

华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
2015 年半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华夏策略混合
基金主代码	002031
交易代码	002031
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月23日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	287,107,406.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，谋求基金资产的长期、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金是灵活配置型混合基金，混合基金的风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金；而灵活配置型混合基金的资产配置比例可灵活调整，在混合基金中也属于较高风险、较高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	465,163,589.81
本期利润	404,433,293.23
加权平均基金份额本期利润	1.0816
本期加权平均净值利润率	37.57%
本期基金份额净值增长率	44.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	571,333,777.87
期末可供分配基金份额利润	1.9900
期末基金资产净值	858,441,184.44
期末基金份额净值	2.990
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	306.23%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

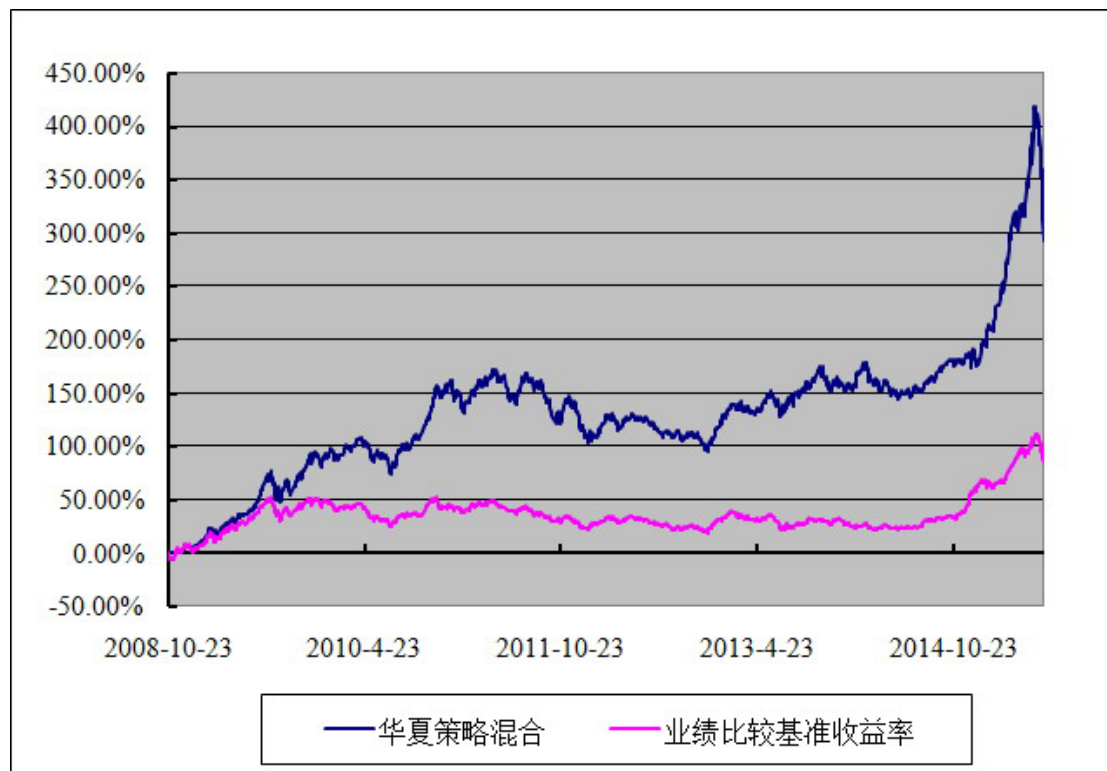
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-13.31%	3.17%	-3.74%	1.93%	-9.57%	1.24%
过去三个月	2.22%	2.39%	6.69%	1.44%	-4.47%	0.95%
过去六个月	44.58%	1.98%	16.10%	1.25%	28.48%	0.73%
过去一年	61.27%	1.51%	54.20%	1.01%	7.07%	0.50%
过去三年	83.89%	1.17%	49.09%	0.82%	34.80%	0.35%
自基金合同生效起至今	306.23%	1.20%	91.70%	0.90%	214.53%	0.30%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2008 年 10 月 23 日至 2015 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求满意

的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至 2015 年 6 月 30 日数据），华夏成长混合在 36 只偏股型基金（股票上限 80%）中排名第 12，华夏永福养老理财混合在 16 只偏债型基金中排名第 6，华夏回报及回报二号混合基金分别在 14 只特定策略混合型基金中排名第 5 和第 4；固定收益类产品中，华夏双债债券在 88 只普通债券型基金中排名第 14，华夏薪金宝货币及华夏财富宝货币分别在 150 只货币型基金中排名第 4 和第 8。

上半年，在《中国证券报》主办的“第十二届中国基金业金牛奖”评选中，华夏永福养老理财混合荣获“2014 年度开放式混合型金牛基金”；在《上海证券报》主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中，华夏永福养老理财混合、华夏沪深 300ETF 获得“金基金”产品奖；在《证券时报》主办的“2014 年度中国基金业明星基金奖”评选中，华夏策略混合获得“五年持续回报积极混合型明星基金奖”。

在客户服务方面，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）将华夏基金网上查询和自助语音的数据更新时间提前，以便客户能更及时地了解交易信息；（2）网上交易平台新增支持上海银行、平安银行借记卡开户，并新增短信鉴权方式，提高了网上交易开户的便利性和安全性；（3）开展“基金经理会客厅”、“我的投资我的团”、“2015 年北京马拉松华夏基金训练营”等客户互动活动，倡导和传递理财及生活理念。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑晓辉	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2015-06-16	-	12 年	北京大学金融学博士。曾任长盛基金研究员、基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理（2006 年 11 月 29 日至 2008 年 4 月 26 日期间）等。2008 年 5 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资经理、机构投资部总经理助理、机构投资部副总经理、股票投资部副总经理等。

杨明韬	本基金的基金经理、股票投资部总监	2014-05-13	2015-06-16	7 年	北京大学金融学硕士。2008 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理（2012 年 1 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期间）等。
-----	------------------	------------	------------	-----	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球经济增长分化明显，美国经济持续复苏，欧洲虽然受到希腊债务因素的影响，但是整体仍处于缓慢复苏过程中，而以中国为代表的新兴经济体

则继续缓慢回落。在美联储逐步退出 QE 的影响下，国际资本陆续流出新兴市场国家，美元相对其他主要货币明显升值之后高位震荡，新兴市场国家货币出现明显贬值，人民币兑美元也出现了一定的贬值压力。

A 股市场前 5 个月涨幅明显，尤其是中小市值股票接连上涨，“泡沫化”现象显著。进入 6 月后，随着监管部门严厉清查场外配资，市场整体快速下跌，中小市值股票跌幅惨烈。

报告期内，本基金保持了较高的仓位。1 季度坚守的成长股获得了较好收益，阶段性地抓住了市场机会；2 季度对部分涨幅较大、竞争力一般的中小股票进行了获利了结，适当增持了航空、电力等业绩可能超预期的大盘蓝筹股，以及军工、体育等部分发展空间较大、涨幅不明显的成长类股票，整体投资效果尚可。但是由于对清查场外配资带来的“踩踏”效应估计不足，在 6 月中下旬市场快速下跌过程中，没有及时降低仓位，基金净值受到了一定的损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.990 元，本报告期份额净值增长率为 44.58%，同期业绩比较基准增长率为 16.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在美联储可能加息的全球大背景下，世界经济金融体系的不确定性依然较大。国内房地产行业销售较快的增长态势可能继续维持，地方政府债务置换等积极财政政策逐渐发力，经济增长预计将逐步企稳，然而猪价以及部分城市房价的快速反弹将开始制约货币政策的宽松程度。股票市场预计将呈现震荡态势，结构性机会可能更多的与国企改革、电改、油改等进一步的改革红利以及可能的财政刺激政策有关，长期来看，受益于经济转型、治理结构良好、具有持续创新能力的企业有望逐步胜出。

投资策略上，本基金将秉承“以业绩增长”为核心的成长型投资理念，重点研究并跟踪业绩增长较为确定、行业成长空间较大、估值相对较为合理的个股。同时注重“自上而下”的大类资产配置，密切关注宏观刺激政策、行业景气演变催生的投资机会，在控制整体风险的基础上，不断优化投资组合。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽

责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、法律监察工作负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金

资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		67,555,726.77	35,420,184.26
结算备付金		4,748,958.98	5,256,901.58
存出保证金		590,908.84	245,386.43
交易性金融资产		832,353,427.74	697,396,819.24
其中：股票投资		683,658,020.74	548,234,266.35
基金投资		-	-
债券投资		148,695,407.00	149,162,552.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		29,724,128.85	32,263,714.65
应收利息		2,252,132.19	2,207,966.91
应收股利		-	-
应收申购款		820,434.68	525,010.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		938,045,718.05	773,315,983.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		63,940,415.60	4,393,124.33
应付管理人报酬		1,404,704.04	1,037,967.72
应付托管费		234,117.32	172,994.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		13,029,598.20	9,704,003.80
应交税费		680,334.32	680,334.32
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		315,364.13	86,556.77
负债合计		79,604,533.61	16,074,981.56
所有者权益：			
实收基金		287,107,406.57	366,230,619.18
未分配利润		571,333,777.87	391,010,382.47
所有者权益合计		858,441,184.44	757,241,001.65
负债和所有者权益总计		938,045,718.05	773,315,983.21

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.990 元，基金份额总额 287,107,406.57 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		422,499,027.43	-12,238,880.38
1.利息收入		2,744,122.50	7,075,191.64
其中：存款利息收入		663,428.41	383,824.85
债券利息收入		2,038,620.03	6,444,453.28

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		42,074.06	246,913.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		479,344,369.21	67,576,214.48
其中：股票投资收益		459,089,137.57	62,629,940.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益		15,221,560.44	171,899.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,033,671.20	4,774,374.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-60,730,296.58	-87,345,216.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,140,832.30	454,930.16
减：二、费用		18,065,734.20	14,902,996.61
1.管理人报酬		7,931,740.66	9,540,130.24
2.托管费		1,321,956.75	1,590,021.65
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		8,704,665.81	3,667,826.08
5.利息支出		-	6,286.00
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,286.00
6.其他费用		107,370.98	98,732.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		404,433,293.23	-27,141,876.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		404,433,293.23	-27,141,876.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	366,230,619.18	391,010,382.47	757,241,001.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	404,433,293.23	404,433,293.23

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-79,123,212.61	-224,109,897.83	-303,233,110.44
其中：1.基金申购款	213,930,367.65	395,479,559.77	609,409,927.42
2.基金赎回款	-293,053,580.26	-619,589,457.60	-912,643,037.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	287,107,406.57	571,333,777.87	858,441,184.44
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	747,941,323.21	671,646,140.43	1,419,587,463.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,141,876.99	-27,141,876.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-125,981,011.85	-113,486,007.13	-239,467,018.98
其中：1.基金申购款	64,407,147.68	60,062,773.50	124,469,921.18
2.基金赎回款	-190,388,159.53	-173,548,780.63	-363,936,940.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	621,960,311.36	531,018,256.31	1,152,978,567.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨明辉 汪贵华 汪贵华
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述会计估计变更外，本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计

与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致：

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，自 2015 年 3 月 20 日起，本基金采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格对持有的交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）进行估值。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	327,783,495.49	5.83%	584,947,773.56	25.64%

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	66,710,100.60	49.17%	-	-

6.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	250,000,000.00	100.00%	920,000,000.00	51.80%

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
中信证券	298,412.03	5.83%	298,412.03	2.29%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
中信证券	532,534.33	25.64%	300,717.02	3.12%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至
----	-----------------------	----------------------------

	2015 年 6 月 30 日	2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,931,740.66	9,540,130.24
其中：支付销售机构的客户维护费	948,025.41	980,628.80

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,321,956.75	1,590,021.65

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	13,626,206.77	13,626,206.77
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	13,626,206.77	13,626,206.77
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.75%	2.19%

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	67,555,726.77	625,665.77	130,103,637.22	362,061.49

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.5 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量(股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
600872	中炬高新	2015-05-04	筹划重大资产重组事项	23.17	-	-	2,999,970	45,494,202.76	69,509,304.90	-
600886	国投电力	2015-06-24	筹划重大事项	14.87	-	-	2,014,500	26,984,030.54	29,955,615.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	筹划非公开发行股票事项	18.59	-	-	1,800,000	32,896,940.77	33,462,000.00	-

601877	正泰电器	2015-05-18	筹划重大资产重组事项	30.62	-	-	57	1,646.80	1,745.34	-
002194	武汉凡谷	2015-06-18	筹划非公开发行股票事项	21.08	2015-07-24	24.28	801,179	21,036,399.33	16,888,853.32	-
002558	世纪游轮	2014-10-27	筹划重大资产重组事项	31.65	-	-	49,947	1,206,224.88	1,580,822.55	-
002665	首航节能	2015-06-30	筹划重大事项	27.70	2015-07-01	30.00	808,051	27,502,445.63	22,383,012.70	-
300195	长荣股份	2015-06-23	筹划非公开发行股票事项	28.36	2015-08-24	28.76	499,850	20,023,008.38	14,175,746.00	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止, 本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定, 以公允价值计量的金融工具, 其公允价值的计量可分为三个层次:

第一层次: 对存在活跃市场报价的金融工具, 可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次: 对估值日活跃市场无报价的金融工具, 可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值; 对估值日不存在活跃市场的金融工具, 可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2015 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 495,700,920.93 元，第二层次的余额为 336,652,506.81 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2014 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 654,419,256.84 元，第二层次的余额为 42,977,562.40 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.6.3 公允价值所属层次间的重大变动

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，自 2015 年 3 月 20 日起，本基金采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格对持有的交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）进行估值，因此本基金自该日起将此类固定收益品种公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。对于特殊事项停牌的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。

6.4.6.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	683,658,020.74	72.88
	其中：股票	683,658,020.74	72.88
2	固定收益投资	148,695,407.00	15.85
	其中：债券	148,695,407.00	15.85
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	72,304,685.75	7.71
7	其他各项资产	33,387,604.56	3.56
8	合计	938,045,718.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	511,235,748.39	59.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,209,418.23	7.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	30,957,696.00	3.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,674,335.57	9.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,580,822.55	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	683,658,020.74	79.64

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600872	中炬高新	2,999,970	69,509,304.90	8.10
2	002612	朗姿股份	699,542	47,184,107.90	5.50
3	300145	南方泵业	789,125	34,682,043.75	4.04
4	600978	宜华木业	1,800,000	33,462,000.00	3.90

5	002444	巨星科技	1,772,871	32,762,656.08	3.82
6	601126	四方股份	1,060,706	32,351,533.00	3.77
7	600570	恒生电子	287,217	32,182,664.85	3.75
8	600011	华能国际	2,227,641	31,253,803.23	3.64
9	600115	东方航空	2,512,800	30,957,696.00	3.61
10	600886	国投电力	2,014,500	29,955,615.00	3.49

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002085	万丰奥威	72,709,991.42	9.60
2	002612	朗姿股份	72,165,464.78	9.53
3	002396	星网锐捷	68,646,990.33	9.07
4	002665	首航节能	64,664,107.16	8.54
5	000625	长安汽车	62,815,256.56	8.30
6	002364	中恒电气	56,207,956.62	7.42
7	600978	宜华木业	48,591,833.83	6.42
8	600011	华能国际	45,708,006.00	6.04
9	600872	中炬高新	45,494,202.76	6.01
10	300244	迪安诊断	45,342,123.73	5.99
11	000333	美的集团	45,332,765.80	5.99
12	000100	TCL 集团	45,057,193.99	5.95
13	601126	四方股份	43,002,823.22	5.68
14	000757	浩物股份	42,828,091.36	5.66
15	002551	尚荣医疗	42,331,970.26	5.59
16	600570	恒生电子	42,081,127.79	5.56
17	600559	老白干酒	40,796,472.64	5.39
18	002169	智光电气	40,446,539.38	5.34
19	300310	宜通世纪	38,705,737.80	5.11
20	603099	长白山	37,886,939.86	5.00
21	300171	东富龙	37,872,820.49	5.00
22	300159	新研股份	37,480,486.53	4.95
23	600415	小商品城	37,026,555.82	4.89

24	000016	深康佳 A	34,854,976.49	4.60
25	002572	索菲亚	34,465,269.30	4.55
26	600115	东方航空	34,146,399.10	4.51
27	002394	联发股份	33,867,267.14	4.47
28	300168	万达信息	32,166,637.31	4.25
29	300104	乐视网	30,473,167.61	4.02
30	300163	先锋新材	30,411,271.28	4.02
31	000063	中兴通讯	29,947,835.97	3.95
32	600270	外运发展	29,556,437.92	3.90
33	601166	兴业银行	28,567,817.00	3.77
34	300383	光环新网	28,219,673.62	3.73
35	002472	双环传动	27,760,265.76	3.67
36	002279	久其软件	27,668,327.46	3.65
37	600886	国投电力	26,984,030.54	3.56
38	000710	天兴仪表	26,919,747.48	3.55
39	600612	老凤祥	25,864,047.99	3.42
40	000568	泸州老窖	25,795,972.75	3.41
41	300013	新宁物流	24,753,640.22	3.27
42	600391	成发科技	24,470,816.44	3.23
43	600289	亿阳信通	24,356,194.30	3.22
44	600900	长江电力	23,827,903.12	3.15
45	002520	日发精机	23,346,173.80	3.08
46	000800	一汽轿车	23,143,850.36	3.06
47	300017	网宿科技	23,038,950.46	3.04
48	300348	长亮科技	22,874,374.67	3.02
49	603456	九洲药业	21,892,724.82	2.89
50	002344	海宁皮城	21,853,525.96	2.89
51	300077	国民技术	21,781,528.50	2.88
52	002431	棕榈园林	21,635,017.95	2.86
53	300298	三诺生物	21,207,780.22	2.80
54	002194	武汉凡谷	21,036,399.33	2.78
55	002695	煌上煌	20,784,439.88	2.74
56	300016	北陆药业	20,781,173.09	2.74
57	600499	科达洁能	20,680,934.77	2.73
58	600422	昆药集团	20,495,461.68	2.71
59	601318	中国平安	20,379,695.41	2.69
60	300195	长荣股份	20,023,008.38	2.64

61	002444	巨星科技	19,771,972.80	2.61
62	300038	梅泰诺	19,578,425.00	2.59
63	000910	大亚科技	19,393,282.16	2.56
64	300325	德威新材	18,416,207.30	2.43
65	600804	鹏博士	17,905,746.31	2.36
66	002653	海思科	17,609,872.42	2.33
67	300145	南方泵业	17,418,537.96	2.30
68	600199	金种子酒	16,949,896.55	2.24
69	002051	中工国际	16,313,387.04	2.15
70	000829	天音控股	15,736,004.00	2.08
71	002698	博实股份	15,176,592.11	2.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600804	鹏博士	128,696,856.20	17.00
2	002572	索菲亚	127,160,707.57	16.79
3	002364	中恒电气	109,876,806.47	14.51
4	002508	老板电器	95,402,227.50	12.60
5	601633	长城汽车	75,212,195.25	9.93
6	000100	TCL 集团	71,934,677.92	9.50
7	002396	星网锐捷	69,065,405.13	9.12
8	300171	东富龙	66,047,296.01	8.72
9	000333	美的集团	61,146,933.03	8.07
10	600398	海澜之家	60,988,503.35	8.05
11	600415	小商品城	60,715,294.09	8.02
12	000625	长安汽车	59,845,802.74	7.90
13	000963	华东医药	54,218,132.86	7.16
14	600559	老白干酒	53,967,460.33	7.13
15	000757	浩物股份	48,417,724.51	6.39
16	002085	万丰奥威	46,932,985.28	6.20
17	002551	尚荣医疗	44,872,242.56	5.93
18	002344	海宁皮城	42,681,387.28	5.64
19	000016	深康佳 A	42,673,248.96	5.64

20	002665	首航节能	42,224,942.05	5.58
21	000063	中兴通讯	41,115,230.04	5.43
22	603099	长白山	39,867,615.27	5.26
23	300244	迪安诊断	38,924,074.30	5.14
24	300013	新宁物流	38,801,690.35	5.12
25	600612	老凤祥	36,233,674.40	4.78
26	600289	亿阳信通	35,538,987.34	4.69
27	600690	青岛海尔	34,783,673.85	4.59
28	300383	光环新网	34,627,912.20	4.57
29	002394	联发股份	33,284,071.00	4.40
30	300310	宜通世纪	32,769,657.29	4.33
31	000710	天兴仪表	32,430,112.54	4.28
32	300163	先锋新材	32,140,672.05	4.24
33	600270	外运发展	31,040,044.00	4.10
34	300017	网宿科技	28,139,438.81	3.72
35	600978	宜华木业	27,970,173.05	3.69
36	601166	兴业银行	27,615,197.83	3.65
37	600079	人福医药	26,991,123.54	3.56
38	002612	朗姿股份	26,207,425.10	3.46
39	300145	南方泵业	26,183,334.43	3.46
40	300325	德威新材	25,854,200.34	3.41
41	000568	泸州老窖	25,770,782.65	3.40
42	000800	一汽轿车	25,472,517.03	3.36
43	002520	日发精机	24,586,427.32	3.25
44	603456	九洲药业	23,530,342.56	3.11
45	002472	双环传动	23,318,628.58	3.08
46	600900	长江电力	22,980,542.00	3.03
47	000829	天音控股	22,526,710.60	2.97
48	000910	大亚科技	22,319,128.57	2.95
49	600499	科达洁能	21,864,694.28	2.89
50	300291	华录百纳	20,670,708.82	2.73
51	601801	皖新传媒	20,573,076.45	2.72
52	002279	久其软件	20,569,879.17	2.72
53	002695	煌上煌	20,402,241.32	2.69
54	601318	中国平安	20,182,275.39	2.67
55	300298	三诺生物	20,001,325.53	2.64
56	300348	长亮科技	19,861,456.00	2.62

57	002653	海思科	18,886,490.46	2.49
58	002431	棕榈园林	18,011,597.32	2.38
59	002385	大北农	16,863,017.03	2.23
60	600011	华能国际	16,792,364.98	2.22
61	002051	中工国际	16,464,928.87	2.17
62	600199	金种子酒	16,402,786.12	2.17
63	300050	世纪鼎利	16,267,274.06	2.15
64	600198	大唐电信	15,612,299.14	2.06
65	002686	亿利达	15,165,029.07	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,674,686,803.41
卖出股票收入（成交）总额	2,954,190,889.07

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,830,000.00	8.25
	其中：政策性金融债	70,830,000.00	8.25
4	企业债券	77,865,407.00	9.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	148,695,407.00	17.32

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	------	-----------

					(%)
1	150207	15 国开 07	500,000	50,820,000.00	5.92
2	112138	12 苏宁 01	300,000	30,510,000.00	3.55
3	100304	10 进出 04	200,000	20,010,000.00	2.33
4	122957	09 蓉工投	149,980	15,149,479.80	1.76
5	122114	11 一重债	99,670	10,135,442.30	1.18

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	590,908.84
2	应收证券清算款	29,724,128.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,252,132.19
5	应收申购款	820,434.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,387,604.56

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600872	中炬高新	69,509,304.90	8.10	筹划重大资产重组事项
2	600978	宜华木业	33,462,000.00	3.90	筹划非公开发行股票事项
3	600886	国投电力	29,955,615.00	3.49	筹划重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

14,741	19,476.79	28,393,153.53	9.89%	258,714,253.04	90.11%
--------	-----------	---------------	-------	----------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	352,077.27	0.12%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年10月23日）基金份额总额	1,583,765,847.96
本报告期期初基金份额总额	366,230,619.18
本报告期基金总申购份额	213,930,367.65
减：本报告期基金总赎回份额	293,053,580.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	287,107,406.57

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2015 年 3 月 5 日发布公告，刘义先生任华夏基金管理有
限公司副总经理。

本基金管理人于 2015 年 5 月 9 日发布公告，阳琨先生、李一梅女士任华夏
基金管理有
限公司副总经理，林浩先生、吴志军先生不再担任华夏基金管理有
限公司副总经理。

本基金管理人于 2015 年 8 月 1 日发布公告，汤晓东先生任华夏基金管理有
限公司总经理，周璇女士任华夏基金管理有
限公司督察长。

本基金托管人于 2015 年 4 月 14 日发布公告，李爱华先生不再担任中国
银行
股份有限公司托管业务部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人于 2015 年 3 月 19 日发布公告，对国家工商行政管理总局商标评审委员会作出的商标驳回复审决定向北京知识产权法院提起行政诉讼。该案件已于 2015 年 7 月 20 日获得胜诉判决。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人报告期内收到中国证券监督管理委员会北京监管局（以下简称“北京证监局”）《关于对华夏基金管理有限公司采取责令整改及暂不受理行政许可的行政监管措施的决定》：决定自责令整改行政监管措施生效之日起六个月内，暂不受理公司出具的公募基金产品注册申请，已受理的公募基金产品注册申请中止审查，对相关责任人采取行政监管措施。公司已在规定时间内完成整改，并通过北京证监局的现场整改验收，2015 年 8 月 12 日整改期结束。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	3	2,231,331,008.66	39.66%	2,031,406.05	39.66%	-
国信证券	2	1,356,964,447.33	24.12%	1,235,378.24	24.12%	-
中信建投证券	1	965,992,048.98	17.17%	879,435.42	17.17%	-
高华证券	1	445,900,741.36	7.92%	405,949.18	7.92%	-
中信证券	1	327,783,495.49	5.83%	298,412.03	5.83%	-
瑞银证券	1	298,646,283.46	5.31%	271,887.20	5.31%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③ 除本表列示外，本基金还选择了申万宏源证券、西部证券、兴业证券、中银国际证券和中国银河证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④ 本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国泰君安证券	30,527,795.80	22.50%	-	-
国信证券	14,509,993.80	10.69%	-	-
中信建投证券	23,934,536.80	17.64%	-	-
中信证券	66,710,100.60	49.17%	250,000,000.00	100.00%

华夏基金管理有限公司

二〇一五年八月二十九日