

华夏红利混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
§11 备查文件目录.....	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏红利混合型证券投资基金	
基金简称	华夏红利混合	
基金主代码	002011	
交易代码	002011	002012
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,880,201,516.17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	在资产配置层面，本基金将采取积极的资产配置策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、债券和现金上的配置比例。在个股层面，基金主要选择具备良好现金分红能力且财务健康、具备长期增长潜力、市场估值合理的上市公司进行投资。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数，债券投资的业绩比较基准为富时中国国债指数。基准收益率=富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+富时中国国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。本基金主要投资于红利股，属于中等风险的证券投资基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-427,585,779.35
本期利润	-2,615,813,214.72
加权平均基金份额本期利润	-0.5406
本期加权平均净值利润率	-23.10%
本期基金份额净值增长率	-19.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	4,981,365,944.31
期末可供分配基金份额利润	1.0207
期末基金资产净值	11,598,064,719.37
期末基金份额净值	2.377
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	804.29%

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	1.62%	1.23%	-0.05%	0.57%	1.67%	0.66%
过去三个月	-2.06%	1.40%	-1.61%	0.61%	-0.45%	0.79%
过去六个月	-19.09%	2.32%	-9.91%	1.08%	-9.18%	1.24%
过去一年	-19.20%	2.61%	-16.55%	1.40%	-2.65%	1.21%
过去三年	68.94%	1.91%	47.62%	1.12%	21.32%	0.79%
自基金合同生效起至今	804.29%	1.59%	261.34%	1.18%	542.95%	0.41%

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

华夏红利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

(2005年6月30日至2016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、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。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。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 2016 年 6 月 30 日数据），华夏策略混合在 75 只灵活配置混合型基金（股票上限 80%）中排名第 8，华夏沪深 300 指数增强 A 在 39 只增强指数股票型基金中排名第 11；固定收益类产品中，华夏理财 30 天债券在 41 只短期理财债券型基金中排名第 9，华夏薪金宝货币在 194 只货币型基金中排名第 13。

在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖。在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”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）实现资产证明和对账单自动获取，客户可以自助提交申请并查询办理进度，业务处理更加高效；（2）网上交易平台上线交通银行、招商银行、民生银行、邮政储蓄银行等快捷支付方式和华夏财富系统，并与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，拓宽客户交易通道，增加交易便利性；（3）开展“130 万人定投的华夏红利”、“客户个性化白皮书”、“你定，我投”、“书写华夏印象，见证一个行业”等活动，为客户提供多样化的关怀服务。

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		
赵航	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2011-01-18	-	19 年	中南财经大学投资经济专业硕士。曾任大鹏证券资产管理中心投资经理、长城证券投资银行部项目经

					理、鹏华基金原普华证券投资基金基金经理（2003 年 4 月 10 日至 2005 年 5 月 21 日期间）等。2005 年 10 月加入原中信基金，曾任中信红利精选股票型证券投资基金基金经理（2008 年 5 月 19 日至 2009 年 4 月 18 日期间），华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2009 年 8 月 7 日至 2011 年 11 月 7 日期间）等。
彭海伟	本基金的基金经理、股票投资部总监	2014-01-17	-	12 年	中国科学院管理科学与工程硕士。2004 年 9 月加入原中信基金，曾任研究员，华夏基金研究员、基金经理助理等。
陈虎	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2014-11-21	-	8 年	清华大学博士。曾任南方基金研究员、基金经理助理、南方恒元保本混合型证券投资基金基金经理（2012 年 12 月 14 日至 2014 年 7 月 18 日期间）等。2014 年 8 月加入华夏基金管理有限公司。
刘金玉	本基金的基金经理、股票投资部总监	2015-01-07	-	14 年	南京大学管理学硕士。曾任中国平安保险集团资产管理中心研究员，华夏基金管理有限公司行业研究主管，泰达宏利基金研究部副总监、泰达宏利价值优化型周期类行业证券投资基金基金经理（2010 年 3 月 5 日至 2013 年 7 月 24 日期间）、泰达

					宏利首选企业股票型证券投资基金基金经理（2011年3月8日至2013年7月24日期间）等。2013年8月起任职于华夏基金管理有限公司。
蔡向阳	本基金的基金经理、股票投资部高级副总裁	2016-04-08	-	10 年	中国农业大学金融学硕士。曾任天相投资顾问有限公司、新华资产管理股份有限公司研究员等。2007年10月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、投资经理等。

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，国内宏观经济运行平稳。1 季度，出于对稳增长和防风险的需求，货币政策一度偏松，但带来的负面影响就是房地产价格出现全面上涨和部分上游原材料价格呈现上涨趋势。5 月初权威人士发表讲话以后，宏观政策出现调整，重新把供给侧改革放在首要位置。股市方面，A 股年初在人民币汇率贬值以及熔断机制的双重打击下出现一轮暴跌，随后从 2 月份开始企稳，并逐步震荡向上，尤其是 5 月中旬以后，市场活跃度明显上升，结构性机会明显。

报告期内，本基金仓位变化不大，主要是在结构上进行了微调。年初，由于仓位较高，净值损失较大，随后在 1 月底 2 月初小幅加仓抄底。2 季度以来，继续减持风险收益比不佳的高估值股票，增持了业绩稳定增长且估值合理的股票，同时少量增持了部分周期性行业的股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.377 元，本报告期份额净值增长率为-19.09%，同期业绩比较基准增长率为-9.91%。

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，市场依然面临较多的不确定性。首先，全球经济增长放缓，英国脱欧造成的长远影响尚有巨大的未知数，美国的经济先行指标也在弱化，在这样的全球背景下，中国经济很难独善其身；其次，今年国内宏观政策最大的着力点就是供给侧改革，而供给侧改革虽然长期来看是中国经济浴火重生的苦口良药，但短期也会带来不小的阵痛；再次，目前股市以高估值小盘题材股为代表的结构性泡沫依然突出，而新一届监管层对于并购重组的监管明显加强，因此过去三年市场最流行的并购增长模式受到较大的挑战；最后，今年宏观政策引导资金脱虚向实，因此股市难以出现大规模的增量资金，属于典型的存量博弈阶段，很难出现投资者期待中的单边上涨行情。

下半年，本基金将重点在以下几个方面做好投资：第一、加强对宏观经济和国际外围市场的持续跟踪与研究，尤其是对通胀和货币政策的研究，力求规避大级别的风险；第二、继续深入挖掘景气向上，能持续增长的优秀行业和公司，并在估值合理的时机重点配置；第三、下半年通胀可能持续温和回升，挖掘受益于

通胀的消费类、资源类个股，关注有涨价预期的品种；第四、围绕供给侧改革和国企改革，进行个股挖掘。

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、合规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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：华夏红利混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,079,726,576.94	671,310,060.61
结算备付金		411,219,602.42	36,281,081.43
存出保证金		1,857,340.85	3,951,931.67
交易性金融资产	6.4.7.2	9,916,805,616.00	13,125,777,522.85
其中：股票投资		9,586,992,616.00	12,835,607,522.85
基金投资		-	-
债券投资		329,813,000.00	290,170,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	497,600,968.80	200,000,220.00
应收证券清算款		5,314,627.62	-
应收利息	6.4.7.5	3,914,432.29	4,965,617.27
应收股利		-	-
应收申购款		1,558,313.59	8,182,789.74

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,917,997,478.51	14,050,469,223.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		190,000,000.00	-
应付证券清算款		22,716,444.92	146,535,869.79
应付赎回款		23,196,010.60	29,654,983.64
应付管理人报酬		14,046,910.46	17,094,414.72
应付托管费		2,341,151.75	2,849,069.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	66,583,222.58	84,265,312.93
应交税费		249,575.60	249,575.60
应付利息		42,952.70	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	756,490.53	951,763.80
负债合计		319,932,759.14	281,600,989.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,880,201,516.17	4,686,928,447.91
未分配利润	6.4.7.10	6,717,863,203.20	9,081,939,786.07
所有者权益合计		11,598,064,719.37	13,768,868,233.98
负债和所有者权益总计		11,917,997,478.51	14,050,469,223.57

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.377 元，基金份额总额 4,880,201,516.17 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	-----	--	---

一、收入		-2,495,489,282.55	7,633,864,201.82
1.利息收入		8,046,009.79	17,287,139.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,319,201.44	3,157,070.35
债券利息收入		3,299,734.12	12,445,737.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		427,074.23	1,684,332.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-316,372,338.41	5,884,331,253.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-368,377,349.09	5,808,316,631.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-84,710.00	7,439,418.67
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	52,089,720.68	68,575,203.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-2,188,227,435.37	1,720,700,368.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,064,481.44	11,545,440.28
减：二、费用		120,323,932.17	217,446,872.39
1.管理人报酬		84,526,135.75	127,227,910.90
2.托管费		14,087,689.33	21,204,651.80
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	21,429,889.37	65,067,522.06
5.利息支出		64,776.90	3,733,299.22
其中：卖出回购金融资产支出		64,776.90	3,733,299.22
6.其他费用	6.4.7.21	215,440.82	213,488.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,615,813,214.72	7,416,417,329.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,615,813,214.72	7,416,417,329.43

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏红利混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	4,686,928,447.91	9,081,939,786.07	13,768,868,233.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,615,813,214.72	-2,615,813,214.72
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）	193,273,068.26	251,736,631.85	445,009,700.11
其中：1.基金申购款	553,597,203.06	742,943,353.13	1,296,540,556.19
2.基金赎回款	-360,324,134.80	-491,206,721.28	-851,530,856.08
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）	4,880,201,516.17	6,717,863,203.20	11,598,064,719.37
项目	上年度可比期间		
	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）	7,880,553,361.17	7,306,763,964.27	15,187,317,325.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,416,417,329.43	7,416,417,329.43
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）	-2,734,264,301.72	-4,727,628,910.77	-7,461,893,212.49
其中：1.基金申购款	606,842,573.74	1,167,302,454.56	1,774,145,028.30
2.基金赎回款	-3,341,106,875.46	-5,894,931,365.33	-9,236,038,240.79
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）	5,146,289,059.45	9,995,552,382.93	15,141,841,442.38

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 基金基本情况

华夏红利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]68号文《关于同意华夏红利混合型开放式证券投资基金投资募集的批复》核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 769,853,399.75 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京（验）报字（05）第 010 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 770,195,182.55 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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报表所采用的会计政策、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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债及政策性金融债券利息收入、质押式买入返售金融商品利息收入、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税。

5、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期

限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。

6、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,079,726,576.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,079,726,576.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,578,063,889.53	9,586,992,616.00	1,008,928,726.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	239,858,109.58	239,660,000.00
	银行间市场	90,547,150.00	90,153,000.00
	合计	330,405,259.58	329,813,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,908,469,149.11	9,916,805,616.00	1,008,336,466.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	497,600,968.80	-
合计	497,600,968.80	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	361,382.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	23,048.80
应收债券利息	3,500,689.49
应收买入返售证券利息	28,475.57
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	835.80
合计	3,914,432.29

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	66,577,886.03
银行间市场应付交易费用	5,336.55
合计	66,583,222.58

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	87,419.81
预提费用	169,070.72
合计	756,490.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,686,928,447.91	4,686,928,447.91
本期申购	553,597,203.06	553,597,203.06
本期赎回（以“-”号填列）	-360,324,134.80	-360,324,134.80
本期末	4,880,201,516.17	4,880,201,516.17

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,198,524,950.11	3,883,414,835.96	9,081,939,786.07
本期利润	-427,585,779.35	-2,188,227,435.37	-2,615,813,214.72
本期基金份额交易产生的变动数	210,426,773.55	41,309,858.30	251,736,631.85
其中：基金申购款	592,323,402.30	150,619,950.83	742,943,353.13
基金赎回款	-381,896,628.75	-109,310,092.53	-491,206,721.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,981,365,944.31	1,736,497,258.89	6,717,863,203.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	活期存款利息收入	4,165,960.63
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	131,771.47	
其他	21,469.34	
合计	4,319,201.44	

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,733,259,278.27
减：卖出股票成本总额	8,101,636,627.36
买卖股票差价收入	-368,377,349.09

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	203,768,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	199,183,910.00
减：应收利息总额	4,668,800.00
买卖债券差价收入	-84,710.00

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	52,089,720.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	52,089,720.68

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-2,188,227,435.37
——股票投资	-2,187,196,235.79
——债券投资	-1,031,199.58
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-2,188,227,435.37

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	1,064,481.44
合计	1,064,481.44

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	21,429,889.37
银行间市场交易费用	-
合计	21,429,889.37

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
审计费用	49,726.04	
信息披露费	119,344.68	
银行费用	27,570.10	
银行间账户维护费	18,000.00	
其他	800.00	
合计	215,440.82	

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	551,543,865.16	3.73%	4,389,909,070.57	10.49%
------	----------------	-------	------------------	--------

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	513,653.00	4.15%	513,653.00	0.77%
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	3,996,576.58	11.19%	3,996,576.58	4.25%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	84,526,135.75	127,227,910.90
其中：支付销售机构的客户维护费	13,363,200.35	20,650,122.43

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	14,087,689.33		21,204,651.80

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至 2015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
中国建设银行	1,079,726,576.94	4,165,960.63	1,058,569,172.36	2,679,709.30

活期存款				
------	--	--	--	--

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300001	特锐德	2015-11-30	2018-12-01	非公开发行流通受限	8.26	10.87	4,480,000	37,004,800.00	48,697,600.00	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新发流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新发流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新发流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新发流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 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
002280	联络互动	2016-04-25	重大事项	19.71	-	-	5,110,475	45,803,959.20	100,727,462.25	-
600139	西部资源	2016-04-11	重大事项	12.31	2016-08-15	12.99	6,317,039	108,204,009.37	77,762,750.09	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事项	27.47	-	-	2,427,021	38,457,134.37	66,670,266.87	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大	22.35	-	-	2,859,804	32,066,877.45	63,916,619.40	-

			事项							
000893	东凌国际	2016-01-15	重大事项	14.26	2016-07-12	12.00	4,317,953	53,541,613.78	61,574,009.78	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项	12.44	-	-	4,759,364	31,948,375.21	59,206,488.16	-
600896	中海海盛	2016-05-23	重大事项	10.54	-	-	5,243,838	62,737,271.03	55,270,052.52	-
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项	14.45	2016-07-28	14.00	2,064,590	25,982,448.67	29,833,325.50	-
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大事项	10.60	2016-07-14	11.32	2,341,136	26,837,350.28	24,816,041.60	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项	34.99	2016-08-12	36.69	599,909	22,241,714.80	20,990,815.91	-
600759	洲际油气	2016-06-27	重大事项	7.58	2016-07-11	8.10	2,674,900	24,700,798.85	20,275,742.00	-
600455	博通股份	2016-05-05	重大事项	49.14	-	-	263,055	11,978,428.59	12,926,522.70	-
600385	山东金泰	2016-04-26	重大事项	22.84	2016-08-05	20.56	510,000	11,984,324.19	11,648,400.00	-
300308	中际装备	2016-03-11	重大事项	12.36	-	-	499,902	9,703,256.62	6,178,788.72	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-
300508	维宏股份	2016-06-30	重大事项	254.50	2016-07-06	242.00	358	7,188.64	91,111.00	-
603919	金徽酒	2016-06-06	重大事项	30.90	2016-07-05	33.99	2,311	25,282.34	71,409.90	-
300503	昊志机电	2016-06-30	重大事项	84.72	2016-07-05	87.77	652	5,033.44	55,237.44	-
603808	歌力思	2016-04-20	重大事项	29.13	2016-07-20	31.50	750	24,561.11	21,847.50	-

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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 190,000,000.00 元，分别于 2016 年 7 月 4 日前先后

到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及

时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合久期、Beta 值等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	1,079,726,576.94	-	-	1,079,726,576.94
结算备付金	411,219,602.42	-	-	411,219,602.42
结算保证金	1,857,340.85	-	-	1,857,340.85
债券投资	329,813,000.00	-	-	329,813,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	497,600,968.80	-	-	497,600,968.80
应收直销申购款	62,983.17	-	-	62,983.17
卖出回购金融资产款	190,000,000.00	-	-	190,000,000.00
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
银行存款	671,310,060.61	-	-	671,310,060.61
结算备付金	36,281,081.43	-	-	36,281,081.43
结算保证金	3,951,931.67	-	-	3,951,931.67
债券投资	290,170,000.00	-	-	290,170,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
买入返售金融资产	200,000,220.00	-	-	200,000,220.00
应收直销申购款	142,170.94	-	-	142,170.94
卖出回购金融资产款	-	-	-	-

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	利率下降 25 个基点	553,950.62	171,726.23
	利率上升 25 个基点	-552,901.81	-171,689.96

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	9,586,992,616.00	82.66	12,835,607,522.85	93.22
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	9,586,992,616.00	82.66	12,835,607,522.85	93.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。

	3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016 年 6 月 30 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	+5%	692,228,801.84	719,628,335.77
	-5%	-692,228,801.84	-719,628,335.77

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 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 9,451,904,964.62 元，第二层次的余额为 464,900,651.38 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 12,066,724,680.67 元，第二层次的余额为 1,059,052,842.18 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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	9,586,992,616.00	80.44
	其中：股票	9,586,992,616.00	80.44
2	固定收益投资	329,813,000.00	2.77
	其中：债券	329,813,000.00	2.77
	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	497,600,968.80	4.18
	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	1,490,946,179.36	12.51
7	其他各项资产	12,644,714.35	0.11
8	合计	11,917,997,478.51	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	211,557,944.40	1.82
B	采矿业	239,292,383.81	2.06
C	制造业	5,943,170,564.80	51.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,861,975.88	0.35

E	建筑业	114,151,973.32	0.98
F	批发和零售业	385,110,934.85	3.32
G	交通运输、仓储和邮政业	63,785,232.52	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	658,533,731.76	5.68
J	金融业	461,584,651.49	3.98
K	房地产业	196,047,413.87	1.69
L	租赁和商务服务业	318,351,100.40	2.74
M	科学研究和技术服务业	13,991,146.40	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	541,019,492.88	4.66
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	367,559,522.92	3.17
S	综合	31,974,546.70	0.28
	合计	9,586,992,616.00	82.66

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300267	尔康制药	49,104,534	703,176,926.88	6.06
2	300070	碧水源	32,699,803	486,573,068.64	4.20
3	600666	奥瑞德	9,971,357	346,604,369.32	2.99
4	600887	伊利股份	18,038,607	300,703,578.69	2.59
5	300058	蓝色光标	20,636,024	200,375,793.04	1.73
6	002690	美亚光电	8,240,796	189,867,939.84	1.64
7	300188	美亚柏科	7,020,118	187,015,943.52	1.61
8	601801	皖新传媒	15,741,070	183,698,286.90	1.58
9	300336	新文化	6,188,644	154,592,327.12	1.33
10	001696	宗申动力	13,831,124	151,035,874.08	1.30
11	002551	尚荣医疗	6,359,975	148,696,215.50	1.28
12	002436	兴森科技	6,211,421	141,558,284.59	1.22
13	002299	圣农发展	5,344,032	138,410,428.80	1.19
14	002292	奥飞娱乐	4,599,678	137,760,356.10	1.19
15	300017	网宿科技	2,026,867	136,205,462.40	1.17
16	300145	中金环境	5,713,296	125,006,916.48	1.08
17	600036	招商银行	6,725,100	117,689,250.00	1.01

18	002522	浙江众成	6,158,687	115,475,381.25	1.00
19	000055	方大集团	5,827,699	109,677,295.18	0.95
20	002280	联络互动	5,110,475	100,727,462.25	0.87
21	002051	中工国际	5,023,999	98,822,060.33	0.85
22	000779	三毛派神	4,314,298	96,855,990.10	0.84
23	002219	恒康医疗	8,750,000	96,687,500.00	0.83
24	600211	西藏药业	2,158,063	95,731,674.68	0.83
25	000001	平安银行	10,863,109	94,509,048.30	0.81
26	600016	民生银行	10,357,051	92,488,465.43	0.80
27	601012	隆基股份	6,993,124	91,260,268.20	0.79
28	600000	浦发银行	5,776,715	89,943,452.55	0.78
29	600048	保利地产	10,139,300	87,502,159.00	0.75
30	002043	兔宝宝	8,649,913	86,758,627.39	0.75
31	000709	河钢股份	29,571,907	81,914,182.39	0.71
32	600690	青岛海尔	8,868,639	78,753,514.32	0.68
33	600139	西部资源	6,317,039	77,762,750.09	0.67
34	002171	楚江新材	4,463,039	76,898,161.97	0.66
35	000423	东阿阿胶	1,359,919	71,844,520.77	0.62
36	601166	兴业银行	4,374,825	66,672,333.00	0.57
37	300166	东方国信	2,427,021	66,670,266.87	0.57
38	600576	万家文化	2,859,804	63,916,619.40	0.55
39	002456	欧菲光	2,102,274	62,017,083.00	0.53
40	000893	东凌国际	4,317,953	61,574,009.78	0.53
41	000902	新洋丰	4,877,200	61,013,772.00	0.53
42	002465	海格通信	4,759,364	59,206,488.16	0.51
43	000963	华东医药	854,586	57,599,096.40	0.50
44	000807	云铝股份	8,778,263	57,497,622.65	0.50
45	300273	和佳股份	2,966,892	56,815,981.80	0.49
46	300156	神雾环保	2,693,155	55,425,129.90	0.48
47	600830	香溢融通	5,900,000	55,342,000.00	0.48
48	000860	顺鑫农业	2,325,293	55,295,467.54	0.48
49	600896	中海海盛	5,243,838	55,270,052.52	0.48
50	600459	贵研铂业	1,788,300	53,434,404.00	0.46
51	002234	民和股份	1,804,990	53,084,755.90	0.46
52	300236	上海新阳	1,033,335	52,276,417.65	0.45
53	600395	盘江股份	6,055,050	50,014,713.00	0.43
54	600303	曙光股份	3,289,608	48,850,678.80	0.42

55	300001	特锐德	4,480,000	48,697,600.00	0.42
56	000858	五粮液	1,439,773	46,835,815.69	0.40
57	002037	久联发展	2,827,567	45,750,034.06	0.39
58	000800	一汽轿车	4,177,859	45,455,105.92	0.39
59	600779	水井坊	2,685,047	44,652,331.61	0.38
60	000983	西山煤电	5,466,000	44,547,900.00	0.38
61	600592	龙溪股份	4,227,722	44,052,863.24	0.38
62	002616	长青集团	1,999,510	41,389,857.00	0.36
63	000831	*ST 五稀	3,134,500	41,312,710.00	0.36
64	300182	捷成股份	2,398,552	41,039,224.72	0.35
65	600505	西昌电力	4,580,939	40,861,975.88	0.35
66	300199	翰宇药业	1,990,435	40,505,352.25	0.35
67	002385	大北农	4,980,382	40,141,878.92	0.35
68	000069	华侨城 A	6,226,386	39,848,870.40	0.34
69	300232	洲明科技	2,490,923	39,481,129.55	0.34
70	600197	伊力特	2,617,946	39,373,907.84	0.34
71	300296	利亚德	1,192,860	37,765,947.60	0.33
72	002467	二六三	2,446,903	37,706,775.23	0.33
73	002007	华兰生物	1,199,872	37,675,980.80	0.32
74	002188	巴士在线	1,299,856	37,604,834.08	0.32
75	600861	北京城乡	2,799,998	37,491,973.22	0.32
76	601888	中国国旅	819,587	36,045,436.26	0.31
77	600529	山东药玻	1,999,910	35,218,415.10	0.30
78	600549	厦门钨业	1,184,548	35,192,921.08	0.30
79	002277	友阿股份	2,999,941	34,559,320.32	0.30
80	002180	艾派克	1,203,195	34,327,153.35	0.30
81	002035	华帝股份	1,359,172	33,272,530.56	0.29
82	002396	星网锐捷	1,672,112	32,940,606.40	0.28
83	600693	东百集团	4,872,104	32,740,538.88	0.28
84	002572	索菲亚	549,787	30,799,067.74	0.27
85	000596	古井贡酒	641,310	30,750,814.50	0.27
86	002508	老板电器	825,090	30,338,559.30	0.26
87	300136	信维通信	1,439,757	30,177,306.72	0.26
88	002587	奥拓电子	2,064,590	29,833,325.50	0.26
89	002426	胜利精密	3,015,750	29,705,137.50	0.26
90	000681	视觉中国	1,237,586	29,268,908.90	0.25
91	002650	加加食品	4,097,500	29,133,225.00	0.25

92	300302	同有科技	892,187	28,969,311.89	0.25
93	600177	雅戈尔	2,000,000	27,580,000.00	0.24
94	002454	松芝股份	1,499,973	27,269,509.14	0.24
95	002450	康得新	1,586,724	27,132,980.40	0.23
96	601607	上海医药	1,500,000	27,075,000.00	0.23
97	600151	航天机电	2,361,900	26,689,470.00	0.23
98	002662	京威股份	1,754,700	26,513,517.00	0.23
99	000910	大亚科技	1,647,575	25,455,033.75	0.22
100	300065	海兰信	649,964	25,140,607.52	0.22
101	000401	冀东水泥	2,341,136	24,816,041.60	0.21
102	600056	中国医药	1,542,400	24,462,464.00	0.21
103	600271	航天信息	999,946	23,798,714.80	0.21
104	002701	奥瑞金	2,682,325	23,684,929.75	0.20
105	600171	上海贝岭	1,353,242	23,505,813.54	0.20
106	002370	亚太药业	791,000	23,334,500.00	0.20
107	300230	永利股份	799,951	23,262,575.08	0.20
108	002048	宁波华翔	1,000,000	22,870,000.00	0.20
109	300210	森远股份	1,278,100	22,852,428.00	0.20
110	002511	中顺洁柔	1,326,378	22,588,217.34	0.19
111	600192	长城电工	2,105,100	22,566,672.00	0.19
112	002737	葵花药业	599,938	22,479,676.86	0.19
113	002644	佛慈制药	1,999,949	22,419,428.29	0.19
114	600259	广晟有色	387,900	22,211,154.00	0.19
115	002353	杰瑞股份	1,148,600	22,145,008.00	0.19
116	300014	亿纬锂能	506,419	21,872,236.61	0.19
117	000523	广州浪奇	1,999,969	21,739,663.03	0.19
118	000937	冀中能源	4,000,000	21,280,000.00	0.18
119	300242	明家联合	599,909	20,990,815.91	0.18
120	600826	兰生股份	800,000	20,944,000.00	0.18
121	600683	京投发展	2,252,062	20,809,052.88	0.18
122	000032	深桑达 A	1,352,901	20,685,856.29	0.18
123	002131	利欧股份	1,199,752	20,503,761.68	0.18
124	600759	洲际油气	2,674,900	20,275,742.00	0.17
125	000581	威孚高科	1,000,000	20,160,000.00	0.17
126	002746	仙坛股份	479,744	19,995,729.92	0.17
127	000532	力合股份	1,048,900	19,048,024.00	0.16
128	002400	省广股份	1,299,923	18,367,911.99	0.16

129	002311	海大集团	1,126,300	17,761,751.00	0.15
130	002335	科华恒盛	360,800	17,506,016.00	0.15
131	600240	华业资本	1,745,700	17,491,914.00	0.15
132	300103	达刚路机	920,324	17,210,058.80	0.15
133	002719	麦趣尔	349,900	16,998,142.00	0.15
134	002305	南国置业	3,020,900	16,977,458.00	0.15
135	002136	安纳达	1,068,789	16,801,363.08	0.14
136	300011	鼎汉技术	700,000	16,429,000.00	0.14
137	300269	联建光电	600,000	15,588,000.00	0.13
138	300123	太阳鸟	1,099,964	15,443,494.56	0.13
139	603898	好莱客	492,703	15,318,136.27	0.13
140	300390	天华超净	880,258	15,193,253.08	0.13
141	002279	久其软件	679,110	15,062,659.80	0.13
142	601155	新城控股	1,609,424	14,903,266.24	0.13
143	600706	曲江文旅	816,418	14,597,553.84	0.13
144	000928	中钢国际	1,151,300	14,483,354.00	0.12
145	002034	美欣达	400,000	14,392,000.00	0.12
146	600703	三安光电	700,000	13,979,000.00	0.12
147	000830	鲁西化工	3,000,000	13,560,000.00	0.12
148	000911	南宁糖业	535,800	13,437,864.00	0.12
149	300316	晶盛机电	999,940	13,099,214.00	0.11
150	600455	博通股份	263,055	12,926,522.70	0.11
151	000593	大通燃气	990,000	12,434,400.00	0.11
152	002588	史丹利	1,000,000	12,350,000.00	0.11
153	300131	英唐智控	999,980	11,809,763.80	0.10
154	600385	山东金泰	510,000	11,648,400.00	0.10
155	600737	中粮屯河	999,904	11,548,891.20	0.10
156	300159	新研股份	599,981	10,829,657.05	0.09
157	600325	华发股份	974,125	10,783,563.75	0.09
158	600406	国电南瑞	800,000	10,696,000.00	0.09
159	300263	隆华节能	952,000	10,643,360.00	0.09
160	600879	航天电子	677,600	10,557,008.00	0.09
161	002589	瑞康医药	341,100	10,475,181.00	0.09
162	600885	宏发股份	339,100	10,413,761.00	0.09
163	600855	航天长峰	330,603	10,347,873.90	0.09
164	600501	航天晨光	544,500	10,018,800.00	0.09
165	600110	诺德股份	1,000,000	9,840,000.00	0.08

166	000812	陕西金叶	1,000,000	9,730,000.00	0.08
167	300365	恒华科技	205,700	9,410,775.00	0.08
168	600420	现代制药	299,921	8,967,637.90	0.08
169	300031	宝通科技	336,620	8,590,542.40	0.07
170	002327	富安娜	999,977	8,509,804.27	0.07
171	000089	深圳机场	1,000,000	8,500,000.00	0.07
172	603366	日出东方	999,924	8,399,361.60	0.07
173	300008	天海防务	249,901	8,321,703.30	0.07
174	000650	仁和药业	1,000,000	8,160,000.00	0.07
175	600538	国发股份	600,000	7,872,000.00	0.07
176	000820	金城股份	433,000	7,794,000.00	0.07
177	300258	精锻科技	467,100	7,548,336.00	0.07
178	603686	龙马环卫	200,000	7,294,000.00	0.06
179	300041	回天新材	500,000	7,195,000.00	0.06
180	002205	国统股份	300,000	7,152,000.00	0.06
181	002196	方正电机	200,000	6,838,000.00	0.06
182	002169	智光电气	299,950	6,823,862.50	0.06
183	300140	启源装备	307,000	6,815,400.00	0.06
184	600213	亚星客车	500,000	6,380,000.00	0.06
185	600869	智慧能源	600,000	6,180,000.00	0.05
186	300308	中际装备	499,902	6,178,788.72	0.05
187	600992	贵绳股份	500,000	6,175,000.00	0.05
188	600963	岳阳林纸	1,000,000	6,120,000.00	0.05
189	002206	海利得	344,600	5,902,998.00	0.05
190	300097	智云股份	116,600	5,835,830.00	0.05
191	002116	中国海诚	376,000	5,587,360.00	0.05
192	002296	辉煌科技	300,000	5,445,000.00	0.05
193	002138	顺络电子	300,000	5,439,000.00	0.05
194	600057	象屿股份	483,104	4,966,309.12	0.04
195	000985	大庆华科	199,960	4,945,010.80	0.04
196	000404	华意压缩	512,500	4,930,250.00	0.04
197	300204	舒泰神	246,328	4,542,288.32	0.04
198	000925	众合科技	227,628	4,393,220.40	0.04
199	300025	华星创业	300,000	4,302,000.00	0.04
200	002068	黑猫股份	525,600	4,099,680.00	0.04
201	300084	海默科技	261,876	3,200,124.72	0.03
202	600735	新华锦	220,500	3,093,615.00	0.03

203	000403	ST 生化	100,000	2,959,000.00	0.03
204	002064	华峰氨纶	530,200	2,544,960.00	0.02
205	002054	德美化工	213,674	2,314,089.42	0.02
206	300260	新莱应材	52,629	1,887,275.94	0.02
207	600285	羚锐制药	100,000	1,079,000.00	0.01
208	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.01
209	603688	石英股份	32,417	674,921.94	0.01
210	002797	第一创业	6,981	282,102.21	0.00
211	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.00
212	000021	深科技	21,500	236,715.00	0.00
213	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
214	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
215	300474	景嘉微	864	130,351.68	0.00
216	603528	多伦科技	1,089	106,711.11	0.00
217	002792	通宇通讯	1,725	103,155.00	0.00
218	300508	维宏股份	358	91,111.00	0.00
219	002791	坚朗五金	1,456	78,289.12	0.00
220	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
221	603919	金徽酒	2,311	71,409.90	0.00
222	300511	雪榕生物	1,006	67,029.78	0.00
223	300512	中亚股份	655	65,447.60	0.00
224	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
225	300513	恒泰实达	500	62,485.00	0.00
226	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
227	300503	昊志机电	652	55,237.44	0.00
228	603339	四方冷链	977	53,168.34	0.00
229	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
230	603779	威龙股份	986	41,372.56	0.00
231	603959	百利科技	980	40,621.00	0.00
232	300505	川金诺	662	40,024.52	0.00
233	002789	建艺集团	525	37,632.00	0.00
234	603101	汇嘉时代	1,247	37,185.54	0.00
235	603798	康普顿	556	35,522.84	0.00
236	002795	永和智控	508	34,584.64	0.00
237	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
238	603028	赛福天	1,158	34,056.78	0.00
239	300506	名家汇	637	33,652.71	0.00

240	300510	金冠电气	478	32,293.68	0.00
241	002793	东音股份	494	32,114.94	0.00
242	300485	赛升药业	600	27,876.00	0.00
243	002768	国恩股份	900	27,090.00	0.00
244	603029	天鹅股份	566	25,260.58	0.00
245	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
246	603726	朗迪集团	477	24,112.35	0.00
247	603808	歌力思	750	21,847.50	0.00
248	002776	柏堡龙	600	21,336.00	0.00
249	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
250	603223	恒通股份	500	15,180.00	0.00
251	300442	普丽盛	300	13,608.00	0.00
252	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
253	300476	胜宏科技	500	12,320.00	0.00
254	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
255	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
256	002365	永安药业	1	18.21	0.00

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	600666	奥瑞德	273,255,716.16	1.98
2	000800	一汽轿车	202,053,448.85	1.47
3	300058	蓝色光标	194,876,523.63	1.42
4	000423	东阿阿胶	136,412,391.15	0.99
5	000709	河钢股份	104,238,389.79	0.76
6	000779	三毛派神	97,798,012.56	0.71
7	002522	浙江众成	96,582,163.89	0.70
8	002436	兴森科技	92,882,665.78	0.67
9	000055	方大集团	91,977,836.95	0.67
10	000963	华东医药	91,298,808.22	0.66
11	000926	福星股份	88,066,168.10	0.64
12	000860	顺鑫农业	88,048,945.88	0.64
13	000831	*ST 五稀	86,917,801.83	0.63
14	000983	西山煤电	86,832,866.82	0.63
15	601012	隆基股份	86,776,549.48	0.63

16	000858	五粮液	86,082,501.53	0.63
17	300017	网宿科技	79,933,269.74	0.58
18	002043	兔宝宝	76,935,266.54	0.56
19	002087	新野纺织	74,500,851.78	0.54
20	000902	新洋丰	68,304,476.86	0.50

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	000800	一汽轿车	321,323,960.33	2.33
2	600690	青岛海尔	219,297,977.29	1.59
3	002546	新联电子	141,835,831.30	1.03
4	601328	交通银行	138,322,331.45	1.00
5	300310	宜通世纪	128,733,523.41	0.93
6	002428	云南锗业	128,437,820.38	0.93
7	600887	伊利股份	124,663,347.26	0.91
8	600303	曙光股份	115,517,046.27	0.84
9	002299	圣农发展	112,813,422.08	0.82
10	300073	当升科技	107,722,529.15	0.78
11	002701	奥瑞金	101,906,433.91	0.74
12	002714	牧原股份	93,357,083.60	0.68
13	000926	福星股份	87,143,949.30	0.63
14	600584	长电科技	86,369,604.88	0.63
15	600000	浦发银行	82,498,381.59	0.60
16	601888	中国国旅	78,642,343.03	0.57
17	000423	东阿阿胶	76,683,555.92	0.56
18	600325	华发股份	75,281,718.22	0.55
19	002087	新野纺织	72,162,921.49	0.52
20	000860	顺鑫农业	67,010,076.41	0.49

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	7,040,217,956.30
卖出股票收入（成交）总额	7,733,259,278.27

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	239,660,000.00	2.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,153,000.00	0.78
	其中：政策性金融债	90,153,000.00	0.78
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	329,813,000.00	2.84

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	019533	16 国债 05	2,000,000	199,880,000.00	1.72
2	130244	13 国开 44	500,000	50,365,000.00	0.43
3	110236	11 国开 36	400,000	39,788,000.00	0.34
4	020117	16 贴债 19	400,000	39,780,000.00	0.34
5	-	-	-	-	-

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	1,857,340.85
2	应收证券清算款	5,314,627.62
3	应收股利	-
4	应收利息	3,914,432.29
5	应收申购款	1,558,313.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,644,714.35

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
447,057	10,916.28	23,700,687.55	0.49%	4,856,500,828.62	99.51%

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	1,016,075.58	0.02%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年6月30日）基金份额总额	770,195,182.55
本报告期期初基金份额总额	4,686,928,447.91
本报告期基金总申购份额	553,597,203.06
减：本报告期基金总赎回份额	360,324,134.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,880,201,516.17

§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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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	
东兴证券	2	3,992,140,763.91	27.03%	2,919,453.71	23.57%	-
安信证券	1	1,957,470,794.66	13.25%	1,431,498.34	11.56%	-
国金证券	1	1,788,615,272.23	12.11%	1,665,735.90	13.45%	-
长江证券	1	1,485,841,824.42	10.06%	1,383,763.53	11.17%	-
中原证券	1	1,320,532,618.82	8.94%	1,229,812.34	9.93%	-
中泰证券	3	746,555,547.98	5.05%	545,955.84	4.41%	-

东北证券	1	731,441,999.82	4.95%	681,191.22	5.50%	-
海通证券	1	564,699,444.13	3.82%	525,902.85	4.25%	-
中信证券	1	551,543,865.16	3.73%	513,653.00	4.15%	-
平安证券	1	432,606,425.05	2.93%	402,887.74	3.25%	-
国信证券	1	421,336,491.48	2.85%	392,390.94	3.17%	-
兴业证券	1	321,185,401.56	2.17%	299,120.14	2.41%	-
光大证券	1	159,851,618.27	1.08%	148,867.21	1.20%	-
财通证券	1	145,389,006.48	0.98%	106,322.99	0.86%	-
中投证券	1	139,545,483.27	0.94%	129,959.76	1.05%	-
中信建投证券	5	13,181,389.74	0.09%	9,639.26	0.08%	-

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，本基金还选择了中国银河证券、瑞银证券、招商证券、国联证券、湘财证券、高华证券、广州证券、国泰君安证券、民生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，在上述租用的券商交易单元中，华泰证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

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
东兴证券	-	-	60,000,000.00	9.35%
国金证券	-	-	582,000,000.00	90.65%
中国银河证券	39,782,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
4	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
5	华夏基金管理有限公司关于调整中国建设银行储蓄卡基金电子交易优惠费率的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-21
6	华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-30
7	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增联讯证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-18
8	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增江苏江南农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-03
9	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
10	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04
11	关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在大同证券有限责任公司开通定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-08

12	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏红利混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-09
13	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
14	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄金融控股股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-10
15	关于停止支付宝基金专户电子交易开户及认购、申购、定期定额申购等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-13
16	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海中正达广投资管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-24
17	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-26

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 11.1.2 《华夏红利混合型证券投资基金基金合同》；
- 11.1.3 《华夏红利混合型证券投资基金托管协议》；
- 11.1.4 法律意见书；
- 11.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一六年八月二十七日