

**华夏沪深 300 指数增强型  
证券投资基金  
2016 年年度报告**

**2016 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

## §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 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	8
§5 托管人报告.....	13
§6 审计报告.....	14
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
8.12 投资组合报告附注.....	53
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§10 开放式基金份额变动.....	54
§11 重大事件揭示.....	55
§12 备查文件目录.....	59

## §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	253,828,679.02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	168,467,849.12份	85,360,829.90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	林葛
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市东城区建国门内 大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	杨明辉	周慕冰

## 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》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	2016 年		2015 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	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	1,025,564.99	-249,766.48	112,628,835.09	32,081,871.06
本期利润	-2,070,710.36	-1,273,313.23	122,012,243.39	19,580,860.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0123	-0.0149	0.5281	0.2257
本期加权平均净值利润率	-1.12%	-1.37%	44.44%	18.63%
本期基金份额净值增长率	-3.47%	-3.98%	21.20%	20.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	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	28,679,527.41	13,582,901.41	30,817,593.79	14,897,709.87
期末可供分配基金份额利润	0.1702	0.1591	0.2124	0.2069
期末基金资产	197,147,376.53	98,943,731.31	175,938,631.94	86,907,389.69

净值				
期末基金份额净值	1.170	1.159	1.212	1.207
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
	华夏沪深 300 指数增强 A	华夏沪深 300 指数增强 C	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	17.00%	15.90%	21.20%	20.70%

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
过去三个月	2.72%	0.68%	2.04%	0.67%	0.68%	0.01%
过去六个月	8.94%	0.73%	5.46%	0.72%	3.48%	0.01%
过去一年	-3.47%	1.42%	-9.22%	1.33%	5.75%	0.09%
自基金合同生效起至今	17.00%	1.98%	1.82%	1.90%	15.18%	0.08%

#### 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
过去三个月	2.57%	0.67%	2.04%	0.67%	0.53%	0.00%
过去六个月	8.72%	0.73%	5.46%	0.72%	3.26%	0.01%
过去一年	-3.98%	1.42%	-9.22%	1.33%	5.24%	0.09%
自基金合同生效起至今	15.90%	1.98%	1.82%	1.90%	14.08%	0.08%

### 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 12 月 31 日)

华夏沪深 300 指数增强 A



华夏沪深 300 指数增强 C

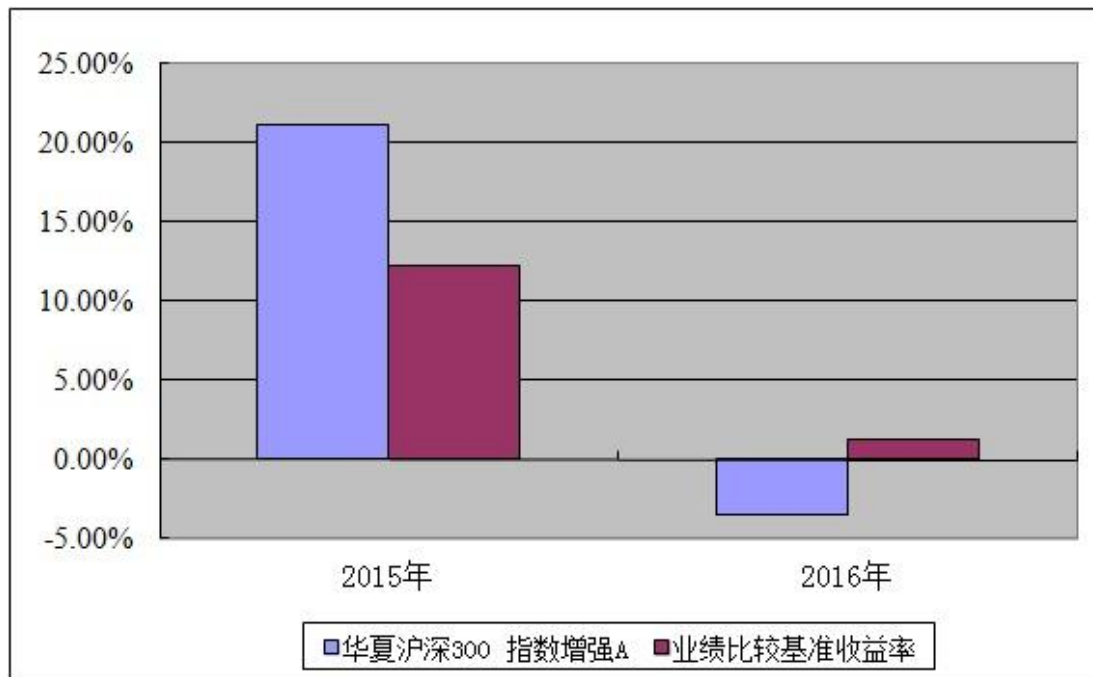


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

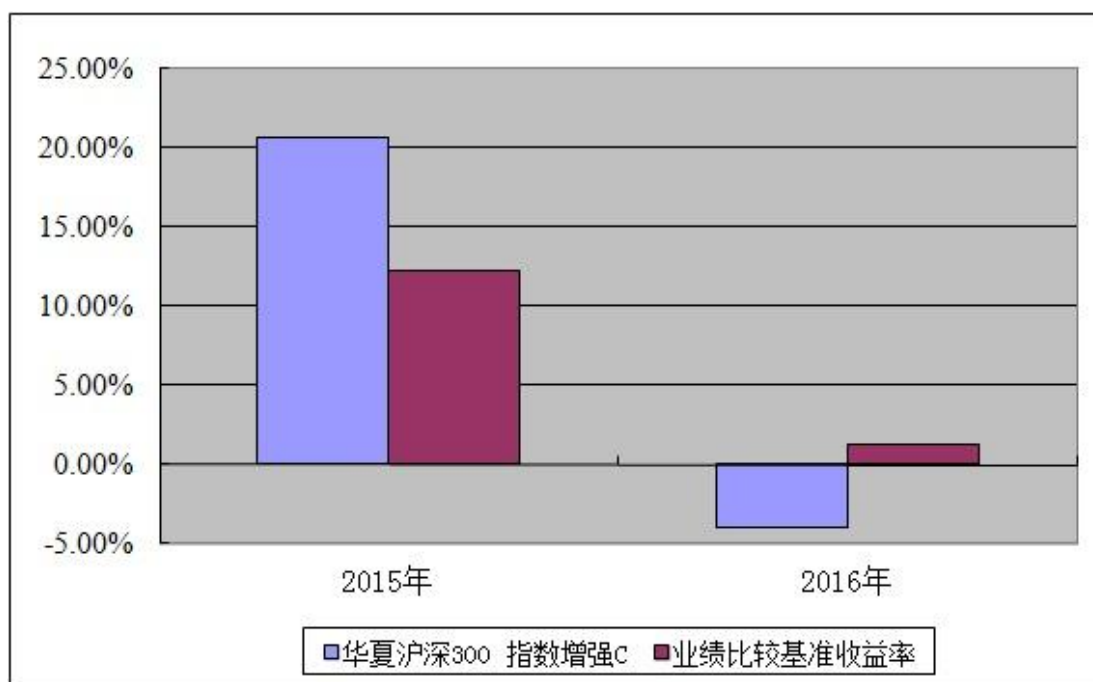
华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金

自基金合同生效以来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

华夏沪深 300 指数增强 A



华夏沪深 300 指数增强 C



注：本基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。



## §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、首批基本养老保险基金投资管理人资格，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、华夏沪港通恒生 ETF、华夏上证 50AH 优选指数（LOF）和华夏快线 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、海外市场指数等的产品线。

2016 年，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，2016 年，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）改进业务流程，客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务，还可自助办理资产证明和盖章对账单，业务处理更加高效便捷；（2）增加交易渠道，与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，并上线华夏财富网上交易系统，增加直销定投通等功能，为客户提供更多优惠便捷的理财渠道，提高交易便利性；（3）开展“你定，我投”、“客户个性化白皮书”、“2016 活期通年底晒账单”、2016 北京马拉松等系列宣传活动，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		
宋洋	本基金的基金经理、数量投资部总监	2016-11-18	-	6 年	中国科学院数学与系统科学研究院博士。曾任嘉实基金管理有限公司研究员、投资经理。2016 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，曾任数量投资部研究员等。
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、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）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。

③根据本基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理的公告》，自 2017 年 2 月 10 日起，王路先生不再担任本基金基金经理。

#### 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

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。

2016 年，国际方面，美国经济温和复苏，美联储如期加息，英国脱欧事件和美国大选给全球市场带来了较大的不确定性。国内方面，经济企稳迹象初显，工业结构持续优化，企业效益明显改善。在供给侧改革、基建与房地产投资拉动等因素影响下，工业品价格持续上涨，改善了市场情绪。报告期内，CPI 温和上涨，为引导经济去杠杆，央行下半年以来持续锁短放长，短期利率有所提升。

市场方面，年初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、央行积极投放货币、市场监管措施调整及美元暂缓加息等利好因素影响，A 股逐渐企稳。2 季度和 3 季度，在英国脱欧、美国大选等诸多不确定性因素的影响下，市场整体维持震荡态势。4 季度，在基本面企稳、工业品价格持续上涨、保险机构举牌等因素带动下，市场情绪持续高涨，走出一波震荡向上的行情。但长期以来金融领域集聚的风险也受到监管机构重视，随着央行锁短放长抬高资金利率中枢、监管部门力促金融领域去杠杆，债券市场经历了一波较大幅度的调整，A 股市场受压回落。

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 12 月 31 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值为 1.170 元，本报告期份额净值增长率为-3.47%；华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值为 1.159 元，本报告期份额净值增长率为-3.98%，同期业绩比较基准增长率为-9.22%。本基金本报告期 A 类份额跟踪偏离度为+5.75%，C 类份额跟踪偏离度为+5.24%。

#### 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 2017 年，国际方面，美元的加息节奏仍是牵动市场神经的关键因素，而特朗普政府的政策走向、英国脱欧流程的启动都增加了外部世界的不确定性。国内方面，基本上，投资企稳有助于经济增速维持，出口受益于海外经济回暖

和人民币贬值或会恢复，生产资料价格上行和经济温和复苏将有助于上游资源及中游制造企业盈利恢复，因而我们更看好银行、上游及中游制造业；资金面上，央行货币政策整体稳健，货币环境偏中性，权益市场资金面供给需求大体平衡，投资者机构化明显，保险等机构对低估值蓝筹股配置需求依然存在；估值上，A 股市场的估值水平相比于海外市场存在一定的估值优势，沪深 300 指数的估值处于历史均值以下的水平，随着利率中枢的上行，个股表现需要企业利润增长来支撑，市场将更看重股票业绩的增长，在风格上偏向大股票，沪深 300 指数将会有较好的投资机会。

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，公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度，修订了保密管理制度和员工培训制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化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，加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核，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、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。

#### 4.8 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。

本基金本报告期末进行利润分配，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

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 12 月 31 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20595 号

华夏沪深 300 指数增强型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沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“华夏沪深 300 指数增强基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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华夏沪深 300 指数增强基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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管理层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，上述华夏沪深 300 指数增强基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏沪深 300 指数增强基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 赵雪

上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 10 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	22,413,365.75	29,699,299.09
结算备付金		8,989,149.75	7,791,966.10
存出保证金		3,175,565.27	5,018,892.84
交易性金融资产	7.4.7.2	261,175,924.70	222,361,336.53



其中：股票投资		261,107,519.30	222,279,537.33
基金投资		-	-
债券投资		68,405.40	81,799.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,001,110.00	-
应收利息	7.4.7.5	14,287.53	11,016.51
应收股利		-	-
应收申购款		861,736.10	231,689.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		298,631,139.10	265,114,200.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		708,837.58	1,010,774.98
应付管理人报酬		251,922.92	223,002.94
应付托管费		50,384.56	44,600.58
应付销售服务费		41,756.45	37,038.85
应付交易费用	7.4.7.7	1,434,669.68	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	7.4.7.8	52,460.07	164,872.01
负债合计		2,540,031.26	2,268,179.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	253,828,679.02	217,130,717.97
未分配利润	7.4.7.10	42,262,428.82	45,715,303.66
所有者权益合计		296,091,107.84	262,846,021.63

负债和所有者权益总计		298,631,139.10	265,114,200.85
------------	--	----------------	----------------

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，华夏沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 1.170 元，华夏沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 1.159 元；华夏沪深 300 指数增强基金份额总额 253,828,679.02 份（其中 A 类 168,467,849.12 份，C 类 85,360,829.90 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 12 月 31 日。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日 (基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		3,922,012.47	151,323,521.11
1.利息收入		324,747.76	1,099,052.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	322,427.67	399,641.38
债券利息收入		210.09	56.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,110.00	699,354.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,071,073.61	145,482,968.15
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,147,969.38	140,802,053.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	2,825,100.00	124,120.00
股利收益	7.4.7.17	5,393,942.99	4,556,794.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-4,119,822.10	-3,117,602.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	646,013.20	7,859,103.12
<b>减：二、费用</b>		7,266,036.06	9,730,417.40

1.管理人报酬		2,775,526.65	3,385,249.66
2.托管费		555,105.27	677,049.95
3.销售服务费		464,784.50	464,739.01
4.交易费用	7.4.7.20	3,180,520.15	4,894,823.83
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.21	290,099.49	308,554.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,344,023.59</b>	<b>141,593,103.71</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,344,023.59</b>	<b>141,593,103.71</b>

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 12 月 31 日。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-3,344,023.59	-3,344,023.59
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）	36,697,961.05	-108,851.25	36,589,109.80
其中：1.基金申购款	207,877,652.51	19,053,521.38	226,931,173.89
2.基金赎回款	-171,179,691.46	-19,162,372.63	-190,342,064.09
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）	253,828,679.02	42,262,428.82	296,091,107.84
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 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）	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）	-	141,593,103.71	141,593,103.71
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）	-471,110,841.44	-95,877,800.05	-566,988,641.49
其中：1.基金申购款	732,059,559.00	214,753,334.64	946,812,893.64
2.基金赎回款	-1,203,170,400.44	-310,631,134.69	-1,513,801,535.13
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）	217,130,717.97	45,715,303.66	262,846,021.63

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 12 月 31 日。

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：

<u>杨明辉</u>	<u>汪贵华</u>	<u>汪贵华</u>
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 基金基本情况

华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金（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”）证监许可[2014]147 号《关于核准华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准、机构部函[2015]70 号《关于华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金延期募集备案的回函》确认，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》、《华夏沪深 300 指数增强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，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 688,054,988.40 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0128 号验资报告予以验证。经向中国证

监会备案，《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 688,241,559.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 186,571.01 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

#### 7.4.2 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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原

则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确

认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设



如下:

1、对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

4、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),于2015年3月20日起按照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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 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，暂免征收个人所得税。

7、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。

8、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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	22,413,365.75	29,699,299.09
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	22,413,365.75	29,699,299.09

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	267,940,789.24	261,107,519.30	-6,833,269.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	63,000.00	68,405.40
	银行间市场	-	-
	合计	63,000.00	68,405.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	268,003,789.24	261,175,924.70	-6,827,864.54
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,705,138.97	222,279,537.33	-3,425,601.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	63,000.00	81,799.20
	银行间市场	-	-
	合计	63,000.00	81,799.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	225,768,138.97	222,361,336.53	-3,406,802.44

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	15,603,840.00	-	-	-
其中：股指期货	15,603,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,603,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	24,240,480.00	-	-	-
其中：股指期货	24,240,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	24,240,480.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

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
IF1703	沪深 300 股指期货 IF1703 合约	16	15,603,840.00	-409,560.00	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					-409,560.00
股指期货投资本期收益					2,825,100.00
股指期货投资本期公允价值变动					-698,760.00

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,960.50	5,961.71
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	9,159.71	4,914.15
应收债券利息	140.15	56.06
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	27.17	84.59
合计	14,287.53	11,016.51

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,434,669.68	787,889.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,434,669.68	787,889.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	532.89	1,872.01
预提费用	40,000.00	113,000.00
应付指数使用费	11,927.18	50,000.00
合计	52,460.07	164,872.01

7.4.7.9 实收基金

华夏沪深 300 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,121,038.15	145,121,038.15
本期申购	118,505,243.73	118,505,243.73
本期赎回(以“-”号填列)	-95,158,432.76	-95,158,432.76
本期末	168,467,849.12	168,467,849.12

华夏沪深 300 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,009,679.82	72,009,679.82
本期申购	89,372,408.78	89,372,408.78
本期赎回(以“-”号填列)	-76,021,258.70	-76,021,258.70
本期末	85,360,829.90	85,360,829.90

7.4.7.10 未分配利润

华夏沪深 300 指数增强 A

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	50,796,002.42	-19,978,408.63	30,817,593.79
本期利润	1,025,564.99	-3,096,275.35	-2,070,710.36
本期基金份额交易产生的变动数	7,461,655.05	-7,529,011.07	-67,356.02
其中：基金申购款	36,048,961.86	-24,480,470.92	11,568,490.94
基金赎回款	-28,587,306.81	16,951,459.85	-11,635,846.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,283,222.46	-30,603,695.05	28,679,527.41

华夏沪深 300 指数增强 C

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	24,799,515.46	-9,901,805.59	14,897,709.87
本期利润	-249,766.48	-1,023,546.75	-1,273,313.23
本期基金份额交易产生的变动数	4,516,001.05	-4,557,496.28	-41,495.23
其中：基金申购款	26,382,457.77	-18,897,427.33	7,485,030.44
基金赎回款	-21,866,456.72	14,339,931.05	-7,526,525.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,065,750.03	-15,482,848.62	13,582,901.41

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	207,488.34	284,871.45
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	113,654.45	109,637.50
其他	1,284.88	5,132.43
合计	322,427.67	399,641.38

#### 7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,060,267,800.63	1,618,216,662.73
减：卖出股票成本总额	1,061,415,770.01	1,477,414,609.55
买卖股票差价收入	-1,147,969.38	140,802,053.18

#### 7.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
股指期货投资收益	2,825,100.00	124,120.00
合计	2,825,100.00	124,120.00

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合 同生效日）至 2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,393,942.99	4,556,794.97
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,393,942.99	4,556,794.97

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同 生效日）至 2015年12月31日
1.交易性金融资产	-3,421,062.10	-3,406,802.44
——股票投资	-3,407,668.30	-3,425,601.64
——债券投资	-13,393.80	18,799.20
——资产支持证券投资	-	-



——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-698,760.00	289,200.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-698,760.00	289,200.00
3.其他	-	-
合计	-4,119,822.10	-3,117,602.44

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日(基金合同 生效日)至 2015年12月31日
基金赎回费收入	643,013.20	7,859,103.12
其他	3,000.00	-
合计	646,013.20	7,859,103.12

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日(基金合同 生效日)至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,180,520.15	4,894,823.83
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,180,520.15	4,894,823.83

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日(基金合同 生效日)至 2015年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	73,000.00
银行费用	7,902.31	17,283.17
指数使用费	161,927.18	177,777.78
其他	270.00	494.00
合计	290,099.49	308,554.95

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

#### 7.4.9 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	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	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
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
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
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同 生效日）至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,775,526.65	3,385,249.66
其中：支付销售机构的客户维护费	568,417.91	941,824.25

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年2月10日（基金合同生 效日）至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的 托管费	555,105.27	677,049.95

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。

### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	229,423.05	229,423.05
中国农业银行	-	78,884.55	78,884.55
中信证券	-	1,262.62	1,262.62
中信证券（山东）	-	388.84	388.84
合计	-	309,959.06	309,959.06
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 12 月 31 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	-	171,490.81	171,490.81
中国农业银行	-	152,639.42	152,639.42
中信证券	-	1,032.42	1,032.42
中信证券（山东）	-	418.60	418.60
合计	-	325,581.25	325,581.25

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 2 月 10 日(基金合同生效日) 至 2015 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
中国农业银行 活期存款	22,413,365.75	207,488.34	29,699,299.09	284,871.45

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 501,562,140.00 元（上年度可比期间：925,579,400.00 元），支付给中信期货的佣金为 12,212.52 元（上年度可比期间：24,145.72 元）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新发流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新发流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新发流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新发流通受限	23.16	23.16	1,299	30,084.84	30,084.84	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新发流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新发流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2016-01-06	新发流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新发流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新发流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

## 7.4.12.2 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
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.42	-	-	65,700	737,195.00	750,294.00	-
600537	亿晶光电	2016-12-27	重大事项	7.43	2017-01-13	8.17	77,200	537,153.00	573,596.00	-
000531	穗恒运 A	2016-08-29	重大事项	11.47	2017-01-09	11.80	48,500	545,263.73	556,295.00	-
002151	北斗星通	2016-11-16	重大事项	31.90	2017-01-12	31.00	16,200	516,841.00	516,780.00	-
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项	16.42	2017-01-18	16.38	14,600	251,694.00	239,732.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项	177.97	2017-03-13	195.77	876	20,375.76	155,901.72	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大事项	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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，参考压力测试结果，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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.3 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。

本基金为指数增强型基金，主要采用指数增强量化投资策略，运用多因子分析模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	261,107,519.30	88.18	222,279,537.33	84.57
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	261,107,519.30	88.18	222,279,537.33	84.57

##### 7.4.13.4.3.2 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，各类持仓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。		
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 12 月 31 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	+5%	15,334,558.48	13,091,046.11
	-5%	-15,334,558.48	-13,091,046.11

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 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 261,175,924.70 元，第二层次的余额为 0 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。）

##### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

## §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	261,107,519.30	87.43
	其中: 股票	261,107,519.30	87.43
2	固定收益投资	68,405.40	0.02
	其中: 债券	68,405.40	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	31,402,515.50	10.52
7	其他各项资产	6,052,698.90	2.03
8	合计	298,631,139.10	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	1,794,048.00	0.61
B	采矿业	7,797,628.20	2.63
C	制造业	88,033,910.29	29.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,574,203.66	3.23
E	建筑业	12,013,262.74	4.06

F	批发和零售业	7,097,013.62	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	7,085,259.68	2.39
H	住宿和餐饮业	580,362.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,346,462.31	2.48
J	金融业	90,890,862.80	30.70
K	房地产业	13,393,924.00	4.52
L	租赁和商务服务业	3,098,333.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	606,375.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	1,899,158.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,545,830.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	7,171,956.00	2.42
S	综合	1,178,930.00	0.40
	合计	261,107,519.30	88.18

### 8.3 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	601318	中国平安	298,600	10,579,398.00	3.57
2	601398	工商银行	1,720,400	7,586,964.00	2.56
3	600015	华夏银行	637,980	6,922,083.00	2.34
4	000001	平安银行	708,880	6,450,808.00	2.18
5	601328	交通银行	1,111,800	6,415,086.00	2.17
6	601166	兴业银行	386,100	6,231,654.00	2.10
7	601988	中国银行	1,795,000	6,174,800.00	2.09
8	601818	光大银行	1,509,800	5,903,318.00	1.99
9	601211	国泰君安	272,800	5,071,352.00	1.71
10	601668	中国建筑	535,500	4,744,530.00	1.60
11	600837	海通证券	267,600	4,214,700.00	1.42
12	600048	保利地产	439,000	4,008,070.00	1.35
13	601555	东吴证券	287,200	3,811,144.00	1.29
14	000686	东北证券	306,780	3,791,800.80	1.28
15	601377	兴业证券	484,200	3,704,130.00	1.25
16	601788	光大证券	223,600	3,575,364.00	1.21
17	601688	华泰证券	199,900	3,570,214.00	1.21
18	000651	格力电器	130,000	3,200,600.00	1.08

19	600887	伊利股份	172,600	3,037,760.00	1.03
20	600519	贵州茅台	8,644	2,888,392.60	0.98
21	600252	中恒集团	601,600	2,755,328.00	0.93
22	000333	美的集团	91,650	2,581,780.50	0.87
23	600886	国投电力	378,900	2,527,263.00	0.85
24	601601	中国太保	90,100	2,502,077.00	0.85
25	601766	中国中车	254,400	2,485,488.00	0.84
26	600637	东方明珠	106,500	2,481,450.00	0.84
27	000002	万科 A	119,100	2,447,505.00	0.83
28	002152	广电运通	182,200	2,419,616.00	0.82
29	002594	比亚迪	47,700	2,369,736.00	0.80
30	002241	歌尔股份	81,800	2,169,336.00	0.73
31	600037	歌华有线	131,900	2,020,708.00	0.68
32	600373	中文传媒	100,000	2,020,000.00	0.68
33	600900	长江电力	158,500	2,006,610.00	0.68
34	601800	中国交建	131,700	2,000,523.00	0.68
35	000778	新兴铸管	383,500	1,982,695.00	0.67
36	600340	华夏幸福	75,900	1,814,010.00	0.61
37	600068	葛洲坝	192,500	1,769,075.00	0.60
38	600066	宇通客车	88,500	1,733,715.00	0.59
39	600297	广汇汽车	202,500	1,733,400.00	0.59
40	300133	华策影视	140,100	1,590,135.00	0.54
41	300015	爱尔眼科	51,700	1,545,830.00	0.52
42	600038	中直股份	31,800	1,539,756.00	0.52
43	002049	紫光国芯	46,600	1,535,004.00	0.52
44	600893	中航动力	44,300	1,450,382.00	0.49
45	600309	万华化学	67,300	1,448,969.00	0.49
46	601186	中国铁建	117,500	1,405,300.00	0.47
47	002450	康得新	73,000	1,395,030.00	0.47
48	000555	神州信息	62,800	1,333,244.00	0.45
49	000100	TCL 集团	396,800	1,309,440.00	0.44
50	300003	乐普医疗	70,800	1,269,444.00	0.43
51	600060	海信电器	72,800	1,246,336.00	0.42
52	000027	深圳能源	180,100	1,237,287.00	0.42
53	600522	中天科技	115,800	1,219,374.00	0.41
54	000559	万向钱潮	91,500	1,213,290.00	0.41
55	601088	中国神华	73,200	1,184,376.00	0.40

56	601628	中国人寿	47,800	1,151,502.00	0.39
57	601006	大秦铁路	162,000	1,146,960.00	0.39
58	002001	新和成	57,400	1,125,040.00	0.38
59	000671	阳光城	201,600	1,122,912.00	0.38
60	000061	农产品	90,700	1,121,959.00	0.38
61	601018	宁波港	221,600	1,121,296.00	0.38
62	002739	万达院线	20,100	1,086,807.00	0.37
63	601258	庞大集团	387,600	1,073,652.00	0.36
64	601390	中国中铁	120,400	1,066,744.00	0.36
65	002466	天齐锂业	32,700	1,061,115.00	0.36
66	601336	新华保险	24,200	1,059,476.00	0.36
67	300070	碧水源	60,400	1,058,208.00	0.36
68	000858	五粮液	30,600	1,055,088.00	0.36
69	300267	尔康制药	80,800	1,054,440.00	0.36
70	601899	紫金矿业	313,600	1,047,424.00	0.35
71	600391	成发科技	29,600	1,043,400.00	0.35
72	600153	建发股份	96,900	1,036,830.00	0.35
73	600031	三一重工	168,800	1,029,680.00	0.35
74	002153	石基信息	41,300	1,006,481.00	0.34
75	601098	中南传媒	60,200	1,002,932.00	0.34
76	000860	顺鑫农业	45,100	992,200.00	0.34
77	601012	隆基股份	73,900	989,521.00	0.33
78	002475	立讯精密	45,700	948,275.00	0.32
79	002714	牧原股份	40,000	931,200.00	0.31
80	300199	翰宇药业	50,800	913,384.00	0.31
81	002304	洋河股份	12,800	903,680.00	0.31
82	000402	金融街	86,500	890,950.00	0.30
83	000977	浪潮信息	41,900	888,280.00	0.30
84	000157	中联重科	195,100	885,754.00	0.30
85	600498	烽火通信	34,900	879,829.00	0.30
86	601928	凤凰传媒	84,000	879,480.00	0.30
87	002249	大洋电机	101,800	878,534.00	0.30
88	600312	平高电气	56,100	876,282.00	0.30
89	600547	山东黄金	24,000	876,240.00	0.30
90	600690	青岛海尔	88,600	875,368.00	0.30
91	000021	深科技	92,600	873,218.00	0.29
92	600764	中电广通	30,700	869,117.00	0.29

93	000568	泸州老窖	26,300	867,900.00	0.29
94	600028	中国石化	158,300	856,403.00	0.29
95	603993	洛阳钼业	230,000	855,600.00	0.29
96	000069	华侨城 A	121,000	840,950.00	0.28
97	600256	广汇能源	179,300	837,331.00	0.28
98	600549	厦门钨业	37,800	832,356.00	0.28
99	002027	分众传媒	58,200	830,514.00	0.28
100	002376	新北洋	66,800	828,320.00	0.28
101	000712	锦龙股份	34,700	813,368.00	0.27
102	000572	海马汽车	151,000	809,360.00	0.27
103	600736	苏州高新	86,800	783,804.00	0.26
104	002285	世联行	103,000	782,800.00	0.26
105	600702	沱牌舍得	34,600	781,960.00	0.26
106	002183	怡亚通	72,000	781,920.00	0.26
107	600705	中航资本	127,500	780,300.00	0.26
108	002244	滨江集团	111,200	776,176.00	0.26
109	600197	伊力特	53,400	773,766.00	0.26
110	600115	东方航空	109,400	773,458.00	0.26
111	600873	梅花生物	118,200	770,664.00	0.26
112	002465	海格通信	66,100	770,065.00	0.26
113	601588	北辰实业	184,100	767,697.00	0.26
114	600867	通化东宝	35,000	767,550.00	0.26
115	000915	山大华特	18,000	758,340.00	0.26
116	000819	岳阳兴长	28,800	754,560.00	0.25
117	002460	赣锋锂业	28,400	752,884.00	0.25
118	600655	豫园商城	65,700	750,294.00	0.25
119	000966	长源电力	123,300	744,732.00	0.25
120	600026	中远海能	108,800	740,928.00	0.25
121	002221	东华能源	59,700	739,683.00	0.25
122	601992	金隅股份	164,800	735,008.00	0.25
123	000070	特发信息	28,700	725,823.00	0.25
124	000851	高鸿股份	61,300	714,758.00	0.24
125	600372	中航电子	38,400	712,704.00	0.24
126	000009	中国宝安	68,600	710,696.00	0.24
127	600333	长春燃气	89,700	705,042.00	0.24
128	600029	南方航空	99,100	695,682.00	0.23
129	600642	申能股份	118,500	695,595.00	0.23

130	600188	兖州煤业	57,900	628,794.00	0.21
131	000939	凯迪生态	48,600	625,482.00	0.21
132	600862	中航高科	51,100	625,464.00	0.21
133	601000	唐山港	155,500	623,555.00	0.21
134	002108	沧州明珠	30,300	617,211.00	0.21
135	000761	本钢板材	114,100	613,858.00	0.21
136	300012	华测检测	52,500	606,375.00	0.20
137	600221	海南航空	184,100	600,166.00	0.20
138	600183	生益科技	54,400	598,400.00	0.20
139	600489	中金黄金	49,200	594,828.00	0.20
140	300144	宋城演艺	28,300	592,602.00	0.20
141	000597	东北制药	58,500	585,000.00	0.20
142	600754	锦江股份	19,700	580,362.00	0.20
143	600537	亿晶光电	77,200	573,596.00	0.19
144	601600	中国铝业	133,000	561,260.00	0.19
145	000531	穗恒运 A	48,500	556,295.00	0.19
146	000039	中集集团	37,400	546,788.00	0.18
147	002595	豪迈科技	25,600	538,880.00	0.18
148	002273	水晶光电	26,900	535,310.00	0.18
149	002151	北斗星通	16,200	516,780.00	0.17
150	000936	华西股份	52,300	512,017.00	0.17
151	002128	露天煤业	59,400	510,840.00	0.17
152	601111	中国国航	70,900	510,480.00	0.17
153	002299	圣农发展	23,700	502,914.00	0.17
154	000637	茂化实华	64,900	501,677.00	0.17
155	002091	江苏国泰	37,700	499,902.00	0.17
156	601333	广深铁路	98,600	499,902.00	0.17
157	600111	北方稀土	40,500	496,935.00	0.17
158	002310	东方园林	34,500	488,175.00	0.16
159	600061	国投安信	30,400	474,544.00	0.16
160	300298	三诺生物	26,000	471,640.00	0.16
161	600783	鲁信创投	20,700	468,234.00	0.16
162	002493	荣盛石化	30,100	464,142.00	0.16
163	600507	方大特钢	66,000	446,820.00	0.15
164	600323	瀚蓝环境	30,500	437,980.00	0.15
165	002081	金螳螂	42,900	419,991.00	0.14
166	000999	华润三九	16,700	412,991.00	0.14

167	600782	新钢股份	118,400	395,456.00	0.13
168	000004	国农科技	8,700	390,630.00	0.13
169	600395	盘江股份	45,300	365,571.00	0.12
170	002188	巴士在线	12,400	363,940.00	0.12
171	600327	大东方	39,000	362,700.00	0.12
172	002477	雏鹰农牧	71,700	359,934.00	0.12
173	002654	万润科技	30,400	335,616.00	0.11
174	300201	海伦哲	39,100	316,319.00	0.11
175	002709	天赐材料	7,300	307,841.00	0.10
176	300221	银禧科技	15,300	302,022.00	0.10
177	600987	航民股份	24,300	299,862.00	0.10
178	002100	天康生物	32,000	287,040.00	0.10
179	300048	合康新能	34,700	285,234.00	0.10
180	601021	春秋航空	7,100	260,854.00	0.09
181	002523	天桥起重	37,000	247,900.00	0.08
182	600687	刚泰控股	14,600	239,732.00	0.08
183	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.08
184	300040	九洲电气	19,700	225,762.00	0.08
185	601002	晋亿实业	23,000	218,960.00	0.07
186	002563	森马服饰	21,300	218,751.00	0.07
187	300017	网宿科技	4,000	214,440.00	0.07
188	000401	冀东水泥	17,600	209,440.00	0.07
189	600318	新力金融	6,500	209,300.00	0.07
190	601636	旗滨集团	50,900	197,492.00	0.07
191	002515	金字火腿	11,100	191,142.00	0.06
192	603708	家家悦	5,874	185,794.62	0.06
193	600600	青岛啤酒	6,300	185,472.00	0.06
194	002645	华宏科技	6,100	174,521.00	0.06
195	603986	兆易创新	876	155,901.72	0.05
196	002582	好想你	4,300	151,403.00	0.05
197	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.04
198	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
199	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.03
200	603885	吉祥航空	4,400	102,520.00	0.03
201	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.03
202	600688	上海石化	14,982	96,484.08	0.03
203	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03



204	603660	苏州科达	2,353	75,813.66	0.03
205	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.03
206	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
207	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.02
208	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
209	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
210	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
211	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.02
212	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.02
213	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.02
214	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
215	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	0.02
216	603585	苏利股份	743	51,801.96	0.02
217	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.02
218	603878	武进不锈	1,274	50,960.00	0.02
219	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.02
220	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.02
221	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.02
222	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.02
223	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
224	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.01
225	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.01
226	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
227	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
228	603886	元祖股份	1,805	31,948.50	0.01
229	603228	景旺电子	1,299	30,084.84	0.01
230	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
231	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
232	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
233	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
234	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
235	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
236	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
237	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
238	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
239	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
240	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

241	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
242	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

#### 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	600048	保利地产	13,391,168.00	5.09
2	601398	工商银行	12,420,512.00	4.73
3	601788	光大证券	11,950,600.97	4.55
4	600637	东方明珠	10,746,344.26	4.09
5	601377	兴业证券	10,231,542.38	3.89
6	002415	海康威视	10,176,305.76	3.87
7	000002	万科 A	9,907,267.27	3.77
8	600016	民生银行	9,428,033.00	3.59
9	601668	中国建筑	9,382,089.00	3.57
10	000858	五粮液	8,491,794.09	3.23
11	002304	洋河股份	8,385,654.48	3.19
12	600519	贵州茅台	8,292,730.92	3.15
13	600958	东方证券	7,713,747.19	2.93
14	600109	国金证券	7,468,430.18	2.84
15	601555	东吴证券	7,468,163.63	2.84
16	601211	国泰君安	7,136,010.00	2.71
17	000793	华闻传媒	6,678,491.34	2.54
18	601166	兴业银行	6,453,286.22	2.46
19	600340	华夏幸福	6,449,566.83	2.45
20	000046	泛海控股	6,443,692.58	2.45
21	601688	华泰证券	6,425,880.87	2.44
22	601618	中国中冶	6,309,411.00	2.40
23	000625	长安汽车	5,938,132.07	2.26
24	601390	中国中铁	5,808,594.00	2.21
25	600066	宇通客车	5,674,152.75	2.16
26	601216	君正集团	5,634,921.92	2.14
27	000686	东北证券	5,602,389.00	2.13
28	002152	广电运通	5,542,313.33	2.11
29	300251	光线传媒	5,336,435.36	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	600016	民生银行	17,127,742.31	6.52
2	002415	海康威视	12,464,159.54	4.74
3	600109	国金证券	10,496,505.00	3.99
4	600048	保利地产	9,882,539.14	3.76
5	600637	东方明珠	9,859,406.73	3.75
6	000002	万科 A	9,348,005.27	3.56
7	000858	五粮液	9,161,561.75	3.49
8	002304	洋河股份	8,988,913.64	3.42
9	600036	招商银行	8,605,824.01	3.27
10	600276	恒瑞医药	8,466,373.28	3.22
11	600705	中航资本	8,376,786.41	3.19
12	600519	贵州茅台	8,170,543.15	3.11
13	601788	光大证券	7,991,617.85	3.04
14	000625	长安汽车	7,648,531.21	2.91
15	600104	上汽集团	7,515,312.65	2.86
16	600958	东方证券	7,513,021.33	2.86
17	601618	中国中冶	7,414,327.00	2.82
18	000793	华闻传媒	7,330,758.85	2.79
19	601668	中国建筑	6,998,574.00	2.66
20	300059	东方财富	6,997,839.42	2.66
21	600837	海通证券	6,913,991.79	2.63
22	600795	国电电力	6,669,842.64	2.54
23	000776	广发证券	6,544,280.19	2.49
24	000046	泛海控股	6,543,295.53	2.49
25	601377	兴业证券	6,422,188.00	2.44
26	601390	中国中铁	6,384,050.00	2.43
27	600340	华夏幸福	6,347,241.78	2.41
28	600999	招商证券	5,923,722.45	2.25
29	601216	君正集团	5,822,829.34	2.22
30	600027	华电国际	5,737,551.00	2.18
31	000540	中天城投	5,666,156.95	2.16
32	000069	华侨城 A	5,628,011.51	2.14

33	601633	长城汽车	5,517,868.03	2.10
34	000503	海虹控股	5,416,555.89	2.06
35	300251	光线传媒	5,304,477.05	2.02
36	600066	宇通客车	5,285,436.86	2.01

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	1,103,651,420.28
卖出股票收入（成交）总额	1,060,267,800.63

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	-	-
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）	68,405.40	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,405.40	0.02

#### 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	110031	航信转债	630	68,405.40	0.02
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

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
IF1703	沪深 300 股指期货 IF1703 合约	16	15,603,840.00	-409,560.00	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					-409,560.00
股指期货投资本期收益					2,825,100.00
股指期货投资本期公允价值变动					-698,760.00

8.10.2 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。

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 2016 年 2 月 26 日国泰君安收到了中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对国泰君安证券股份有限公司采取限制新增做市业务等监管措施的决定》。本基金为指数增强型基金，国泰君安系标的指数成份股，投资决策程序符合相关法律法规的要求。

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	3,175,565.27
2	应收证券清算款	2,001,110.00
3	应收股利	-
4	应收利息	14,287.53
5	应收申购款	861,736.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,052,698.90

### 8.12.4 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	68,405.40	0.02

### 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

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	7,957	21,172.28	1,650,914.06	0.98%	166,816,935.06	99.02%
华夏沪深 300 指数增强 C	4,431	19,264.46	9,339.54	0.01%	85,351,490.36	99.99%
合计	12,388	20,489.88	1,660,253.60	0.65%	252,168,425.42	99.35%

### 9.2 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	683,275.76	0.41%
	华夏沪深 300 指数增强 C	41,435.51	0.05%
	合计	724,711.27	0.29%

### 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	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、基金投资和研发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

## §10 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	118,505,243.73	89,372,408.78
减：本报告期基金总赎回份额	95,158,432.76	76,021,258.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	168,467,849.12	85,360,829.90

## §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

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。

### 11.3 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。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 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、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。

### 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	
长江证券	1	1,003,592,244.89	46.47%	934,646.06	48.78%	-



东吴证券	1	476,288,277.80	22.05%	348,313.25	18.18%	-
申万宏源证券	2	455,811,722.73	21.11%	424,500.42	22.15%	-
华泰证券	1	224,029,472.40	10.37%	208,638.25	10.89%	-

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、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。

### 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
申万宏源证券	-	-	4,000,000.00	100.00%

### 11.8 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	中国证监会指	2016-01-04

	日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	定报刊及网站	
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
8	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
9	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
10	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中国邮政储蓄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	2016-03-09
11	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京钱景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	2016-03-23
12	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
13	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
14	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
15	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
16	华夏基金管理有限公司关于调整华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-02

	的公告		
17	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-02
18	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	2016-07-02
19	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增珠海盈米财富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	2016-07-07
20	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中国民生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	2016-07-22
21	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富济财富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	2016-08-17
22	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-18
23	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市金斧子投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-19
24	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在万联证券开通申购、赎回、转换、定期定额申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-25
25	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增大泰金石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	2016-08-31
26	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	2016-09-20
27	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万得投资顾问有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-20
28	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-25
29	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-02
30	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-16
31	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开	中国证监会指	2016-11-16

	放式基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	定报刊及网站	
32	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	2016-11-18
33	关于华夏基金管理有限公司旗下部分开放式基金在华西证券股份有限公司开通申购、赎回等业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-18
34	华夏基金管理有限公司关于增聘华夏沪深 300 指数增强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	2016-11-19
35	关于旗下部分开放式基金新增北京新浪仓石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	2016-12-08
36	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京植信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	2016-12-22
37	华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京蛋卷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	2016-12-23

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准基金募集的文件；
- 12.1.2 《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 法律意见书；
- 12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇一七年三月二十九日