

华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业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。

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	华夏沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	华夏沪深300指数增强	
基金主代码	001015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月10日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	259,686,951.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	001015	001016
报告期末下属分级基金的份额总额	173,598,667.45份	86,088,284.32份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金主要通过采取股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	010-63136700	010-68121816

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）	
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
本期已实现收益	-12,833,062.15	-6,815,307.83
本期利润	-18,612,061.42	-9,247,009.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1111	-0.1071
本期加权平均净值利润率	-10.74%	-10.41%
本期基金份额净值增长率	-11.39%	-11.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）	
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
期末可供分配利润	12,765,188.56	5,681,315.83
期末可供分配基金份额利润	0.0735	0.0660
期末基金资产净值	186,363,856.01	91,769,600.15
期末基金份额净值	1.074	1.066
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）	
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
基金份额累计净值增长率	7.40%	6.60%

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

华夏沪深 300 指数增强 A:

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	1.61%	0.95%	-0.35%	0.93%	1.96%	0.02%
过去三个月	0.85%	1.04%	-1.52%	0.96%	2.37%	0.08%
过去六个月	-11.39%	1.89%	-13.95%	1.75%	2.56%	0.14%

过去一年	-20.62%	2.32%	-26.52%	2.19%	5.90%	0.13%
自基金合同生效起至今	7.40%	2.28%	-3.37%	2.18%	10.77%	0.10%

华夏沪深 300 指数增强 C:

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	1.52%	0.93%	-0.35%	0.93%	1.87%	0.00%
过去三个月	0.66%	1.03%	-1.52%	0.96%	2.18%	0.07%
过去六个月	-11.68%	1.89%	-13.95%	1.75%	2.27%	0.14%
过去一年	-21.04%	2.32%	-26.52%	2.19%	5.48%	0.13%
自基金合同生效起至今	6.60%	2.28%	-3.37%	2.18%	9.97%	0.10%

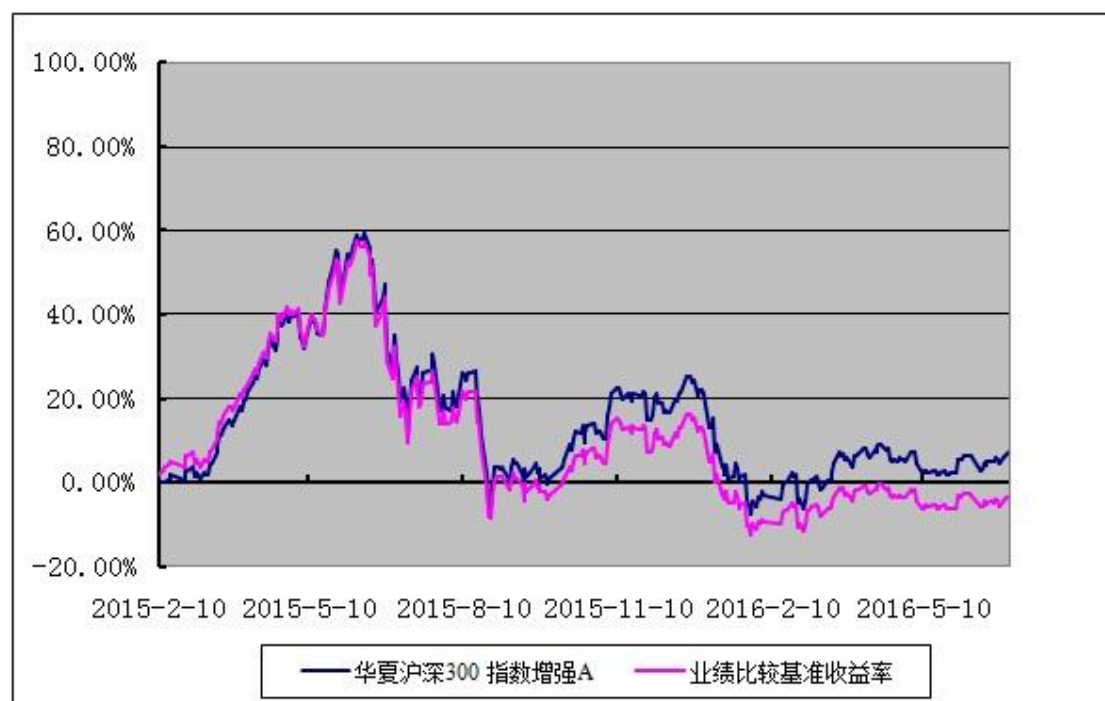
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

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

(2015 年 2 月 10 日至 2016 年 6 月 30 日)

华夏沪深 300 指数增强 A



华夏沪深 300 指数增强 C



注：根据华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

§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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理 10 只 ETF 产品，分别为华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF

和华夏沪港通恒生 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的 ETF 产品线。

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		
王路	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理、首席量化投资官	2015-02-10	-	18 年	博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008 年 11 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部总经理等。
周清	本基金的基金经理、数量投资部副总裁	2015-11-19	2016-05-31	6 年	北京大学应用数学专业硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 95\% + 1.5\%$ （指年收益率，评价时应按期间折算）。沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

上半年，国际方面，美国经济温和复苏，但由于就业改善放缓、通胀不达长期目标，以及外部不确定因素影响，美联储维持基准利率不变；日本 1 季度意外实施负利率；欧洲货币政策也较为宽松，英国脱欧公投及后续影响成为报告期内的重大不确定因素。国内方面，在供给侧结构性改革不断推进以及稳增长政策效应持续释放的共同作用下，上半年经济运行整体平稳，对经济发展新常态的认识

也不断深化，但经济增长压力、结构转型压力依然较大。报告期内，货币政策维持宽松，市场对通胀的担忧逐渐缓减。

市场方面，年初以来，受人民币短期快速贬值、资本流出压力加剧及相关监管措施实施等诸多因素影响，A 股经历了一波较大幅度的调整。之后随着人民币逐步企稳、市场监管措施调整及美元暂缓加息等因素影响，A 股逐渐企稳，并在一系列国际国内因素影响下维持震荡。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.074 元，本报告期份额净值增长率为-11.39%；华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.066 元，本报告期份额净值增长率为-11.68%，同期业绩比较基准增长率为-13.95%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+2.56%，C 类份额跟踪偏离度为+2.27%。

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，国际方面，美元的加息节奏仍是牵动市场神经的重要因素，同时英国脱欧谈判启动及后续风险以及全球民粹主义抬头、地缘政治风险发酵也是需要关注的因素。国内方面，经济仍面临较大的挑战，政府将切实推进供给侧结构性改革，一些实质性的改革举措或将陆续落地；财政政策料将积极有为，货币政策也会维持稳健。如果经济企稳或有超预期的改革举措，沪深 300 指数将会有较好的投资机会；反之，则可能呈震荡走势。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及超额收益。

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

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，若投资者不选择，默认是现金分红方式。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了

托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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：华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		28,740,662.05	29,699,299.09
结算备付金		6,750,612.14	7,791,966.10
存出保证金		4,731,279.82	5,018,892.84
交易性金融资产		241,118,569.13	222,361,336.53
其中：股票投资		241,049,086.43	222,279,537.33
基金投资		-	-
债券投资		69,482.70	81,799.20
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		-	-
应收利息		9,312.91	11,016.51

应收股利		-	-
应收申购款		50,170.43	231,689.78
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		281,400,606.48	265,114,200.85
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,258,102.14	1,010,774.98
应付管理人报酬		225,849.58	223,002.94
应付托管费		45,169.90	44,600.58
应付销售服务费		37,419.17	37,038.85
应付交易费用		620,574.08	787,889.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		80,035.45	164,872.01
负债合计		3,267,150.32	2,268,179.22
所有者权益：			
实收基金		259,686,951.77	217,130,717.97
未分配利润		18,446,504.39	45,715,303.66
所有者权益合计		278,133,456.16	262,846,021.63
负债和所有者权益总计		281,400,606.48	265,114,200.85

注：①报告截止日 2016 年 6 月 30 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.074 元，华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.066 元；华夏沪深 300 指数增强基金份额总额 259,686,951.77 份（其中 A 类 173,598,667.45 份，C 类 86,088,284.32 份）。

②本基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 2 月 10 日 (基金合同生效 日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-24,979,108.15	188,315,153.70
1.利息收入		167,975.68	926,875.20
其中：存款利息收入		167,892.62	227,515.11
债券利息收入		83.06	5.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	699,354.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,289,507.55	174,169,106.92
其中：股票投资收益		-18,046,342.10	167,440,482.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-1,835,580.00	4,280,420.00
股利收益		2,592,414.55	2,448,204.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,210,700.53	7,272,144.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		353,124.25	5,947,027.54
减：二、费用		2,879,962.36	6,353,784.94
1.管理人报酬		1,301,689.41	2,033,465.52
2.托管费		260,337.88	406,693.09
3.销售服务费		220,404.58	232,800.61
4.交易费用		1,018,298.71	3,569,858.75
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		79,231.78	110,966.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,859,070.51	181,961,368.76

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,859,070.51	181,961,368.76

注：本基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

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）	217,130,717.97	45,715,303.66	262,846,021.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,859,070.51	-27,859,070.51
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）	42,556,233.80	590,271.24	43,146,505.04
其中：1.基金申购款	114,696,956.56	3,352,973.70	118,049,930.26
2.基金赎回款	-72,140,722.76	-2,762,702.46	-74,903,425.22
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）	259,686,951.77	18,446,504.39	278,133,456.16
项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合同生效日）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）	688,241,559.41	-	688,241,559.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	181,961,368.76	181,961,368.76
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）	-442,159,027.56	-95,413,703.25	-537,572,730.81
其中：1.基金申购款	500,801,824.80	170,763,291.38	671,565,116.18

2.基金赎回款	-942,960,852.36	-266,176,994.63	-1,209,137,846.99
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）	246,082,531.85	86,547,665.51	332,630,197.36

注：本基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日。

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

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。

6.4.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
中信证券（山东）有限责任公司（“中信证券（山东）”）	基金管理人股东控股的公司、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

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。

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

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。

6.4.4.1.4 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。

6.4.4.1.5 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。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合同 生效日）至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,301,689.41	2,033,465.52
其中：支付销售机构的客户维护费	269,770.44	623,029.70

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 1.0% 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 × 1.0% / 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。

6.4.4.2.2 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 2 月 10 日（基金合同生 效日）至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的	260,337.88	406,693.09

托管费		
-----	--	--

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 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	108,928.55	108,928.55
中国农业银行	-	39,093.02	39,093.02
中信证券	-	568.10	568.10
中信证券（山东）	-	177.41	177.41
合计	-	148,767.08	148,767.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	合计
华夏基金管理有限公司	-	64,395.53	64,395.53
中国农业银行	-	106,980.43	106,980.43
中信证券	-	525.27	525.27
中信证券（山东）	-	182.19	182.19
合计	-	172,083.42	172,083.42

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.5%/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

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。

6.4.4.4.2 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 2016年1月1日至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年2月10日(基金合同生效日) 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
中国农业银行 活期存款	28,740,662.05	113,908.63	58,920,420.49	167,896.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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（2016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

金额单位：人民币元

6.4.5.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新发流通受限	12.98	12.98	2,103	27,296.94	27,296.94	-
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	-

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
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项	19.22	-	-	117,900	2,421,356.80	2,266,038.00	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	112,700	1,923,214.83	1,884,344.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	85,800	498,070.84	420,420.00	-
600139	西部资源	2016-04-11	重大事项	12.31	2016-08-15	12.99	30,800	324,208.00	379,148.00	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项	34.99	2016-08-12	36.69	9,100	309,861.00	318,409.00	-
002190	成飞集成	2016-04-21	重大事项	35.44	2016-07-12	38.98	7,400	289,166.00	262,256.00	-
600432	*ST 吉恩	2016-06-23	重大事项	7.10	2016-07-05	7.46	36,800	297,344.00	261,280.00	-
002089	新海宜	2016-01-08	重大事项	16.88	2016-07-18	18.55	9,100	166,760.77	153,608.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	7,109	24,668.23	148,720.28	-
000002	万科 A	2015-12-21	重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	6,991	98,764.22	127,236.20	-

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。

6.4.5.3 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 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。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，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 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 240,991,332.93 元，第二层次的余额为 127,236.20 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 219,568,261.53 元，第二层次的余额为 2,793,075.00 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

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。

6.4.6.4 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	241,049,086.43	85.66
	其中：股票	241,049,086.43	85.66
2	固定收益投资	69,482.70	0.02
	其中：债券	69,482.70	0.02
	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	35,491,274.19	12.61
7	其他各项资产	4,790,763.16	1.70
8	合计	281,400,606.48	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	6,764,196.50	2.43
C	制造业	78,910,171.57	28.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,809,650.00	3.89
E	建筑业	8,147,633.28	2.93
F	批发和零售业	3,814,669.82	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	10,861,304.00	3.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,005,773.40	3.96
J	金融业	84,241,767.72	30.29
K	房地产业	13,945,306.20	5.01
L	租赁和商务服务业	3,090,805.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,297,536.00	0.47
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	7,159,049.09	2.57
S	综合	864,416.00	0.31
	合计	241,049,086.43	86.67

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	601318	中国平安	265,600	8,509,824.00	3.06
2	600036	招商银行	400,213	7,003,727.50	2.52
3	601328	交通银行	1,205,800	6,788,654.00	2.44
4	000776	广发证券	317,100	5,314,596.00	1.91
5	601818	光大银行	1,345,200	5,057,952.00	1.82
6	601166	兴业银行	331,700	5,055,108.00	1.82
7	601398	工商银行	1,070,900	4,754,796.00	1.71
8	000001	平安银行	503,880	4,383,756.00	1.58
9	601211	国泰君安	212,800	3,785,712.00	1.36
10	600999	招商证券	218,100	3,598,650.00	1.29

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	600048	保利地产	5,858,524.00	2.23
2	601166	兴业银行	5,013,581.00	1.91
3	002415	海康威视	4,746,949.50	1.81
4	600999	招商证券	4,553,947.76	1.73
5	601377	兴业证券	4,503,310.15	1.71
6	600705	中航资本	4,376,142.37	1.66
7	601398	工商银行	4,329,499.00	1.65
8	601216	君正集团	3,870,885.92	1.47
9	601211	国泰君安	3,863,322.00	1.47
10	601555	东吴证券	3,761,695.11	1.43
11	000776	广发证券	3,722,735.59	1.42
12	600958	东方证券	3,447,198.00	1.31
13	600000	浦发银行	3,421,810.69	1.30
14	000858	五粮液	3,372,320.50	1.28
15	002304	洋河股份	3,225,130.15	1.23

16	600109	国金证券	3,183,602.29	1.21
17	600519	贵州茅台	3,166,120.08	1.20
18	000783	长江证券	3,068,356.43	1.17
19	000728	国元证券	3,062,165.83	1.17
20	000910	大亚科技	2,772,777.11	1.05

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	600705	中航资本	8,376,786.41	3.19
2	600016	民生银行	8,332,801.99	3.17
3	600837	海通证券	6,913,991.79	2.63
4	002304	洋河股份	4,888,355.22	1.86
5	600383	金地集团	4,616,419.00	1.76
6	601377	兴业证券	4,537,380.00	1.73
7	002415	海康威视	3,971,684.15	1.51
8	601216	君正集团	3,916,318.34	1.49
9	600340	华夏幸福	3,780,081.00	1.44
10	601555	东吴证券	3,672,955.00	1.40
11	600109	国金证券	3,664,527.00	1.39
12	600000	浦发银行	3,626,154.00	1.38
13	601688	华泰证券	3,553,424.00	1.35
14	000783	长江证券	3,363,360.70	1.28
15	300059	东方财富	3,197,713.29	1.22
16	601166	兴业银行	3,079,183.38	1.17
17	000910	大亚科技	2,910,273.73	1.11
18	600011	华能国际	2,800,452.00	1.07
19	000725	京东方 A	2,669,805.00	1.02
20	000728	国元证券	2,638,411.31	1.00

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	373,842,170.41
卖出股票收入（成交）总额	328,370,875.18

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	-	-
	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）	69,482.70	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	69,482.70	0.02

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	110031	航信转债	630	69,482.70	0.02
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)(单 位:手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1607	沪深 300 股 指期货 IF1607 合约	25	23,350,500.00	746,220.00	买入股指期货多头 合约的目的是进行 更有效地流动性管 理。
公允价值变动总额合计					746,220.00
股指期货投资本期收益					-1,835,580.00
股指期货投资本期公允价值变动					457,020.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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 2015 年 9 月 10 日广发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》。本基金为指数增强型基金，上述证券系标的指数成份股，投资决策程序符合相关法律法规的要求。

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	4,731,279.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,312.91
5	应收申购款	50,170.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,790,763.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	69,482.70	0.02

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

份额级别	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
华夏沪深 300 指数增强 A	7,518	23,091.07	1,650,914.06	0.95%	171,947,753.39	99.05%
华夏沪深 300 指数增强 C	4,453	19,332.65	-	-	86,088,284.32	100.00%

合计	11,971	21,693.00	1,650,914.06	0.64%	258,036,037.71	99.36%
----	--------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华夏沪深 300 指数增强 A	677,650.30	0.39%
	华夏沪深 300 指数增强 C	41,435.51	0.05%
	合计	719,085.81	0.28%

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	份额级别	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	华夏沪深 300 指数增强 A	50~100
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开 放式基金	华夏沪深 300 指数增强 A	0
	华夏沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
基金合同生效日（2015年2月10日）基金份额总额	578,687,452.07	109,554,107.34
本报告期期初基金份额总额	145,121,038.15	72,009,679.82
本报告期基金总申购份额	64,502,909.29	50,194,047.27
减：本报告期基金总赎回份额	36,025,279.99	36,115,442.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,598,667.45	86,088,284.32

§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	
长江证券	1	314,913,488.18	44.91%	293,279.37	47.26%	-
华泰证券	1	224,029,472.40	31.95%	208,638.25	33.62%	-
东吴证券	1	162,254,555.51	23.14%	118,656.46	19.12%	-

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，本基金还选择了安信证券、高华证券、光大证券、广发证券、国海证券、国泰君安证券、国信证券、海通证券、华西证券、申万宏源证券、西部证券、中国银河证券、中投证券、中信建投证券、中银国际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
-	-	-	-	-

华夏基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日