

# 华夏大盘精选证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 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：二〇一六年三月二十九日

## § 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 2016 年 3 月 25 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏大盘精选证券投资基金	
基金简称	华夏大盘精选混合	
基金主代码	000011	
交易代码	000011	000012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年8月11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	172,587,634.61份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，根据细致的财务分析和深入的上市公司调研，精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性，基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例，以避免市场系统性风险，保证基金所承担的风险水平合理。
业绩比较基准	本基金整体的业绩比较基准为“富时中国 A200 指数×80%+富时中国国债指数×20%”。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金，低于成长型股票基金。

### 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
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.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

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

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	724,128,059.53	-60,993,683.36	429,195,609.55
本期利润	636,697,004.75	19,614,286.52	395,215,442.13
加权平均基金份额本期利润	3.3096	0.0645	0.9706
本期加权平均净值利润率	29.22%	0.83%	11.27%
本期基金份额净值增长率	28.17%	6.07%	14.92%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	1,698,038,716.20	1,459,153,031.43	2,256,238,420.75
期末可供分配基金份额利润	9.8387	6.2731	6.3283
期末基金资产净值	1,990,240,712.97	2,110,771,522.69	3,088,857,365.92
期末基金份额净值	11.532	9.075	8.664
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	1893.61%	1455.48%	1366.45%

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
过去三个月	26.99%	1.94%	12.59%	1.31%	14.40%	0.63%
过去六个月	-4.22%	2.95%	-13.03%	2.11%	8.81%	0.84%
过去一年	28.17%	2.56%	3.95%	1.98%	24.22%	0.58%
过去三年	56.23%	1.75%	34.97%	1.43%	21.26%	0.32%
过去五年	37.14%	1.57%	19.21%	1.28%	17.93%	0.29%
自基金合同生效起至今	1893.61%	1.58%	177.66%	1.47%	1715.95%	0.11%

##### 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

华夏大盘精选证券投资基金

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

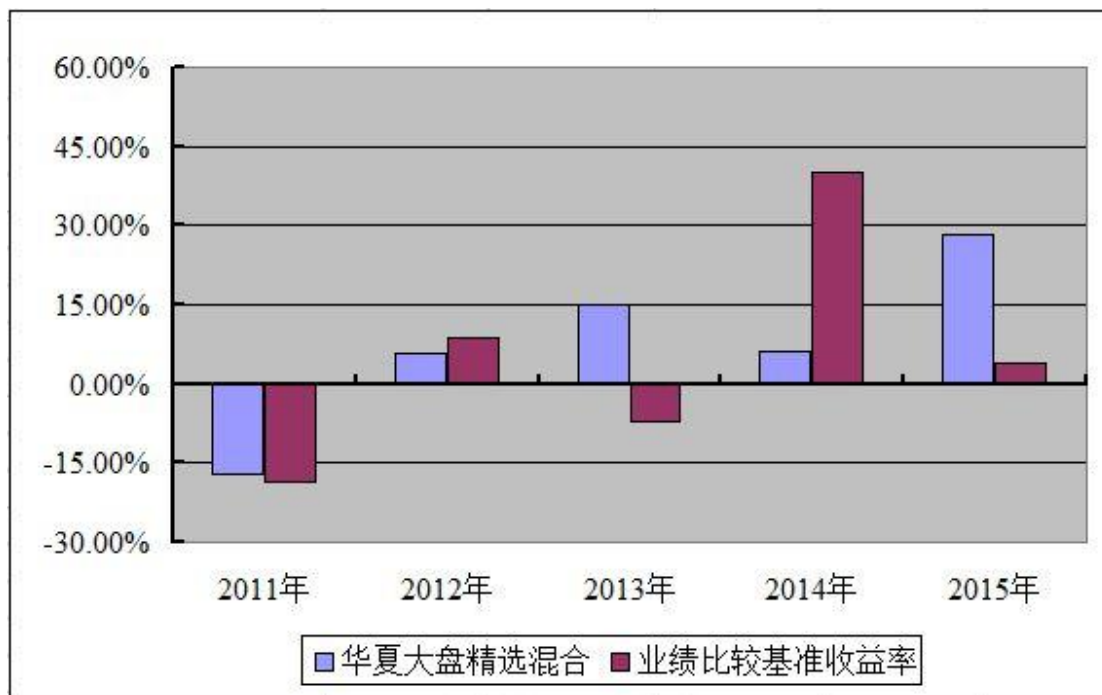
(2004 年 8 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏大盘精选证券投资基金

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	1.000	6,307,021.59	10,886,874.09	17,193,895.68	-
2014年	1.000	7,853,994.02	16,078,912.17	23,932,906.19	-
2013年	1.000	13,883,273.57	25,647,573.26	39,530,846.83	-
合计	3.000	28,044,289.18	52,613,359.52	80,657,648.70	-

## §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、深圳、上海设有子公司。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、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人，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。

2015 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”。

2015 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户的使用便利性和服务体验：（1）全面改版客服热线自助语音服务，新增快速查账、手机绑定等多项功能，为客户提供更便捷的自助查询方式；（2）提前网上查询和自助语音数据更新时间，让客户能更及时地了解交易信息；（3）与苏宁易购、苏宁金融、网易理财等互联网平台合作，为客户购买旗下基金提供更多优惠便捷的交易通道，同时也满足了网上交易客户基金交易以外的消费需求。

#### 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		
佟巍	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2015-02-27	-	7 年	曾任雷曼兄弟亚洲投资有限公司、野村国际（香港）有限公司结构化信贷交易部交易员等。2009 年 1 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理等。
阳琨	本基金的基金经理、公司副总经理、投资总监	2015-09-01	-	20 年	北京大学 MBA。曾任宝盈基金基金经理助理，益民基金投资部部门经理，中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理等。2006 年 8 月加入华夏基金管理有限公司，曾任策略研究员、股票投资部副总经理，兴和证券投资基金基金经理（2009 年 1 月 1 日至 2012 年 1 月 12 日期间）、兴华证券投资基金基金经理（2007 年 6 月 12 日至 2013 年 4 月 11 日期间）等。
孙彬	本基金的基金经理、董事	2013-09-23	2015-02-27	8 年	中国人民大学金融学硕士。2007 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研

	总经理				究员、投资研究部总经理助理、基金经理助理、投资研究部副总监、投资研究部总监等。
任竞辉	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2014-07-18	2015-10-15	10 年	清华大学 MBA。曾任原申万巴黎基金管理有限公司、中国国际金融有限公司行业研究员，嘉实基金管理有限公司高级分析师、泰和证券投资基金基金经理（2010 年 10 月 12 日至 2013 年 6 月 19 日期间）、嘉实成长收益证券投资基金基金经理（2012 年 12 月 17 日至 2013 年 6 月 19 日期间）等。2013 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任股票投资部副总经理等。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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，本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 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

2015 年，国内宏观经济总体水平仍然维持疲弱态势，经济增速继续放缓，大宗商品价格逐步走低。但在年末局部也呈现出一定的变化：商品房和汽车的销售积极，尤其是商品房的销售面积在单月接近 2014 年底的历史高点，显示出下行的利率和宽松的流动性正在帮助房地产行业去库存。

A 股市场经历了大开大合的一年。1-6 月初，在货币宽松、资金加杠杆以及财富效应的共同推动下，股市单边快速上涨，尤其是新兴成长类股票和主题类股票涨幅巨大，股票估值被推高到合理区间之外。6 月中旬以后，在去杠杆的触发下，股市经历了第一轮快速下跌，政府入市干预以化解股市的流动性危机。此后 M2 增速出现跃升，8 月份人民币开始贬值，这加剧了全球对于通缩和货币竞争性贬值的担忧，“8.11”之后全球股市出现了明显下跌，A 股市场也经历了第二轮急速下跌。4 季度，股市迎来了较为明显的反弹行情。风格方面，新兴成长类股票和主题类股票涨幅居前。海外市场方面，美联储在 12 月中旬宣布加息，正式结束了 08 年金融危机以来的反危机货币政策。

报告期内，本基金总体配置均衡，致力于实现可控回撤下的收益率。上半年，本基金高仓位持股，但由于新兴行业股票和主题类股票估值过高，配置并不多，4 月份以后逐渐增加了金融类股票的配置比例；之后在市场下跌过程中，本基金

降低了股票仓位；进入 10 月后，本基金重新提高了股票仓位，并在年度后期增加了金融股和原材料类股票的配置力度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 11.532 元，本报告期份额净值增长率为 28.17%，同期业绩比较基准增长率为 3.95%。

#### 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 2016 年，我们认为市场将更为复杂和充满变数，市场提供给投资者的收益率相比于过去有所降低。流动性方面，中美可能都正处于后金融危机时代以来的流动性拐点。美联储加息标志着美国正式结束了 08 年次贷危机以来的反危机模式，美元进入加息周期，长期看这对全球金融市场会产生深远的影响。对中国资本市场而言，美国国债利率的走高一定程度上将限制中国国债利率的下行空间，非储备货币货币政策的外生约束开始显现，国内流动性的宽松局面或将在 2016 年面临拐点，政策在汇率和利率之间面临艰难选择，这可能对国内资产价格产生负面影响，同时也会对 A 股市场的风险偏好产生影响，A 股 08 年以来追求高风险高收益的风格偏好的基础可能发生动摇。

国内宏观经济方面，需求端总体仍将较大概率维持低迷。供给侧改革可能成为国内经济的变数之一。过剩产能的出清对信贷市场、就业环境和大宗商品价格都会产生影响，进而影响股票市场；政府在需求端的支持力度或将成为经济运行的另一变数，赤字率的提高可能对经济短期企稳有所帮助。我们认为，供给侧改革和政府加杠杆有利于中期的经济转型，但二者同时指向资本品价格和通胀预期的上行，可能会对短期股票市场产生一定程度的负面影响。

投资策略上，一方面，我们将一如既往努力发掘优秀质地的成长股；另一方面，我们会择机增持原材料类股票和低估值蓝筹股票。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司制定了员工行为规范、员工行为准则，修订了员工投资行为

管理制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、基金交易、市场销售，后台运作等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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”）在华夏大盘精选证券投资基金（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 审计报告

安永华明（2016）审字第 60739337\_B02 号

华夏大盘精选证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华夏大盘精选证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照

中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏大盘精选证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 汤骏 濮晓达  
北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层  
2016 年 3 月 7 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏大盘精选证券投资基金  
报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		196,564,161.71	129,258,096.17
结算备付金		7,136,327.49	9,539,274.43
存出保证金		575,745.15	1,273,413.29
交易性金融资产		1,816,376,047.68	2,012,057,319.81
其中：股票投资		1,786,712,047.68	1,922,114,319.81

基金投资		-	-
债券投资		29,664,000.00	89,943,000.00
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		-	35,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		251,440.79	2,723,437.27
应收股利		-	-
应收申购款		1,823,861.74	5,166,235.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,022,727,584.56	2,195,017,776.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	35,000,000.00
应付赎回款		7,867,010.98	19,582,839.59
应付管理人报酬		2,550,728.43	2,702,475.82
应付托管费		425,121.39	450,412.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		20,692,951.94	25,255,241.01
应交税费		101,409.60	101,409.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		849,649.25	1,153,875.15
负债合计		32,486,871.59	84,246,253.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		172,587,634.61	232,604,334.87
未分配利润		1,817,653,078.36	1,878,167,187.82
所有者权益合计		1,990,240,712.97	2,110,771,522.69
负债和所有者权益总计		2,022,727,584.56	2,195,017,776.50

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 11.532 元，基金份额总额 172,587,634.61 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏大盘精选证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		704,308,154.06	95,472,572.89
1.利息收入		4,405,552.77	9,728,909.96
其中：存款利息收入		2,183,543.14	1,777,241.12
债券利息收入		2,088,775.75	5,767,654.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		133,233.88	2,184,014.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		783,815,394.01	2,889,475.10
其中：股票投资收益		775,788,963.28	-24,077,803.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益		250,545.62	-272,040.00
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		7,775,885.11	27,239,319.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-87,431,054.78	80,607,969.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		3,518,262.06	2,246,217.95
<b>减：二、费用</b>		67,611,149.31	75,858,286.37
1.管理人报酬		32,546,454.40	35,743,921.44
2.托管费		5,424,409.02	5,957,320.30
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		29,269,383.27	33,750,159.47
5.利息支出		-	29,269.26
其中：卖出回购金融资产支出		-	29,269.26
6.其他费用		370,902.62	377,615.90

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		636,697,004.75	19,614,286.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		636,697,004.75	19,614,286.52

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华夏大盘精选证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	232,604,334.87	1,878,167,187.82	2,110,771,522.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	636,697,004.75	636,697,004.75
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)	-60,016,700.26	-680,017,218.53	-740,033,918.79
其中：1.基金申购款	177,531,905.99	1,896,944,577.43	2,074,476,483.42
2.基金赎回款	-237,548,606.25	-2,576,961,795.96	-2,814,510,402.21
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)	-	-17,193,895.68	-17,193,895.68
五、期末所有者权益(基金净值)	172,587,634.61	1,817,653,078.36	1,990,240,712.97
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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)	356,529,786.09	2,732,327,579.83	3,088,857,365.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,614,286.52	19,614,286.52
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)	-123,925,451.22	-849,841,772.34	-973,767,223.56
其中：1.基金申购款	101,847,659.09	721,298,614.78	823,146,273.87
2.基金赎回款	-225,773,110.31	-1,571,140,387.12	-1,796,913,497.43



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）	-	-23,932,906.19	-23,932,906.19
五、期末所有者权益（基金净值）	232,604,334.87	1,878,167,187.82	2,110,771,522.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

#### 7.4 报表附注

##### 7.4.1 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

本基金本报告期会计估计发生变更。

##### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

###### 7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

###### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 20 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

###### 7.4.2.3 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。

#### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金发起人、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
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东

注：①中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司于 2015 年 7 月 27 日联合发布公告，中信证券股份有限公司获准吸收合并全资子公司中信证券（浙江）有限责任公司。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.4.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 7.4.4.1.2 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。

###### 7.4.4.1.3 债券交易

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债券交易。

###### 7.4.4.1.4 债券回购交易

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回购交易。

###### 7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,546,454.40	35,743,921.44
其中：支付销售机构的客户维护费	3,155,305.59	3,170,357.87

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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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。

### 7.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,424,409.02	5,957,320.30

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。

### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	48,000,000.00	28,997.26

### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.4.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
期初持有的基金份额	2,865,518.86	2,829,940.03
期间申购/买入总份额	24,865.66	35,578.83
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	2,890,384.52	2,865,518.86
期末持有的基金份额占基金	1.67%	1.23%

总份额比例		
-------	--	--

注：本报告期及上年度可比期间的“期间申购/买入总份额”包含红利再投资所获得的基金份额。

#### 7.4.4.4.2 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。

#### 7.4.4.5 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31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	196,564,161.71	2,018,723.95	129,258,096.17	1,533,869.80

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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.5 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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
300028	金亚科技	2015-06-10	重大事项	24.48	-	-	361,920	7,497,676.78	8,859,801.60	-
300104	乐视网	2015-12-07	重大事项	58.80	-	-	3,211	191,344.63	188,806.80	-
600584	长电科技	2015-11-30	重大事项	22.94	-	-	999,913	19,159,069.86	22,938,004.22	-
600595	中孚实业	2015-12-29	重大事项	7.05	2016-01-19	6.35	3,144,315	20,858,916.00	22,167,420.75	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	21.31	2016-01-21	20.10	577,952	3,993,515.33	12,316,157.12	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 各层次金融工具公允价值

截至 2015 年 12 月 31 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 1,742,598,084.74 元，第二层次的余额为 73,777,962.94 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 1,860,401,535.24 元，第二层次的余额为 151,655,784.57 元，第三层次的余额为 0 元。）

##### 7.4.6.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票、收盘价异常的债券，本基金将相关股票和债券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、债券收盘价能体现公允价值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。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 20 日起改为采用中

证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

#### 7.4.6.4 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,786,712,047.68	88.33
	其中：股票	1,786,712,047.68	88.33
2	固定收益投资	29,664,000.00	1.47
	其中：债券	29,664,000.00	1.47
	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	203,700,489.20	10.07
7	其他各项资产	2,651,047.68	0.13
8	合计	2,022,727,584.56	100.00

### 8.2 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	46,716,125.99	2.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,348,980,156.03	67.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,567,558.26	1.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,539,134.66	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	29,467,629.80	1.48

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,359,458.35	0.37
J	金融业	207,394,313.41	10.42
K	房地产业	87,530,531.60	4.40
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,128,586.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,028,553.58	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,786,712,047.68	89.77

### 8.3 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	300077	国民技术	1,889,921	85,386,630.78	4.29
2	300156	神雾环保	1,495,779	74,773,992.21	3.76
3	000807	云铝股份	10,345,300	74,382,707.00	3.74
4	002630	华西能源	4,988,448	73,679,376.96	3.70
5	000541	佛山照明	3,499,878	58,447,962.60	2.94
6	002601	佰利联	1,480,552	57,682,305.92	2.90
7	600096	云天化	4,434,200	57,511,574.00	2.89
8	600559	老白干酒	703,284	42,316,598.28	2.13
9	000910	大亚科技	2,354,500	38,943,430.00	1.96
10	601688	华泰证券	1,952,000	38,493,440.00	1.93

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年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	002236	大华股份	212,553,594.09	10.07
2	001696	宗申动力	199,075,197.85	9.43

3	600582	天地科技	193,712,192.00	9.18
4	002241	歌尔声学	151,199,544.45	7.16
5	601021	春秋航空	150,521,183.20	7.13
6	601318	中国平安	115,341,031.74	5.46
7	300226	上海钢联	114,680,017.74	5.43
8	300291	华录百纳	111,041,898.85	5.26
9	300252	金信诺	109,879,045.92	5.21
10	000807	云铝股份	108,917,539.67	5.16
11	300077	国民技术	107,301,220.38	5.08
12	600491	龙元建设	102,997,842.18	4.88
13	601788	光大证券	100,550,078.37	4.76
14	002081	金螳螂	98,529,588.48	4.67
15	600153	建发股份	98,408,634.07	4.66
16	601225	陕西煤业	89,828,486.66	4.26
17	300085	银之杰	88,690,123.15	4.20
18	601377	兴业证券	87,179,284.92	4.13
19	600804	鹏博士	82,706,365.22	3.92
20	601688	华泰证券	81,406,280.18	3.86
21	002189	利达光电	75,749,069.38	3.59
22	600958	东方证券	75,458,841.49	3.57
23	600970	中材国际	75,050,241.95	3.56
24	600887	伊利股份	74,394,156.80	3.52
25	000910	大亚科技	73,554,632.02	3.48
26	002170	芭田股份	73,259,424.72	3.47
27	002418	康盛股份	72,435,812.02	3.43
28	601877	正泰电器	71,958,146.73	3.41
29	600280	中央商场	71,242,330.30	3.38
30	000776	广发证券	70,081,133.22	3.32
31	002630	华西能源	68,504,332.18	3.25
32	002285	世联行	68,312,859.13	3.24
33	300156	神雾环保	67,122,278.37	3.18
34	600837	海通证券	65,930,953.11	3.12
35	300104	乐视网	64,317,028.76	3.05
36	300367	东方网力	64,241,749.61	3.04
37	600547	山东黄金	63,180,425.20	2.99
38	600109	国金证券	62,659,847.40	2.97
39	600340	华夏幸福	62,628,981.02	2.97



40	600096	云天化	61,053,407.84	2.89
41	002024	苏宁云商	60,702,834.46	2.88
42	002415	海康威视	60,529,067.44	2.87
43	002065	东华软件	60,437,564.33	2.86
44	000728	国元证券	59,620,820.03	2.82
45	002349	精华制药	59,452,091.44	2.82
46	600352	浙江龙盛	58,867,428.49	2.79
47	600104	上汽集团	58,844,104.88	2.79
48	601166	兴业银行	58,537,960.27	2.77
49	000423	东阿阿胶	55,680,797.59	2.64
50	600010	包钢股份	54,955,659.00	2.60
51	002475	立讯精密	54,779,390.89	2.60
52	300251	光线传媒	54,081,234.97	2.56
53	300199	翰宇药业	53,898,165.80	2.55
54	300124	汇川技术	53,732,714.37	2.55
55	000541	佛山照明	53,573,546.21	2.54
56	600590	泰豪科技	51,898,616.29	2.46
57	600651	飞乐音响	50,042,196.47	2.37
58	000100	TCL 集团	48,466,480.74	2.30
59	002202	金风科技	47,752,778.95	2.26
60	600580	卧龙电气	46,405,385.71	2.20
61	600309	万华化学	45,914,737.17	2.18
62	600685	中船防务	45,740,494.71	2.17
63	002432	九安医疗	45,622,623.60	2.16
64	002601	佰利联	45,138,312.51	2.14
65	000001	平安银行	44,874,479.92	2.13
66	600168	武汉控股	44,170,522.61	2.09
67	002299	圣农发展	43,373,823.17	2.05
68	300324	旋极信息	42,762,791.49	2.03

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。

#### 8.4.2 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	300168	万达信息	282,082,081.78	13.36

2	002236	大华股份	226,705,937.49	10.74
3	600582	天地科技	200,980,909.15	9.52
4	600837	海通证券	195,336,591.63	9.25
5	601377	兴业证券	175,279,555.68	8.30
6	300252	金信诺	172,987,047.96	8.20
7	300085	银之杰	171,265,649.03	8.11
8	601633	长城汽车	160,383,388.25	7.60
9	000651	格力电器	150,154,406.01	7.11
10	002241	歌尔声学	150,015,359.10	7.11
11	601021	春秋航空	135,635,385.78	6.43
12	601225	陕西煤业	124,416,683.32	5.89
13	001696	宗申动力	122,473,739.52	5.80
14	000776	广发证券	116,472,580.55	5.52
15	601318	中国平安	115,614,180.93	5.48
16	600491	龙元建设	113,587,190.40	5.38
17	300291	华录百纳	113,533,226.48	5.38
18	600000	浦发银行	111,957,242.29	5.30
19	300226	上海钢联	111,722,421.64	5.29
20	600016	民生银行	108,493,223.08	5.14
21	601788	光大证券	108,316,161.63	5.13
22	600153	建发股份	102,547,228.27	4.86
23	002081	金螳螂	96,986,673.76	4.59
24	002065	东华软件	94,408,018.88	4.47
25	600352	浙江龙盛	89,911,350.56	4.26
26	600118	中国卫星	89,257,697.31	4.23
27	300367	东方网力	88,662,828.91	4.20
28	600804	鹏博士	87,557,589.55	4.15
29	002415	海康威视	85,468,768.19	4.05
30	600887	伊利股份	82,429,954.39	3.91
31	002202	金风科技	77,731,467.40	3.68
32	300199	翰宇药业	75,775,182.23	3.59
33	002466	天齐锂业	75,702,167.49	3.59
34	601877	正泰电器	75,104,583.08	3.56
35	600970	中材国际	73,155,933.58	3.47
36	002189	利达光电	70,262,057.85	3.33
37	600280	中央商场	67,535,154.21	3.20
38	600590	泰豪科技	65,870,547.32	3.12

39	002418	康盛股份	64,726,187.71	3.07
40	300104	乐视网	64,224,804.67	3.04
41	600340	华夏幸福	63,978,997.62	3.03
42	002170	芭田股份	62,042,934.06	2.94
43	600031	三一重工	59,747,018.55	2.83
44	600100	同方股份	59,684,602.90	2.83
45	002024	苏宁云商	58,868,424.38	2.79
46	600958	东方证券	58,331,759.55	2.76
47	601688	华泰证券	58,119,254.30	2.75
48	300124	汇川技术	58,018,775.87	2.75
49	600104	上汽集团	56,877,373.20	2.69
50	600547	山东黄金	55,316,602.68	2.62
51	000016	深康佳 A	54,434,431.98	2.58
52	000100	TCL 集团	53,734,830.28	2.55
53	002285	世联行	53,698,371.49	2.54
54	002475	立讯精密	53,422,997.31	2.53
55	600010	包钢股份	53,184,704.61	2.52
56	000423	东阿阿胶	52,841,939.82	2.50
57	000783	长江证券	50,572,373.15	2.40
58	300324	旋极信息	50,050,154.11	2.37
59	300251	光线传媒	49,749,084.66	2.36
60	600685	中船防务	46,408,505.46	2.20
61	600109	国金证券	45,922,189.00	2.18
62	002432	九安医疗	45,607,193.05	2.16
63	600309	万华化学	45,260,199.22	2.14
64	300070	碧水源	44,630,008.13	2.11
65	600168	武汉控股	44,470,347.76	2.11
66	002349	精华制药	44,419,928.21	2.10
67	300077	国民技术	43,049,484.49	2.04

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。

#### 8.4.3 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	9,147,515,977.43
卖出股票收入（成交）总额	9,971,378,203.68

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。

### 8.5 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	29,664,000.00	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,664,000.00	1.49

### 8.6 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	020083	15 贴债 09	300,000	29,664,000.00	1.49
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2015 年 9 月 10 日华泰证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。本基金投资该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	575,745.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	251,440.79
5	应收申购款	1,823,861.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,651,047.68

#### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
48,140	3,585.12	13,501,092.62	7.82%	159,086,541.99	92.18%

### 9.2 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	94,885.45	0.05%

### 9.3 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年8月11日）基金份额总额	1,927,966,142.50
本报告期期初基金份额总额	232,604,334.87
本报告期基金总申购份额	177,531,905.99
减：本报告期基金总赎回份额	237,548,606.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	172,587,634.61

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

#### 11.2 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。

2015 年 4 月，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。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

#### 11.3 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。

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 8 年的审计服务。

#### 11.6 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。公司已在规定时间完成整改，并已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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查

或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
齐鲁证券	1	6,773,909,088.63	35.43%	6,212,741.75	35.97%	-
兴业证券	2	3,919,133,756.56	20.50%	3,586,237.17	20.77%	-
申万宏源证券	1	2,744,047,642.09	14.35%	2,498,180.07	14.47%	-
国泰君安证券	1	1,534,654,318.38	8.03%	1,397,146.40	8.09%	-
安信证券	1	1,520,185,245.57	7.95%	1,384,603.36	8.02%	-
东兴证券	1	1,087,430,527.61	5.69%	779,301.75	4.51%	-
国金证券	1	892,470,087.88	4.67%	812,502.18	4.70%	-
华泰证券	1	647,057,829.39	3.38%	599,093.97	3.47%	-

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，本基金还选择了中信建投证券、中金公司和信达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。

### 11.7.2 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
兴业证券	-	-	190,000,000.00	22.09%
安信证券	-	-	670,000,000.00	77.91%

华夏基金管理有限公司

二〇一六年三月二十九日