	70,888,161.89	47,985,105.34
買賣債券差價收入	-6,272,536.20	19,418,338.91

7.4.7.14 資產支持證券投資收益

無。

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

無。

7.4.7.15.2 貴金屬投資——買賣貴金屬差價收入

無。

7.4.7.15.3 貴金屬投資——贖回差價收入

無。

7.4.7.15.4 貴金屬投資——申購差價收入

無。

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

無。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

無。

7.4.7.17 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
股票投資產生的股利收益	38,897,903.75	52,244,316.85

基金投資產生的股利收益	-	-
合計	38,897,903.75	52,244,316.85

7.4.7.18 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
1.交易性金融資產	-190,488,087.96	-179,650,390.84
——股票投資	-129,185,164.85	-209,382,652.91
——債券投資	-61,302,923.11	29,732,262.07
——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	-190,488,087.96	-179,650,390.84

7.4.7.19 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
基金贖回費收入	1,421,712.06	7,087,960.71
其他	-	-
合計	1,421,712.06	7,087,960.71

7.4.7.20 交易費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
交易所市場交易費用	25,189,301.58	43,451,074.63
銀行間市場交易費用	19,475.00	31,375.00
合計	25,208,776.58	43,482,449.63

7.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015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	40,917.24	59,169.37
銀行間帳戶維護費	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	650.00
合計	418,117.24	435,819.37

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

7.4.8.2.1 根據本基金管理人於 2017 年 1 月 7 日發佈的分紅公告，本基金向 2017 年 1 月 11 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.020 元。

7.4.8.2.2 根據本基金管理人於 2017 年 3 月 21 日發佈的分紅公告，本基金向 2017 年 3 月 23 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

7.4.8.2.3 財政部、國家稅務總局於 2017 年 1 月 6 日頒佈的《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》(財稅[2017]2 號)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以後，資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人，按照現行規定繳納增值稅。對資管產品在 2017 年 7 月 1 日前運營過程中發生的增值稅應稅行為，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已納稅額從資管產品管理人以後月份的增值稅應納稅額中抵減。資管產品運營過程中發生增值稅應稅行為的具體徵收管理辦法，由國家稅務總局另行制定。上

述稅收政策對本基金截至本財務報表批准報出日止的財務狀況和經營成果無影響。

上述通知是對財政部、國家稅務總局於 2016 年 12 月 21 日頒佈的《關於明確金融 房地產開發 教育輔助服務等增值稅政策的通知》(財稅[2016]140 號)的補充，該通知要求資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人，自 2016 年 5 月 1 日起執行。

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
中國銀行股份有限公司(“中國銀行”)	基金託管人
中信證券股份有限公司(“中信證券”)	基金管理人的股東
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

註：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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期間 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	8,008,272,447.96	45.12%	699,309,336.76	2.47%

7.4.10.1.2 權證交易

無。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期間 2015年1月1日至 2015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%

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 2016年1月1日至 2016年12月31日		上年度可比期間 2015年1月1日至 2015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	1,099,600,000.00	73.03%	2,000,000,000.00	45.44%

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 2016年1月1日至2016年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金 總額的比例	期末應付佣金餘 額	佔期末應付佣金 總額的比例
中信證券	6,430,704.63	43.22%	1,835,961.44	10.82%
關聯方名稱	上年度可比期間 2015年1月1日至2015年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金 總額的比例	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%

註：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和市場訊息服務。

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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
當期發生的基金應支付的管理費	107,594,905.36	127,815,286.52
其中：支付銷售機構的客戶維護費	9,511,128.92	11,098,825.64

註：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專案。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期間 2015年1月1日至 2015年12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	17,932,484.25	21,302,547.65

註：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

無。

7.4.10.4 各關聯方投資本基金的狀況

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狀況

份額單位：份

項目	本期	上年度可比期間
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
期初持有的基金份額	16,278,317.76	-
期間申購/買入總份額	-	16,278,317.76
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	16,278,317.76
期末持有的基金份額佔基金 總份額比例	0.27%	0.26%

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

無。

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		上年度可比期間	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	869,268,334.17	5,889,588.75	438,027,605.72	6,847,868.34

註：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

無。

7.4.11 利潤分配情況

本基金本報告期無利潤分配事項。

註：①根據本基金管理人於 2017 年 1 月 7 日發佈的分紅公告，本基金向 2017 年 1 月 11 日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.020 元。

②根據本基金管理人於 2017 年 3 月 21 日發佈的分紅公告，本基金向 2017 年 3 月 23

日在本基金登記結算機構登記在冊的基金份額持有人按每 10 份基金份額派發紅利 0.150 元。

7.4.12 期末（2016 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

金額單位：人民幣元

7.4.12.1.1 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
601375	中原證券	2016-12-20	2017-01-03	新發流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺電子	2016-12-28	2017-01-06	新發流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鳥	2016-12-29	2017-01-09	新發流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	賽托生物	2016-12-29	2017-01-06	新發流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然氣	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽飾	2016-12-27	2017-01-05	新發流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龍股份	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天鐵股份	2016-12-28	2017-01-05	新發流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	華統股份	2016-12-29	2017-01-10	新發流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新發流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	華正新材	2016-12-26	2017-01-03	新發流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交運	2016-12-27	2017-01-05	新發流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美聯新材	2016-12-26	2017-01-04	新發流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	萬里馬	2016-12-30	2017-01-10	新發流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新發流	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

				通受限						
--	--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--

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
300271	華宇軟體	2016-12-19	重大事項	17.45	-	-	300,000	5,575,771.00	5,235,000.00	-
002400	省廣股份	2016-11-28	重大事項	13.79	-	-	260,000	3,467,859.99	3,585,400.00	-
603986	兆易創新	2016-09-19	重大事項	177.97	2017-03-13	195.77	99	2,302.74	17,619.03	-
600151	航太機電	2016-11-11	重大事項	10.97	-	-	69	594.54	756.93	-

註：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

無。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

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、法律部、合規部、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，參考壓力測試結果，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 信貸風險

信貸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，債券發行人信貸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貸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貸風險。

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

理人通過監測組合敏感性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久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 2016年12月31日	1年以內	1-5年	5年以上	合計
銀行存款	869,268,334.17	-	-	869,268,334.17
結算備付金	10,364,439.33	-	-	10,364,439.33
結算保證金	721,066.66	-	-	721,066.66
債券投資	874,311,893.30	1,101,987,000.00	692,348,000.00	2,668,646,893.30
資產支持證券	23,554,669.31	-	-	23,554,669.31
買入返售金融資產	170,000,000.00	-	-	170,000,000.00
應收直銷申購款	8,678.68	-	-	8,678.68
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	-	-	-	-

註：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 （2016 年 12 月 31 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 個基點	18,248,667.64	15,298,874.50
	利率上升 25 個基點	-17,961,443.38	-15,188,059.58

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 2016 年 12 月 31 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	3,363,977,888.68	47.89	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	3,363,977,888.68	47.89	3,263,829,928.19	42.91

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。		
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 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	+5%	136,089,725.49	163,109,900.66
	-5%	-136,089,725.49	-163,109,900.66

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 2016 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 3,387,532,557.99 元，第二層次的餘額為 2,668,646,893.30 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。）

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	3,363,977,888.68	46.98
	其中：股票	3,363,977,888.68	46.98
2	固定收益投資	2,692,201,562.61	37.60

	其中：債券	2,668,646,893.30	37.27
	資產支持證券	23,554,669.31	0.33
3	貴金屬投資	-	-
4	金融衍生品投資	-	-
5	買入返售金融資產	170,000,000.00	2.37
	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	879,632,773.50	12.28
7	其他各項資產	54,890,931.49	0.77
8	合計	7,160,703,156.28	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	-	-
B	採礦業	34,199.60	0.00
C	製造業	2,013,316,326.03	28.66
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	194,440,700.14	2.77
E	建築業	310,504,521.42	4.42
F	批發和零售業	412,230,722.01	5.87
G	交通運輸、倉儲和郵政業	9,657.16	0.00
H	住宿和餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	9,160,182.19	0.13
J	金融業	249,411,606.20	3.55
K	房地產業	102,253,032.58	1.46
L	租賃和商務服務業	34,021,309.05	0.48
M	科學研究和技術服務業	-	-
N	水利、環境和公共設施管理業	28,700,822.30	0.41
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	9,894,810.00	0.14
S	綜合	-	-
	合計	3,363,977,888.68	47.89

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明細

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	13,542,129	310,385,596.68	4.42
2	000333	美的集團	10,126,250	285,256,462.50	4.06
3	600276	恒瑞醫藥	6,128,502	278,846,841.00	3.97
4	300156	神霧環保	7,649,493	191,313,819.93	2.72
5	000963	華東醫藥	2,637,253	190,066,823.71	2.71
6	002043	兔寶寶	14,031,177	162,340,717.89	2.31
7	601607	上海醫藥	6,736,606	131,768,013.36	1.88
8	600036	招商銀行	6,970,262	122,676,611.20	1.75
9	000786	北新建材	11,279,452	116,065,561.08	1.65
10	600015	華夏銀行	10,527,900	114,227,715.00	1.63
11	600566	濟川藥業	3,043,063	95,126,149.38	1.35
12	002572	索菲亞	1,573,005	85,193,950.80	1.21
13	600056	中國醫藥	3,634,306	69,160,843.18	0.98
14	600674	川投能源	7,847,872	68,276,486.40	0.97
15	600060	海信電器	3,972,059	68,001,650.08	0.97
16	601588	北辰實業	15,732,056	65,602,673.52	0.93
17	000501	鄂武商 A	3,053,291	59,600,240.32	0.85
18	600872	中炬高新	4,183,700	58,906,496.00	0.84
19	002595	豪邁科技	2,354,587	49,564,056.35	0.71
20	600525	長園集團	3,411,619	47,592,085.05	0.68
21	600900	長江電力	3,728,600	47,204,076.00	0.67
22	600452	涪陵電力	1,052,256	43,858,030.08	0.62
23	600567	山鷹紙業	11,644,000	42,151,280.00	0.60
24	300296	利亞德	1,087,626	36,674,748.72	0.52
25	002508	老闆電器	970,949	35,730,923.20	0.51
26	600885	宏發股份	1,098,900	35,109,855.00	0.50
27	600886	國投電力	5,257,000	35,064,190.00	0.50
28	002304	洋河股份	460,297	32,496,968.20	0.46
29	000820	神霧節能	1,047,300	30,266,970.00	0.43
30	601012	隆基股份	2,004,601	26,841,607.39	0.38
31	600521	華海藥業	1,103,688	24,314,246.64	0.35
32	603766	隆鑫通用	1,136,712	23,620,875.36	0.34
33	000729	燕京啤酒	3,208,453	22,298,748.35	0.32
34	600519	貴州茅台	64,954	21,704,379.10	0.31
35	601933	永輝超市	4,000,000	19,640,000.00	0.28

36	000418	小天鵝 A	549,235	17,751,275.20	0.25
37	600600	青島啤酒	582,282	17,142,382.08	0.24
38	000888	峨眉山 A	1,409,500	16,829,430.00	0.24
39	002050	三花智控	1,500,000	16,560,000.00	0.24
40	300124	匯川技術	799,930	16,262,576.90	0.23
41	601888	中國國旅	355,000	15,407,000.00	0.22
42	000938	紫光股份	261,500	15,007,485.00	0.21
43	600007	中國國貿	753,200	13,007,764.00	0.19
44	601318	中國平安	350,000	12,400,500.00	0.18
45	000069	華僑城 A	1,708,114	11,871,392.30	0.17
46	600138	中青旅	551,165	11,557,930.05	0.16
47	002064	華峰氨綸	2,070,500	11,367,045.00	0.16
48	600132	重慶啤酒	612,552	11,301,584.40	0.16
49	600297	廣匯汽車	1,300,000	11,128,000.00	0.16
50	002739	萬達院線	183,000	9,894,810.00	0.14
51	600285	羚銳製藥	755,500	9,640,180.00	0.14
52	600048	保利地產	983,441	8,978,816.33	0.13
53	002317	眾生藥業	708,000	8,743,800.00	0.12
54	600076	康欣新材	900,000	8,451,000.00	0.12
55	600622	嘉寶集團	562,257	8,102,123.37	0.12
56	600201	生物股份	245,600	7,758,504.00	0.11
57	600104	上汽集團	300,000	7,035,000.00	0.10
58	600208	新湖中寶	1,577,321	6,561,655.36	0.09
59	300271	華宇軟體	300,000	5,235,000.00	0.07
60	600843	上工申貝	229,300	4,315,426.00	0.06
61	300310	宜通世紀	149,328	3,634,643.52	0.05
62	002037	久聯發展	209,534	3,587,222.08	0.05
63	002400	省廣股份	260,000	3,585,400.00	0.05
64	000858	五糧液	100,000	3,448,000.00	0.05
65	002127	南極電商	300,000	3,444,000.00	0.05
66	000568	瀘州老窖	100,000	3,300,000.00	0.05
67	002203	海亮股份	300,000	2,418,000.00	0.03
68	000338	潍柴動力	237,159	2,362,103.64	0.03
69	002372	偉星新材	151,316	2,334,805.88	0.03
70	000423	東阿阿膠	42,683	2,299,333.21	0.03
71	002048	寧波華翔	100,000	2,214,000.00	0.03
72	600996	貴廣網路	12,500	234,875.00	0.00

73	601163	三角輪胎	3,262	110,744.90	0.00
74	601375	中原證券	26,695	106,780.00	0.00
75	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.00
76	603298	杭叉集團	3,641	88,403.48	0.00
77	603228	景旺電子	3,491	80,851.56	0.00
78	603878	武進不鏽	2,000	80,000.00	0.00
79	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
80	603577	匯金通	2,460	69,642.60	0.00
81	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
82	603877	太平鳥	3,180	67,734.00	0.00
83	603585	蘇利股份	941	65,606.52	0.00
84	300583	賽托生物	1,582	63,738.78	0.00
85	002827	高爭民爆	2,059	60,905.22	0.00
86	002826	易明醫藥	2,181	57,316.68	0.00
87	603416	信捷電氣	1,076	53,886.08	0.00
88	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
89	603559	中通國脈	899	48,447.11	0.00
90	002833	弘亞數控	2,743	48,331.66	0.00
91	603389	亞振家居	1,963	47,327.93	0.00
92	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
93	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
94	603689	皖天然氣	4,818	37,917.66	0.00
95	300582	英飛特	1,359	35,157.33	0.00
96	002828	貝肯能源	886	34,199.60	0.00
97	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
98	603708	家家悅	874	27,644.62	0.00
99	002818	富森美	460	26,979.00	0.00
100	002835	同為股份	1,126	24,220.26	0.00
101	603035	常熟汽飾	2,316	24,179.04	0.00
102	603266	天龍股份	1,562	22,852.06	0.00
103	300587	天鐵股份	1,438	20,290.18	0.00
104	603823	百合花	562	18,399.88	0.00
105	603986	兆易創新	99	17,619.03	0.00
106	603929	亞翔集成	2,193	15,592.23	0.00
107	603928	興業股份	470	13,089.50	0.00
108	002840	華統股份	1,814	11,881.70	0.00
109	002813	路暢科技	216	10,981.44	0.00

110	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
111	603186	華正新材	1,874	10,063.38	0.00
112	603032	德新交運	1,628	9,458.68	0.00
113	300586	美聯新材	1,006	9,355.80	0.00
114	300591	萬里馬	2,397	7,358.79	0.00
115	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
116	603033	三維股份	60	3,094.20	0.00
117	603319	湘油泵	16	904.00	0.00
118	600151	航太機電	69	756.93	0.00
119	300383	光環新網	16	399.36	0.00
120	600270	外運發展	12	198.48	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 名的股票明細

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	000333	美的集團	323,146,221.61	4.25
2	600276	恒瑞醫藥	280,240,126.58	3.68
3	002051	中工國際	275,236,225.06	3.62
4	000963	華東醫藥	222,683,187.10	2.93
5	300017	網宿科技	215,317,651.18	2.83
6	601012	隆基股份	189,224,123.17	2.49
7	002043	兔寶寶	181,632,512.64	2.39
8	300156	神霧環保	173,739,819.27	2.28
9	600266	北京城建	143,535,459.41	1.89
10	600036	招商銀行	142,721,842.29	1.88
11	601668	中國建築	138,124,236.55	1.82
12	600376	首開股份	132,847,185.95	1.75
13	601607	上海醫藥	129,415,982.19	1.70
14	600015	華夏銀行	127,947,077.64	1.68
15	000786	北新建材	125,144,630.52	1.65
16	600208	新湖中寶	123,676,879.27	1.63
17	000423	東阿阿膠	118,861,741.30	1.56
18	600303	曙光股份	108,725,078.76	1.43
19	601021	春秋航空	103,970,473.51	1.37

20	600566	濟川藥業	100,747,570.48	1.32
----	--------	------	----------------	------

註：“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 名的股票明細

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	388,161,430.32	5.10
2	300017	網宿科技	240,497,606.64	3.16
3	601012	隆基股份	194,939,952.00	2.56
4	002051	中工國際	187,940,131.36	2.47
5	600036	招商銀行	185,944,735.56	2.44
6	600612	老鳳祥	172,890,556.66	2.27
7	601668	中國建築	163,771,098.10	2.15
8	600376	首開股份	150,844,382.22	1.98
9	600266	北京城建	144,774,727.59	1.90
10	600303	曙光股份	137,062,522.56	1.80
11	600208	新湖中寶	123,515,448.12	1.62
12	002662	京威股份	113,343,462.99	1.49
13	600004	白雲機場	95,021,834.46	1.25
14	601021	春秋航空	93,382,820.92	1.23
15	601186	中國鐵建	90,234,076.37	1.19
16	002092	中泰化學	88,333,356.30	1.16
17	601318	中國平安	87,948,203.07	1.16
18	600060	海信電器	85,967,856.74	1.13
19	600398	海瀾之家	83,972,737.50	1.10
20	000938	紫光股份	83,931,058.85	1.10

註：“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	9,022,754,882.64
賣出股票收入（成交）總額	8,735,128,507.23

註：“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	356,751,000.00	5.08
2	央行票據	-	-
3	金融債券	2,108,807,000.00	30.02
	其中：政策性金融債	2,108,807,000.00	30.02
4	企業債券	70,646,893.30	1.01
5	企業短期融資券	-	-
6	中期票據	132,442,000.00	1.89
7	可轉債（可交換債）	-	-
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	2,668,646,893.30	37.99

8.6 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明細

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	160414	16 農發 14	2,900,000	289,565,000.00	4.12
2	140900	16 上海 09	2,500,000	246,400,000.00	3.51
3	150205	15 國開 05	2,000,000	199,520,000.00	2.84
4	110216	11 國開 16	1,600,000	161,920,000.00	2.31
5	160408	16 農發 08	1,600,000	154,208,000.00	2.20

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明細

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	142007	花唄 03A1	220,000	21,775,669.31	0.31

2	123501	13 隧道 02	100,000	1,779,000.00	0.03
---	--------	----------	---------	--------------	------

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明細

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明細

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明細

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明細

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 投資組合報告附註

8.12.1 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，或在報告編製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	721,066.66
2	應收證券清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	53,319,228.74
5	應收申購款	850,636.09
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	54,890,931.49

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

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 投資組合報告附註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
277,969	21,337.19	30,287,663.06	0.51%	5,900,789,953.21	99.49%

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	2,517,977.88	0.04%
------------------	--------------	-------

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	50~100
本基金基金經理持有本開放式基金	50~100

§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	6,191,477,535.36
本報告期基金總申購份額	708,791,240.33
減：本報告期基金總贖回份額	969,191,159.42
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	5,931,077,616.27

§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

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。

2016 年 12 月，郭德秋先生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。

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（特殊普通合夥）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 9 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、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。

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	
中信證券	3	8,008,272,447.96	45.12%	6,430,704.63	43.22%	-
中國銀河證券	1	1,571,607,656.10	8.85%	1,463,639.97	9.84%	-
長江證券	1	1,427,648,243.15	8.04%	1,329,569.92	8.94%	-
廣發證券	1	1,349,888,961.60	7.60%	1,257,149.03	8.45%	-
國都證券	1	1,061,727,506.14	5.98%	776,440.45	5.22%	-
西南證券	1	1,029,475,651.24	5.80%	752,854.82	5.06%	-
川財證券	1	1,004,849,671.02	5.66%	734,844.73	4.94%	-
中金公司	1	900,852,814.54	5.08%	838,964.13	5.64%	-
安信證券	1	734,676,517.51	4.14%	684,203.44	4.60%	-
國泰君安證券	1	634,563,723.81	3.57%	590,969.76	3.97%	-
瑞銀證券	1	27,221,470.30	0.15%	19,907.11	0.13%	-

註：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和研究實力進行評估，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，本基金還選擇了東方證券、海通證券、信達證券、民族證券、興業證券、中銀國際證券、申萬巨集源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，南京證券的交易單元為本基金本期剔除的交易單元，本期沒有新增的券商交易單元。

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
中信證券	-	-	1,099,600,000.00	73.03%
長江證券	-	-	6,000,000.00	0.40%
廣發證券	-	-	300,000,000.00	19.93%
川財證券	-	-	100,000,000.00	6.64%
申萬宏源證券	321,600,669.31	100.00%	-	-

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
18	華夏基金管理有限公司公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-07-02
19	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	2016-07-02
20	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增珠海盈米財富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	2016-07-07
21	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富濟財富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	2016-08-17
22	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增乾道金融資訊服務（北京）有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-08-18
23	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市金斧子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	2016-08-19
24	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增大泰金石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	2016-08-31
25	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	2016-09-20
26	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萬得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	2016-10-20
27	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增中證金牛（北京）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	2016-10-25
28	關於華夏基金管理有限公司旗下部分開放式基金在中國中投證券有限責任公司開通申購、贖回等業務的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-01
29	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增泰誠財富基金銷售（大連）有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-02
30	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增青島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	2016-11-09

31	華夏基金管理有限公司關於旗下部分開放式基金新增奕豐金融服務（深圳）有限公司為代銷機構的公告	中國證監會指定報刊及網站	2016-11-16
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長量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	2016-11-16
33	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	2016-11-18
34	關於旗下部分開放式基金新增北京新浪倉石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	2016-12-08
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植信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	2016-12-22
36	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蛋捲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	2016-12-23

§12 備查文件目錄

12.1 備查文件目錄

12.1.1 中國證監會核準基金募集的文件；

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。在支付手續費後，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

二〇一七年三月二十九日

§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%)		
中工國際	13,542,129	310,385,596.68
美的集團	10,126,250	285,256,462.50
恒瑞醫藥	6,128,502	278,846,841.00
神霧環保	7,649,493	191,313,819.93
華東醫藥	2,637,253	190,066,823.71
兔寶寶	14,031,177	162,340,717.89
上海醫藥	6,736,606	131,768,013.36
招商銀行	6,970,262	122,676,611.20
北新建材	11,279,452	116,065,561.08
華夏銀行	10,527,900	114,227,715.00
濟川藥業	3,043,063	95,126,149.38
索菲亞	1,573,005	85,193,950.80
中國醫藥	3,634,306	69,160,843.18
川投能源	7,847,872	68,276,486.40
海信電器	3,972,059	68,001,650.08
北辰實業	15,732,056	65,602,673.52
鄂武商 A	3,053,291	59,600,240.32
中炬高新	4,183,700	58,906,496.00
豪邁科技	2,354,587	49,564,056.35
長園集團	3,411,619	47,592,085.05
長江電力	3,728,600	47,204,076.00
涪陵電力	1,052,256	43,858,030.08
山鷹紙業	11,644,000	42,151,280.00
利亞德	1,087,626	36,674,748.72
老闆電器	970,949	35,730,923.20
宏發股份	1,098,900	35,109,855.00
國投電力	5,257,000	35,064,190.00
洋河股份	460,297	32,496,968.20
神霧節能	1,047,300	30,266,970.00
隆基股份	2,004,601	26,841,607.39
華海藥業	1,103,688	24,314,246.64
隆鑫通用	1,136,712	23,620,875.36
燕京啤酒	3,208,453	22,298,748.35
貴州茅台	64,954	21,704,379.10

永輝超市	4,000,000	19,640,000.00
小天鵝 A	549,235	17,751,275.20
青島啤酒	582,282	17,142,382.08
峨眉山 A	1,409,500	16,829,430.00
三花智控	1,500,000	16,560,000.00
匯川技術	799,930	16,262,576.90
中國國旅	355,000	15,407,000.00
紫光股份	261,500	15,007,485.00
中國國貿	753,200	13,007,764.00
中國平安	350,000	12,400,500.00
華僑城 A	1,708,114	11,871,392.30
中青旅	551,165	11,557,930.05
華峰氨綸	2,070,500	11,367,045.00
重慶啤酒	612,552	11,301,584.40
廣匯汽車	1,300,000	11,128,000.00
萬達院線	183,000	9,894,810.00
羚銳製藥	755,500	9,640,180.00
保利地產	983,441	8,978,816.33
眾生藥業	708,000	8,743,800.00
康欣新材	900,000	8,451,000.00
嘉寶集團	562,257	8,102,123.37
生物股份	245,600	7,758,504.00
上汽集團	300,000	7,035,000.00
新湖中寶	1,577,321	6,561,655.36
華宇軟體	300,000	5,235,000.00
上工申貝	229,300	4,315,426.00
宜通世紀	149,328	3,634,643.52
久聯發展	209,534	3,587,222.08
省廣股份	260,000	3,585,400.00
五糧液	100,000	3,448,000.00
南極電商	300,000	3,444,000.00
瀘州老窖	100,000	3,300,000.00
海亮股份	300,000	2,418,000.00
濰柴動力	237,159	2,362,103.64
偉星新材	151,316	2,334,805.88
東阿阿膠	42,683	2,299,333.21
寧波華翔	100,000	2,214,000.00
貴廣網路	12,500	234,875.00
三角輪胎	3,262	110,744.90
中原證券	26,695	106,780.00
森特股份	4,293	103,332.51
杭叉集團	3,641	88,403.48
景旺電子	3,491	80,851.56

武進不鏽	2,000	80,000.00
比音勒芬	1,158	70,290.60
匯金通	2,460	69,642.60
日月股份	1,652	68,805.80
太平鳥	3,180	67,734.00
蘇利股份	941	65,606.52
賽托生物	1,582	63,738.78
高爭民爆	2,059	60,905.22
易明醫藥	2,181	57,316.68
信捷電氣	1,076	53,886.08
如通股份	2,114	51,771.86
中通國脈	899	48,447.11
弘亞數控	2,743	48,331.66
亞振家居	1,963	47,327.93
永吉股份	3,869	42,675.07
元祖股份	2,241	39,665.70
皖天然氣	4,818	37,917.66
英飛特	1,359	35,157.33
貝肯能源	886	34,199.60
浙江仙通	924	29,059.80
家家悅	874	27,644.62
富森美	460	26,979.00
同為股份	1,126	24,220.26
常熟汽飾	2,316	24,179.04
天龍股份	1,562	22,852.06
天鐵股份	1,438	20,290.18
百合花	562	18,399.88
兆易創新	99	17,619.03
亞翔集成	2,193	15,592.23
興業股份	470	13,089.50
華統股份	1,814	11,881.70
路暢科技	216	10,981.44
道恩股份	681	10,405.68
華正新材	1,874	10,063.38
德新交運	1,628	9,458.68
美聯新材	1,006	9,355.80
萬里馬	2,397	7,358.79
熙菱信息	1,380	6,817.20
三維股份	60	3,094.20
湘油泵	16	904.00
航太機電	69	756.93
光環新網	16	399.36
外運發展	12	198.48

合計		3,363,977,888.68
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
16 農發 14	2,900,000	289,565,000.00
16 上海 09	2,500,000	246,400,000.00
15 國開 05	2,000,000	199,520,000.00
11 國開 16	1,600,000	161,920,000.00
16 農發 08	1,600,000	154,208,000.00
16 國開 09	1,400,000	139,860,000.00
14 國開 28	1,000,000	102,370,000.00
12 農發 01	1,000,000	100,680,000.00
15 國開 01	1,000,000	100,460,000.00
12 農發 12	1,000,000	100,380,000.00
16 進出 08	1,000,000	99,440,000.00
16 國開 07	1,000,000	97,020,000.00
16 進出 04	900,000	89,865,000.00
16 國開 04	700,000	69,979,000.00
11 付息國債 24	600,000	61,956,000.00
15 進出 04	500,000	50,305,000.00
15 國開 20	500,000	49,565,000.00
16 上海 11	500,000	48,395,000.00
10 國開 15	450,000	45,018,000.00
12 石化 01	439,470	44,118,393.30
14 國開 22	400,000	43,072,000.00
15 農發 04	400,000	40,212,000.00
14 國開 29	300,000	30,765,000.00
13 國網 MTN1	300,000	30,483,000.00
13 航機電 MTN1	300,000	30,438,000.00
12 進出 03	300,000	30,219,000.00
14 國開 01	300,000	30,033,000.00
13 國開 12	300,000	29,895,000.00
16 國開 10	300,000	28,851,000.00
08 國開 16	250,000	25,605,000.00
13 渝保稅 MTN1	200,000	20,460,000.00
13 鎮國投 MTN2	200,000	20,342,000.00
12 滇建工 MTN1	200,000	20,262,000.00
12 蕪湖建投債 01	150,000	16,276,500.00
13 馬城投 MTN001	100,000	10,457,000.00
08 國網債 02	100,000	10,252,000.00
合計		2,668,646,893.3

(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(100%)		
花唄 03A1	220,000	21,775,669.31
13 隧道 02	100,000	1,779,000.00
合計		23,554,669.31
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		-
交易所市場買入返售金融資產		170,000,000.00
合計		170,000,000.00
總投資資產		6,226,179,451.29
銀行存款和結算備付金		879,632,773.50
其他各項資產		54,890,931.49
合計		7,160,703,156.28

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 (%)	占基金資產淨值的比例 (%)
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
1	股票	46.98	41.80
2	債券	37.27	47.73
3	資產支持證券	0.33	0.07
4	買入返售金融資產	2.37	2.55