中加货币市场基金

2015 第四季度 报告

基金管理人的董事会及董事保证本标 个别及连带责任。 基金托管人中国光大银行股份系 报告等内容、保证复核内容不存在虚 基金管理人系语以读求信用、勋 基金的过往业绩并不代表其未求 本报告中址外容粉末参审计	限公司根据基金合同的		重要提示 : 退导性陈述或1	6 Fall Marie Advisor			
个别及连带责任。 基金托管人中国光大银行股份存 报告等内容,保证复核内容不存在虚 基金管理人承诺以诚实信用,勤 基金的过往业绩并不代表其未来	限公司根据基金合同的	せい ひょうけい せいしゅう ひょうしゅう せいしゅう せいしゅう せいしゅう せいしゅう せいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう はいしゅう しゅうしゅう はいしゅう はい	: 温导性陈述或证				
基金托管人中国光大银行股份有 报告等内容,保证复核内容不存在虚 基金管理人承诺以诚实信用、勤! 基金的过往业绩并不代表其未来			e the d mindered	1. 大遗漏, 开对其	内容的	真实性、准确性	和完整性承担
基金管理人承诺以诚实信用、勤 基金的过往业绩并不代表其未来				日复核了本报告	中的财务	B指标、净值表	现和投资组合
	协尽贵的原则管理和运	用基金	金资产,但不保证	基金一定盈利。			
	表现。投资有风险,投资	音者在	:做出投资决策前	应仔细阅读本基	金的招	 原说明书。	
本报告期自2015年10月1日起至1	2月31日止。						
All A Mortin		2 1	5.金产品概况				
基金简称	中加货币						
基金主代码	000331						
基金运作方式	契约型开放式						
基金合同生效日	2013年10月21日	4					
报告期末基金份额总额	12,837,913,566.87		the file of the base of the file	I Milesee on the first			4 17 17
投资目标	在有效控制投资风						
投资策略	低,在控制投资组 期利率水平预期第	本基金投资额略将审编率信备类资产的收益性,流动性及风险快转压,力求格各类风险降到最低、在控制投资自合良好流址的制度下为投资者获取稳定等收益。差型投资额的包括。0 短期利率水平预期策略。2 收益率曲线分析策略。6 据台剩余期限策略、期限配置策略。4 类别具种管置物像。8 波达时停雪等解					
业绩比较基准	七天通知存款利率						
风险收益特征	本基金为货币市场 的基金产品。本基:						
基金管理人	中加基金管理有限	公司					
基金托管人	中国光大银行股份	有限:	公司				
下属两级基金的基金简称	中加货币A				中加货	тic	
下属两级基金的交易代码	000331				000332		
报告期末下属两级基金的份额总额	1,210,023,092.17份				11,627,	890,474.70份	
3.1 主要财务指标	§3 主要	則分	指标和基金净值	表现			
							单位:人民币
主要财务指标				期 2015年10月0	1 ⊟ −201:		
I discuss to select to the		中加货币A			中加货币		
1.本期已实现收益				9,181,304.80			100,536,864.19
2.本期利润			.,.,.		100,536,864.19		
 期末基金资产净值 注:本期已实现收益指基金本期利 	dille i etimile et a	hildr k		1,210,023,092.17	/ WHATE		1,627,890,474.70
见收益加上本期公允价值变动收益,由	于货币市场基金采用的	li li 余成	本法核算,因此,	公允价值变动收	益为零,	本期已实现收	益和本期利润的

n			2015年12月31日	史走势对比图	
	willia an	2 11/12/2		and the same	
			ويستعد لجشت		
2					
n.		e e	1		
5 _					
8134041 2	91-00/42 20:44	0-00 201-00-40	2000-21 8	545 (26.50)	or 2015 00
			/A 3484		
		140	11.0 25.29		
			11. 20.09	_	
àl				 	
~					
~			وهما المارية المرازية المرازية		-
~		 			
~				-	-
~	٠٠٠٠٠٠٠				
				• • • • • • • • • • • • • • • • • • • •	

0.7368% 0.0012% 0.3456% 0.0000% 0.3912% 0.0012%

注:本基基金合同关	金基金合同于: F投资范围及核	2013年10月21日生 -	效。根据基金台		医金建仓期为6个月,建仓期结束时,本基金的各项投资比例符合
4.1 悲金	经理(或基金	经理小组)简介		§ 4 管理人拍	设 告
姓名	即各	任本基金的基金经理期限		证券从业年	说明
ALM	4/73	任职日期	离任日期	限	M091
闫沛贤	基金经理	2013年10月21 日 作簿規守信情况以	ı	7	国清斯 帝国理工大学金融学硕士。2008年至2013年曾任职于 字被银行途至58那。北京银行资金支稿。相任债券交易员。 2013年加入中加基金管理有限公司,现任投资研究部总监则 最高定收益证等,中加货币市场旅金基金经理。 6014年3月24日至今,中加速的被债券等业等投资基金基金经理 6014年3月24日至今,中加速价债券等业等投资基金基金经理 6014年3月24日至今,中加速等成债券等业等投资基金基金经理 发资基金。6014年1月21日至分,中加达季风活配置混合型证券 投资基金。6015年1月2月8日至今)。
金達 43.17 经营 格头里特别的 阿拉特 经 14.37 经营 格头里特别的 阿拉特 医克里特氏 医克里特氏病 医克里氏病 医克里特氏病 医克里氏病 医克克克氏病 医克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克克	有车关系地震则度的。 中国,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	、基金自同的與 及人人平分學的學生 人人不可以 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個的學生 是一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個	(人利益、雅姓法 成见》等选择 这一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	出现和不正当内的"Park"。 地域和允许的"Park"。 是另分的是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	管理人動態尽贵地为基金份额持有人谋求利益。严格遵守了 (基 交易、利益输送等违法违顺行为。公司根据《证券投资基金法》 规定、规定了《中班基金管理有限公司公平交易管理办法》《《 均衡了铜典体的规定、并应定头类数据、佛神特的的格 行物值了铜典体的规定,并应定头类数据、佛神特的的格 分。当时即它是多系统中设置了公平交易模块。一旦出现不同量 落何越的不公平交易行李。 有超级的不公平交易行李。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 有相级的不公平交易行为。 是有一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级一级
E 4 102/2	: 期士北 4 次 2	(4) 人(本) ロ		9	

			金額单位:人民币:
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %
1	固定收益投资	6,362,976,215.42	38.89
	其中:债券	6,362,976,215.42	38.89
	资产支持证券	-	
2	买人返售金融资产	5,631,947,807.91	34.43
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
3	银行存款和结算备付金合计	4,234,792,593.36	25.89
4	其他资产	129,820,904.74	0.79
5	合计	16,359,537,521.43	100.00

			金额单位:人民币
序号	项目		占基金资产净值比例 66
1	报告期内债券回购融资余额		13.3.
	其中:买断式回购融资		
序号	项目	金額	占基金资产净值比例 %
2	报告期末债券回购融资余额	3,484,197,52	21.69 27.1-
5.14 HT	其中:买断式回购融资 告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例		- Indiana de la compania del compania de la compania del compania de la compania del la compania de la compania dela compania del la compania de la compania del la compania del la compania del la compa
债券1 在本打 5.3 基	日朝行順分巴勝底以末朝日盛並成了中国的北京 民国期的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 股告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额 《金投资组合平均剩余期限 投资组合平均剩余期限基本情况	用 未超过资产净值的20%。	parated country
	项目		天数
设告期末	投资组合平均剩余期限		11
设告期内	投资组合平均剩余期限最高值		11
设告期内	投资组合平均剩余期限最低值		10
序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 66)	各期限负债占基金资产净值的比例 66)
1	30天以内	50.68	(%)
•	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	50.00	27.1
2	30天(含)—60天	12.75	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.31	
3	60天(含)—90天	5.86	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
4	90天(含)—180天	23.53	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
5	180天(含)—397天 含)	33.60	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
	合计	126.42	27.1
	于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能 告期末按债券品种分类的债券投资组合	存在尾差。	金额单位:人民币
序号	债券品种	推余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	
2	央行票据	-	
		840,727,414.54	6.5
3	金融债券 其中:政策性金融债	840,727,414.34	0.3

49.56		6,362,976,215.42		合计		9	
金额单位:人民币:	•		的前十名债券投资明细	E金资产净值比例大小排名E	告期末按摊余成本占法	5.5 报	
占基金资产净值比例 %	元)	摊余成本	债券数量 (张)	债券名称	债券代码	序号	
2.34	,062,795.88	300,	3,000,000	15兖矿SCP004	011599596	1	
1.95	,182,076.26	250,	2,500,000	15包钢CP001	041566016	2	
1.95	,033,195.01	250,	2,500,000	15淮南矿业CP003	041566018	3	
1.56	,993,531.36	199,	2,000,000	15淮南矿SCP004	011581004	4	
1.56	,714,904.50	199,	2,000,000	15山钢CP002	041569046	5	
1.56	,707,385.04	199,	2,000,000	15沪华信CP001	041556039	6	
1.33	170,148,500.10		1,700,000	15淮南矿SCP005	011581005	7	
1.17	,679,532.40	150,	1,500,000	15万向钱潮CP001	041561038	8	
1.01	,990,717.97	129,	1,300,000	15开滦CP002	041556023	9	
0.94	,307,917.11	120,	1,200,000	11国开14	110214	10	
			勺偏离		心子定价"与"摊余成本	5.6 "%	
高萬情况	偏			项目			
(报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数				
0.2357%			报告期内偏离度的最高值				
0.1102%			报告期内偏离度的最低值				
0.1535%			报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值				
内溢价与折价, 在剩余存绌!	8柱平人时的			基金资产净值比例大小排名的 支持证券。 法",即估值对象以买人成本	报告期末未持有资产: 资组合报告附注 &金计价方法说明。	本基金 5.8 投 5.8.1 3	

内据 人余其估, 中的 2.利本对基如的成中, 2.利本对基如值相 2.利本对基如值相 5.82 4.82 5.82 5.82 5.83 5.83 6.83 6.84 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85 6.85	。每日计级概点,未集全美国原它份哪价值,基金能价价哪份 最基金资产价值。在有关选择其股份之分,分析到的影响以 量量多用"增金成本处计"情况是整个"净值之报记"的信息 量量多用"增金成本处计"情况是重要。 "是的基金营产价值"的"基金"的"有一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	图过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过 门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
序号	名称	单位:人民币元 金額
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	129,820,504.74
4	应收申购款	400.00
5	其他应收款	=
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	129,820,904.74
注:由:	中四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。	2-4公鄉亦計

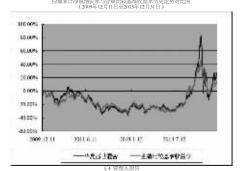
			中加货币A		中加货币C				
报告期期初基金份额总额			1,295,689,635.58		14,228,962,606.94				
报告期基金总申购份额			1,49	6,622,073.36		24,083,573,754.53			
减:报告期	基金总赎回份额		1,58	2,288,616.77		26,684,645,886.77			
报告期期末	卡基金份额总额		1,21	0,023,092.17		11,627,890,474.70			
注:总甲	甲购份额中包含红利甲	耳投份額,总赎回份額含转換 《7 基金管理人	出份額。 运用固有资金投资本基金	交易明细	•				
序号	交易方式	交易日期	交易份額(份)	交易	易金額(元)	适用费率			
1	红利再投	2015年10月08日	259,055.34			-			
2	红利再投	2015年11月02日	176,112.45			-			
3	红利再投	2015年12月01日	197,536.50			-			
合计			632,704.29		-				
无。	§ 8 影响投资者决策的其他重要信息								
	t->-/1. D =		9 备查文件目录						

《中加斯特尔 中中企会存置的理 9.3 金金管托者 9.3 金金管托者电 发服理管对 整理的理管对	他中加取市市场基金设立的文件 市场基金基金同同。 市场基金年管协议) 华秀传献中,营业执照和公司章程 (基金年管人处	
孤並目生		中加基金管理有限公司 二〇一六年一月二十二日

华夏盛世精选混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

集合管理人的资本令人是事件证实现给所表的标文的不存之量证证。《集计性系述或证大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和定整性系统的报表的工作。是否则,有理解析证。如果是不是做证证。《集计学》、《中国建设银行设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设计中设	基金管理人:华夏 基金托管人:中国 报告送出日期:二(建设银行股份有限:						
基金主代码	担个别及连带责任。基: 基金托管人中国建 等内容、保证复核内容: 基金管理人承证说 基金的过往业绩以 本税告中财务资料	金管理人的董事徐 设银行股份有限公 不存在虚假记载、追 诚实信用、勤勉尽 不代表其未来表现 未经审计。	列先生、萬小 、司根据本基 、司根据本基 导性陈述或 责的原则管理 是,投资有风险	安先生元 会合同就 新重大证 和运用 、投资。	體假记载、误导性防 未能对本报告发表) 规定,于2016年1月1 数漏。 基金资产,但不保证 各在作出投资决策;	意见。 9日复核了本报告中的!	财务指标、净值表现	
交易代码 基金运作中式 基金公司生效日 2009年12月11日 报告期末基金份额总额 1344,078,775.16份 紧密测验中国经济的长期发展趋势和周期变动特征, 挖港不成的股份,发生现的设计。 2009年12月11日 报告期末基金份额总额 2009年12月11日 报告期末基金份额总额 40次的工作,从中国工作,从中国工作,从中国工作的企业,并是一种企业中国经济持续,较快成长的发展成果,追求基金房产的作期,转线增值、抵调通价膨胀。 技资策略 本基金以惠则比较基准为,产型300指数,80%+上证到债情数,20%- 本基金的业绩比较基准为,产型300指数,80%+上证到债情数,20%- 本基金的业绩比较基准为,产型300指数,80%+上证到债情数,20%- 本基金的业绩比较基准为,产型300指数,80%+上证到债情数,20%- 本基金管理人 基金管理人 基金管理人 生要基金管理有限公司 基金任任公 3.1 主要财务指标 第金经营程人 生要基金管理有限公司 1.1 主要财务指标 第金经营程人 生要财务指标和基金种量表现 第一个人民币。 第一个人民币。 1.2 是财务指标 第金经营程及现金,在1.2 是财务指标和基金种量表现 1.2 是财务指标和基金种量表现 1.3 上要财务指标和国金种量表现 1.3 上要财务指标和国金种量表现 1.3 上要财务指标和国金种量表现 1.3 上要财务指标和国金种量系统 1.3 是财务基金份额净值 1.2 (2.3 2.4 4.0 3.3 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9 4.9	基金简称			华夏盛	世混合			
基金运作方式 基金合用之效日 2009年12月11日 股告期末基金份额总额 1.941,078,775.16份 累密觀察中国经济方向,把原中国经济的长期发展趋势和周期变动种征,抡匿不同发现的发育的大方,让使用人等。	基金主代码			000061	I			
基金合同生效日 209年12月11日 1441.078.775.16分 1441.078.775.16分 1441.078.775.16分 经费目标 经费目标 经费目标 经费目标 基金银海市中国经济的长期发展趋势和周期变动特征。化图不同 发展的影响。中国经济特殊、较快或长的发 服成果 追求基金经产价分别,建筑特益、我间等的 中国经济特殊、较快或长的发 服成果 追求基金经产价分别,建筑特益、据则证据数据 在那间继续的 人员的意义 经商价 人民的主义 人名 人民的主义 人名 人民的主义 人民的人民的主义 人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人民的人	交易代码			000061				
超告期末基金份额总额 1.941,078,775.16份 紧密限验证银经济动向,把握中团经济的长期灾廃趋势和周期变动特征,控继不向及股份设计。 现分现分,不是全人国际处于加州党领机会。现分绝介享中国经济持续,校执成长的发展成果,追求基金货产的长期,校被增值、抵调到货膨胀。 全统土校基相 本基金以即时还是投资部分外处,并解以个更特益和职债债券管理策略。 全统土校基相 本基金则应与收益高于债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品量。 本基金则应与收益高于债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品量。 本基金配应与收益高,债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品量。 本基金配应与收益高,债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品量。 本基金配应与收益高,债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品量。 本基金配合。 本基金配合。 中国建设银行股份有限公司 3.1 主要财务指标 主要财务指标 业等财务指标和基金净度表现 主要财务指标 主要财务指标 业等财务指标和基金净度表现 132,036,243,71 1,31年支票金价额本期时间 1,227 2,4年期已未完价率价值 2,364,490,339,91 1,217 2,24年期已未实收益自动用标本与信债券有人从助成交易基金的多用费用。计人费用资率或选本平型化于价税收入。 ②本期已未现效品有基本的产价值类成金。其他收入,投资收益,其他收入(不合公允价值变动收益)和除相关费用后的余额,本期时间为本期已。 3.21 基金价值的企用。 净值增长率及,均同期中偿托收基和收益率的比较 净值增长率及,单值增长率标准差。超增比较基和收益率的比较 业绩比较基准收益率 ①—③ ②—④	基金运作方式			契约型	肝放式			
接管阻滞中国经济的。中原地中国经济的。中原地中国经济的长期发展趋势和周期变动种距,控阻不同发现的安全的优势的。这个自使的优惠。	基金合同生效日			2009年	12月11日			
接货目标 安國於資产的代數學次長行业投資和金,更好絕分享中国整分特徵、较快或长的发展投展,追求基金資产的长期,或特徵、集時後、表的表面,不基金以周期优速投資報略之,并和以不發精造和和股份參管理報略。 本基金以周期优速投資報略为核心,并和以不發精造和再股份參管理報略。 本基金與經計校基準 本基金與經計校是基份方言深30所數8,80%+上证前所指数,20%。 本基金與企。較進高于實券基金均货币市场基金,属于较高與险、较高收益的品种。 基金管理人 华夏基金管理有限公司 3.1 主要财务指标 中国建设银行股份有限公司 3.1 主要财务指标 北至财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日) 1.本期已实现收益 上本期已实现收益 2.本期時间 3.80,091,071.60 3.3加度平均基金份据本期利润 0.289 4期末基金资产净值 2.362,490,399,91 5.期末基金份额净值 2.362,490,399,91 5.期末基金份额净值 2.362,490,399,91 5.到末基金份额净值 2.362,490,399,91 5.到末基金份额净值 3.21 基金价值的。 计影片有关 人人国或交易基金的各国费用,计入费用员实所收益标准率等的有效。 2.362,490,399,91 5.31 基金价值的。 2.462,490,399,91 3.21 基金价值的。 2.462,490,399,91 3.242,490,399,91 3.242,490,399,91 3.242,490,399,91 3.242,490,399,91 3.242,400,400,400,400,400,400,400,400,400,	报告期末基金份额总	额		1,941,0	778,775.16份			
企館社校基備 本基金的連續比較基備为;产程300指数,80%+上证期價指数,20%- 水基金的連續比較基備为;产程300指数,80%+上证期價指数,20%- 水基金的理人 华夏基金營費有限公司 基金任管人 华夏基金營費有限公司 基金任管人 中国建设银行股份有限公司 3.1 主要财务指标 整位,人民币: 主要财务指标 报告期2015年10月1日-2015年12月31日) 1.本期已实现收益 第80,091,271,60 2.本期增缩 \$80,091,271,60 3.1 其要财务指标 第80,091,271,60 3.1 其要财务指标和基金价值本期增润 2,26249033991 1.1 人事形生实现收益 第80,091,271,60 3.1 其金价值的 2,26249033991 5.期末基金价率价值 2,26249033991 5.别末基金价率价值 2,26249033991 5.别末基金价率价值 1,277 2.2 本期已实现收益标准金本期利息收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)对除相关费用后的余额,本期利润为本期已实达起户上下股之价值变动处。 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值表现 单维长收基缩收益率的比较 2.3 基金价值表现 3.2 基金价值检查 2.3 基金价值表现 3.2 基金价值格表现 3.2 基金价值格单位 2.3 基金价值表现 3.2 基金价值格表现 3.2 基金价值格单位 2.3 基金价值表现 3.2 基金价值格表现 3.2 基金价值格量长 平及其与同期中做比较基缩收益率的比较 2.3 基础比较基缩收益率的比较 2.3 基础比较基缩收益率的比较 2.3 基础比较基缩收益率的比较 2.3 基础比较基缩收益率的比较 2.3 基础比较基缩收益率 2.0 -3 2.4 金价值格长 2.3 基础设置,2.4 基础设置	投资目标			发展阶	段下的优势资产》	行业投资机会,更好地	分享中国经济持续	
风感收益特征 朱基金风险与收益离子债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品 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 3.1 主要财务指标 基金原理有股公司 第一位,人民后,在中国建设银行股份有限公司 1.4 更财务指标 报告期位3.5 第二次 第一位,人民后,在中国建设银行股份有限公司 1.5 第二次 第一位,人民后,在中国大规设量 1.5 2,05 2,43 7,15 2,45 2,45 2,45 2,45 2,45 2,45 2,45 2,4	投资策略			本基金以周期优选投资策略为核心,并辅以个股精选和积极债券管理策略。				
株金管理人 特別	业绩比较基准			本基金	的业绩比较基准为	:沪深300指数×80%+上	证国债指数×20%。	,
基金托管人 中国建设银行股份有限公司 3.1 主要财务指标 \$ 3 主要财务指标和基金单组表现 单位6.人民币: 主要财务指标 报告期2015年10月1日-2015年12月31日) 1.本制已未期的 \$ 132,036,243.71 2.本期种间 \$ 380,091,071.60 3.加度平均基金份额本期科间 \$ 0.2899 4.期末基金资产净值 \$ 2.362,490,339.91 2.37 2.本用产制度 \$ 2.362,490,339.91 2.37 2.本用产制度 \$ 2.362,490,339.91 2.17 2.本用产品收益标准金本期利组收入,投资改益,其他收入,不含分允价值变动收益,补除相关费用后的余额。本期利润为本期已20次组加上丰格水价值变动收益。 3.2 指金价银份。 3.2 指金价值价值增长率及其与周则率增生较是很改善率的比较 3.2 指金价值价值增长率及其与国则率增生较是很改善率的比较 3.2 指金价值价值增长率及其与国则率增生较是很改善率的比较 4.2 增生的解析。2 2—4 2—4 2—4 2—4 2—4 2—4 2—4 2—4 2—4 2—	风险收益特征				:风险与收益高于6	等基金与货币市场基金	全,属于较高风险、	较高收益的品
3.1 主要财务指标 \$ 3 主要财务指标和基金净值表现 单位;人民币; 主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日) 1.本期已实现收益 132,036,243.71 2.本期時间 580,091,971,60 3.00至少3基金份额本期时间 0.2859 4.期末基金资产净值 2.362,490,339.91 5.期末基金份额净值 2.362,490,339.91 1.217 注:①新兰基金份据作标《包括持有人从影或交》基金的公司费用,计入费用员等系统查水平要估于得到数字。 ②本期日主动效益指注基金本期利则或人,投资效益,其他或人,不含公允价值变动效益)和除相关费用后的余额,本期利润为本期已。 3.21 基金价值表现 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值表现 3.2 基金价值表现 3.3 基金价值表现 4.3 第一次重要 查集工作人工作。 第一次重要 2.3 第一次 2.3 第一次 2.3 第一次 2.3 第一次 2.3 第一次	基金管理人			华夏基	金管理有限公司			
3.1 主要财务指标	基金托管人			中国建	t设银行股份有限2	(司		
主要財务指标 根告期(2015年10月1日-2015年12月31日) 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71 132,036,243.71	3.1 主要财务指标		5 -	主要	财务指标和基金净	值表现		单位, 人民币元
2.本期利润 580,091,971.60 3.加以平均基金份额本期利润 0.2859 4.期末基金资产净值 2.362,490,339,91 5.38末基金份额全值 2.362,490,339,91 5.38末基金分类净值 1.217 注:①对还基金业绩指标不包括特有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实系或盆水平要低于外列数字。 2.48年 2.48	主	要财务指标			报告	期(2015年10月1日-201	5年12月31日)	
3.加权平均基金份额本期利润 0.2859 4.期末基金份额本期利润 2.362.490.339.91 5.期末基金份额净值 1.237 注:①所比基金业绩指称不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后录示收益水平要低于外列数字。 ②本期上汇等形式的建变效金。 3.21 基金份额净值增长率及其与国则业绩计较基准收益率的比较 阶段 净值增长率0 ②维托半环维差 或端计较基准收益率 0.1-3 ②—④	1.本期已实现收益							132,036,243.71
4.期末基金资产净值 2.362.490.339.91 2.372.490.339.91 2.372.490.339.91 2.372.490.339.91 2.372.490.339.91 2.372.490.339.91 2.372.490.439.64.62.490.439.91 2.372.490.4391.4390.4391.4390.4391.4390.4391.4390.4391.4390.4391.4391.4391.4391.4391.4391.4391.4391	2.本期利润							580,091,971.60
5.期末基金份额净值 注:①所还基金价值指标不包括持有人从购成之易基金的各项费用,计人费用后求新收益水平要低于所列数字。 ②本期已实现兹结准基金本期利自收入,投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的余额。本期利润为本期已。 3.2 基金净值专型。 3.2 1 基金份额净值增长率及其与周期业绩比较基准收益率的比较 阶段 净值增长率0 净值增长率4 基础,较多数量数量,如绩比较基准收益率。	3.加权平均基金份额2	 期利润						0.2859
注:①所注基金的资格库水石银持有人从则或交易基金的名项费用,计人费用自实表收益水平聚焦于将列数字。 ②本期已或规立指检金本期利担处人、投资收益、其他收入(不合公允价值变或收益)对除相关费用后的余额。本期利润为本期已 则收益加上本限公益的值录取效益。 3.2 基金净值表现 3.2 基金净值增长平及其与周期业绩比较基准收益率的比较 阶级 净值增长率(4.期末基金资产净值							2,362,490,339.91
期間之時收益程基金本期利與收入民资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用后的余额。本期利润为本期已3 2000年起加上末期於允閒也等功效。 3.2 基金价值表到 3.2 基金价值。 6.2 第一个专用的企业,并不是一个专用的企业。 6.2 第一个专用的企业。	5.期末基金份额净值							1.217
りでは 中国電大半 ② 益率3 标准差④ U-3 2-4	②本期已实现收益 现收益加上本期公允价 3.2 悲金净值表现	指基金本期利息的 值变动收益。	7人、投资收益	、其他社	女人(不含公允价值	用后实际收益水平要低 直变动收益)和除相关费	于所列数字。 門后的余額,本期	利润为本期已实
过去三个月 29.88% 2.33% 13.57% 1.34% 16.31% 0.99%	阶段	净值增长率①		示准差			1)-3)	2-4
3.2.2 目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								0.99%



4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
St. 40	R7(95	任职日期	离任日期		19099		
代瑞亮	本基金的基金经 理、股票投资部 总监	2015-07-09	-	5年	北京大学金融学硕士。2010年7月 加人华夏基金管理有限公司,曾 任研究员、基金经理助理等。		
注:①上这任职任期,属任日期根据本基金管理人对外数据的任免日期填与。 ②加等从业的含义道从厅业协会(证券业处业人员资格管理办法)的相关规定。 4 管理人对指导和本基金产证理如守信部及的创资。 报告期点,本基金管理人严格遵守(中华人民类店间证券投资基金法)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理 《空义易制度性专业》、《基金管理》公开报投资,所方法品游应内实及影拍告意见、基金合同和其他有关起格法规、本着被定信							

5.1 1区四月	71本部並以)出口目01		金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	2,178,588,680.96	89.67
	其中:股票	2,178,588,680.96	89.67
2	固定收益投资	50,015,000.00	2.06
	其中:债券	50,015,000.00	2.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	150,493,241.69	6.19
7	其他各项资产	50,337,659.07	2.07
8	合计	2,429,434,581.72	100.00
5.2 报告》	用末接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 %)
Δ	农.林.牧.渔业	_	_

7	300156	相
8	300195	+
9	002085	7.
10	002387	19
5.4 报告期末	k按债券品种分类的	9個券担
序号	债金	學品种
1	国家债券	
2	央行票据	
3	金融债券	11.04
	其中:政策性金融	建街
4	企业债券	
5	企业短期融资券	
6	中期票据	
7	可转债 何交换的	贵)
8	同业存单	
9	其他	
10	合计	
5.5 报告期末		b 资产有
序号	债券代码	
1	019501	
2	-	
3	-	
4	-	
5	-	
5.10.1 本期 本 10.2 本报告 5.10.2 金本报告报报 5.10.3 本本报 5.11 投报告 5.11.1 在报告 5.11.2 期末	表表示的自己, 在明末来持有的产生。 市场来来持有的产生。 市场来来持有的企业。 市场来来持有的设计。 市场来来持有的设计。 市场来不是是投资的明价还是不基金投资的明价还是不基金投资的明价的价值。 市期来无量会投资的明价还是根本完全投资的明价值。 市期来无量会投资的明价值。 市期来无量会投资的明价值。 市期来无量会投资的明价值。 市期来无量会投资的明价值。 市期来无量会投资的明价值。 市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,本基金上市场,在市场,本基金上市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在市场,在	投资。 国投资。 投资。 设资。 等到公开 未超出。
序号		
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
	A 3.1	
5.11.4 期末7 本基金本报 5.11.5 期末7 本基金本报 5.11.6 投资 由于四舍五	等有的处于转股期 告期末未持有处于 前十名股票中存在 前十名股票中各在 当期末前十名股票 组合报告附注的其 人的原因、分项之和	的可转期 施通受标 中文字 计 与 合 计
本报告期期初點		
本报告期基金总		
减:本报告期基	金总赎回份額	
本报告期基金护	斥分变动份額	
本报告期期末差		
		oraba - 1 f
7.1 基金管理 本基金本报 7.2 基金管理 本基金本报	里人持有本基金份 告期无基金管理人 里人运用固有资金 告期无基金管理人	質変动情 医用固 投资本息 医用固
8.1 报告期F 2015年10月1 2015年10月2 2015年11月1 2015年11月2	內披露的主要事項 14日发布华夏基金 13日发布华夏基金 13日发布华夏基金 20日发布华夏基金 24日发布华夏基金	管理有序 管理有序 管理有序

L	租赁和商务服务	业			-		-		
M	科学研究和技术	服务业				231,572,910.73		9.80	
N	水利、环境和公共	设施管理业				-		-	
0	居民服务、修理和	其他服务业				-		-	
P	教育					-		-	
Q	卫生和社会工作					-		-	
R	文化、体育和娱乐	:业				-		-	
S	综合					-		_	
	合计			-	2,178,588,680.96				
5.3 报告期末	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				
序号	股票代码	股票名称	数量 般	-	/\4	价值	J:364	金額单位:人民币元 资产净值比例 %)	
1	300008	上海佳豪		969,781	20,71	158,796,174.60	+	6.72	
2	300310	官诵世纪		399,976		149,590,504.08	_	6.33	
3	000687	华讯方舟		242.282		141,646,459,64		6.00	
4	002665	首航节能		503,532		140,407,726.00	_	5.94	
5	300202	聚龙股份		319,857		139,056,196.83	-	5.89	
6	600171	上海贝岭		200,000		131,378,000.00	-	5.89	
7	300156	上海火ing 神雾环保		528,986		126,424,010.14	_	5.35	
8	300136	长荣股份		956,043		118,399,867,27	+	5.01	
9	002085	万丰奥威		413,120		109,834,201.60	_	4.65	
10	002083	男牛食品		229,837			_	4.14	
	按债券品种分类		3,2	229,637		97,093,333.10	'		
序号	债券品种			公允价值			金額单位:人民币元 占基金资产净值 比例 %)		
1	国家债券					50,015,000.00		2.12	
2	央行票据					30,013,000.00		2.12	
3	金融债券								
,	其中:政策性金	niA (ch							
4	企业债券	MDA (IP4							
5	企业短期融资参	to.							
6	中期票据	r							
7	可转债 何交换	(d))							
8	同业存单	(A 7							
9	其他								
10	合计					50.015.000.00		2.12	
		金资产净值比例大小	排序的前五名	债券投	资明细	30,013,000.00			
					-			金额单位:人民币元 占基金资产净值比	
序号	债券代码	债券名利		3	数量 (张)	公允价(例 %)	
1	019501	15国债0	1		500,000	50,0	5,000.00	2.12	
2	-	-			-		-	-	
3	-	-			-		-	-	
4	-	-			-	-		-	
5 5.6 超集期末	-	- 金资产净值比例大小	排尾的前十名	- 685 per up	去证券扣零用的	4	-	-	
本基金本报行 5.7 报金车报行 5.8 报金车报行 5.8 报金车报行 5.9 报金车报行 5.9 报报告报行 5.9 报报告报行 5.9 是金车基金 7.0 和本报行 5.10 和本报行 本基金本报行 5.10 和本报行 本基金本报行	告期末未持有资产 生物水未未价值占贵金 法按公允价值自贵金 法按公允价值自贵金 证据未完价特值占权的 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。	支持证券。 金资产净值比例大小 属。产净值比例大小 是指期货交易情况说明 投资。 设资政策 投资。 投资政策	排序的前五名 排序的前五名 明细	贵金属	投资明细	u.			

		单位:人民币元
序号	名称	金額
1	存出保证金	3,638,322.02
2	应收证券清算款	44,418,923.45
3	应收股利	=
4	应收利息	1,543,781.40
5	应收申购款	736,632.20
6	其他应收款	=
7	待摊费用	=
8	其他	-
9	合计 等有的处于转股期的可转换债券排卸 告期末未持有处于转股期的可转换债券。 前十名股票中存在流通受限情况的说明	50,337,659.07

由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 《6 开放式基	会心细流-h
30 710000	单位:份
报告期期初基金份额总额	2,094,013,784.07
报告期基金总申购份额	132,772,428.08
:本报告期基金总赎回份额	285,707,436.99
报告期基金拆分变动份额	=
报告期期末基金份额总额	1,941,078,775.16
§7 基金管理人运用固有 71 基金管理人运用固有	F资金投资本基金情况

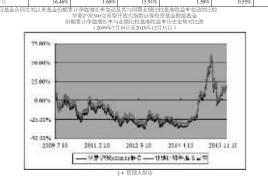
	本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
	7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
	本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
	§ 8 影响投资者决策的其他重要信息
	8.1 报告期内披露的主要事项
	2015年10月14日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告。
	2015年10月21日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代銷机构的公告。
	2015年11月13日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海汇付金融服务有限公司为代销机构的公告。
	2015年11月20日发布华夏基金管理有限公司关于成都分公司经营场所零更的公告。
	2015年11月24日发布华夏基金管理有限公司关于南京分公司经营场所变更的公告。
	2015年11月25日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在杭州数米基金销售有限公司调整申购、赎回数额限制的公告
	2015年12月1日发布华夏基金管理有限公司关于华夏资本管理有限公司变更相关事项的公告。
	2015年12月1日发布华夏基金管理有限公司关于施下基金投资非公开发行股票的公告。
	2015年12月18日发布华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构
告	
	2015年12月31日发布华夏基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后施下基金业务配弃工作安排的公告。
	8.2 其他相关信息
	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
油	\$、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管
H	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,以及积
Ë	资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批ROFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。
	2015年4季度,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)与苏宁金融、网易理财、聚宝滙等互助
瞬	#平台合作,为客户啊买华夏基金提供了更多优惠便捷的交易通道;(2)上线新版华夏基金管家客户端,增加手势密码、定投管理、基金
쑄	·功能,提高了手机查询和交易的便利性、安全性;(3)开展"感恩情报,速来对号"、"华夏回报送回报,写下寄语得红包"等客户互动
	周导和传递投资及生活理 今

9.3 查阅方式 按读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 复印件。

华夏基金管理有限公司 二〇一六年一月二十一日

※日本出日網:- ○一八年一月二十一日 基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在建設过程。该导性陈注或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担 明及淮南海庄、基金管理人的董事体刚员生、第一次被先生来能对本报告发表更见。 专业、任意、中国工能时开股分析或公司银标基金的市团成立,可以在一月19日夏核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告 等。依证复版内写不存在整定过载。该导导统法或董重大遗漏。 基金管理人承诺以源法日用 测验学的影响调谐强加度指盘金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过程业绩并不代表其未来表现。投资有知意,投资者在中出投资决策制应与相阅读本基金的招赛说明书。 本报告申请务的景本经申记 本报告明显为5年6月1日起至12月31日止。 5.2 基金产品解它

基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
报告期末基金份额总额	9,874,658,867.15(/)
投资目标	采用指数化投资方式,追求对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的E 报及适当的其他收益。
投资策略	本基金主要通过之易所买卖卖中咖啡回的方式改货于目标ITF的问题。根据较完 者申购,据回的现金流情况。本基金将综合目标ETF的批动性,折溢价率,病的指 成份股池边性等现据分析,对投资组合进行监控和膨胀,被切脱级标价的酸。基 也可以通过买人格的指数成份股末则影涂的引载。基金还可适度参与目标ETF 金份额交易和申购,限即之间的签案认识增基金份值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%。信年收益率、评价时应控期间折算)。
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
2.1.1 目标基金基本情况	
基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
2.1.2 目标基金产品说明	-
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现 基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深300指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金、风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基 主要投资产物的指数成份股及各选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。
	§ 3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标	单位:人民市
主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	251,563,978.0
2.本期利润	1,709,142,254.2
3.加权平均基金份额本期利润	0.160
4.期末基金资产净值	11,387,961,850.5
5.期末基金份额净值	1.15



华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

4.1 基金经理(或基金经理小组)	前介			
DI A	men da	任本基金的基	金经理期限	证券从业	NAME:
姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
张弘弢	本基金的基金经 理、数量投资部 执行总经理	2009-07-10	-	15年	硕士。2000年4月加入华夏基金管 理有限公司,曾任研究发展部总 经理、数量投资部副总经理等。
方军	本基金的基金经 理、数量投资部 总监	2009-07-10	-	16年	硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、华夏成 长证券投资基金基金经理助理、 兴华证券投资基金基金经理助理、华夏四报证券投资基金基金 经理助理、数量投资部副总经理 等。
②正等块地外排出。 2、宣明人工发生效量, 2、宣明人工发生效量, 2、宣明人工发生效量, 2、宣明人工发生效量, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个大型, 2、原来及一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	会交演从厅址协会全体 特別中本法企会经验 特別中本法企会经验 特別中本法企会经验 特別中本法企会经验 特別中,不会会经验 特別的原则的。 一個人工作。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 一個人工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的。 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的, 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的 工作的	理學公司开展校馆、研究 基金资产、在严格控制 经验验的所有基金和组合。 在内容的所有基金和组合。 特核行了《证券投资基金 特核行了《证券投资基金 易所还开党的目目反向 "所述"、企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	理功法》的相关规定 使的基础上,《公开括范朗特空内系统》,《公开括 设度风险的基础上,《公开括 设度风险的基础上,为 制定并严格遵守相应 管理公司公平交易。 "交易成交较少的单步,295% 于205年4月40年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3年3	察集证券投资基金的票等有人基。 等意见》基金合同。基金合同。基金分额持有人基。 的制度和流程。而在《中华》,是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	平的申应按期间折算)。許深300指数是 深风度市场整体表现。沪深300指数是 TT(年度沪深3005易型开放式指数 这种定。将联邦基金和半基源0.25个宣 周然或对实施了导致的急增长效策。 以民币如照纳人加高特产基金组织 以民币如照纳人加高特产基金组织 过度,为思建立中国的 实、也使得市场情绪逐渐恢复。流动 立基地增长率为15.91%。本基金本报告 由、成份投分生等产生的竞异。 尚指进一步观察。即与方面《经济仍面大战争的。成份投分生等产生的竞异。
IKLIMING	was ye/ MILLINUS				金额单位:人民币元
		wild to		4.3-	

报告期内	勤勉尽责地为基金份额 阴内管理人对本基金持 ,本基金未出现连续二- 阴末基金资产组合情况	的有人课水长明 有人数或基金资 十个工作日基金	、福定的回报。 产净值预警情形的i 分额持有人数量不i § 5 投资组	二百人或者基金资产	净值低于五千	万元的情形。	
	yridanisty XIII INCL					1000	颁单位:人民币元
序号	項目			金額		占基金总资	产的比例 %)
1	权益投资				13,758,025.15		0.12
	其中:股票				13,758,025.15		0.12
2	基金投资			10,7	96,571,990.89		94.65
3	固定收益投资			2	40,619,790.40		2.11
	其中:债券			2	240,619,790.40		
	资产支持证券				-		
4	贵金属投资				-		-
5	金融衍生品投资				-		-
6	买人返售金融资产				-		-
	其中:买断式回购的	买人返售金融资	i j ^{hs}		-		-
7	银行存款和结算备何	寸金合计		3	344,755,793.96		3.02
8	其他各项资产		11,037,915.30		0.10		
9	合计 11,406,743,515.70						100.00
5.2 报告期	明末投资目标基金明细					金1	順单位:人民币元
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	上里ム波力		
1	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限 公司	47KB		94.81

		行业类别		公允价值	占基金资产净值比例 %
代码	农、林、牧、渔业	1 J 3E5679		公儿川直	□無並以 (平国□) 物
A	采矿业 采矿业			-	
В	制造业			-	
C D		ale at she the fill she it.		7,414,646.13 710.190.00	0.
	电力、热力、燃气及	水生产和供应业		710,190.00	0.
E	建筑业			-	
F	批发和零售业	arref. ii		2,003,770.34	0
G	交通运输、仓储和曲	协体文业		3,265,803.36	0
Н	住宿和餐饮业	t de la transfer a		-	
I	信息传输、软件和信	言思技术服务业		299,632.32	0
J	金融业			638.00	0
K	房地产业			-	
L	租赁和商务服务业			-	
M	科学研究和技术服			-	
N	水利、环境和公共			-	
0	居民服务、修理和其	其他服务业		-	
P	教育			-	
Q	卫生和社会工作			-	
R	文化、体育和娱乐』	K		63,345.00	0
S	综合			-	
	合计			13,758,025.15	(
5.4 报告期	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
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 6
1	600271	航天信息	57,400	4,102,378.00	0
2	601018	宁波港	400,221	3,265,803.36	0
3	600690	青岛海尔	243,556	2,839,862.96	
3 4	600690 600153	青岛海尔 建发股份	243,556 135,941		0
				2,839,862.96	0
4	600153	建发股份 京能电力	135,941	2,839,862.96 2,003,770.34	0
4 5	600153 600578 000876	建发股份 京能电力 新 希 望	135,941 117,000 15,857	2,839,862.96 2,003,770.34 710,190.00 301,124.43	0 0
4 5 6 7	600153 600578 000876 300493	建发股份 京能电力 新 希 望 润欣科技	135,941 117,000 15,857 7,248	2,839,862.96 2,003,770.34 710,190.00 301,124.43 299,632.32	0 0
4 5 6	600153 600578 000876	建发股份 京能电力 新希望 润欣科技 南山铝业	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300	2,839,862,96 2,003,770.34 710,190.00 301,124.43 299,632.32 94,094.00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8	600153 600578 000876 300493 600219	建发股份 京能电力 新希望 润欣科技 南山铝业 博瑞传播	135,941 117,000 15,857 7,248	2,839,862.96 2,003,770.34 710,190.00 301,124.43 299,632.32	(((((((((((((((((((
4 5 6 7 8 9	600153 600578 000876 300493 600219 600880	建发股份 京能电力 新希望 润欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094,00 63,345,00	0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末按债券品种分类的	建发股份 京能电力 新 希 望 洞欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2.839.862.96 2.003.770.34 7710.190.00 301.124.43 299.632.32 94.094.00 63.345.00 55.671.74	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末按债券品种分类的	建发股份 京能电力 新希望 润欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094,00 63,345,00	0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末按债券品种分类的	建发股份 京能电力 新 希 望 洞欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2.839.862.96 2.003.770.34 7710.190.00 301.124.43 299.632.32 94.094.00 63.345.00 55.671.74	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末按债券品种分类的	建发股份 京能电力 新 希 望 洞欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124,43 299,632,32 94,094,00 63,345,00 55,671,74	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 未按债券品种分类的 债券	建发股份 京能电力 新 希 望 洞欣科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124,43 299,632,32 94,094,00 63,345,00 55,671,74	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末疫債券品种分类的 债券 央行票据	建发股份 京能电力 新希望 河 外科技 南 望 河 水科技 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094,00 63,345,00 55,671,74	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号	600153 600578 600578 000876 300493 600219 600880 600873 未按债券品种分类的 债务	建发股份 京能电力 新希望 河 外科技 南 望 河 水科技 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094.00 63,345,00 55,671,74 6价值 49,775,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末夜债券品种分类的 值等 央行票据 金融债券 块中,致硬性金融 企业债券	建发股份 京能电力 新希望 河 外科技 南 望 河 水科技 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094.00 63,345,00 55,671,74 6价值 49,775,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3	600153 600578 000578 000876 300493 600219 600880 600873 未夜债券品种分类的 债券 其中,投棄性金融 企业值等 企业组制验资金	建发股份 京能电力 新希望 河 外科技 南 望 河 水科技 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094.00 63,345,00 55,671,74 6价值 49,775,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3	600153 600578 000578 300493 600219 600880 600873 来按债券品种分类的 原本债券 处于预期 企业债券 企业信券 企业信券 中上购票额	建发股份 京邮电力 新希望 浏吹科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124,43 299,632,33 94,094,00 63,345,00 55,671.74 49,775,000,00 190,426,000,00	の の の の の の の の の の の の の の の の の の の
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3 4 5 6 7	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末夜供券品种分类的 使养 夹行弹组 鱼种创势 使生金融 企业期勤债券 企业团等 企业团等 企业团等	建发股份 京邮电力 新希望 浏吹科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124.43 299,632,32 94,094.00 63,345,00 55,671,74 6价值 49,775,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3 4 5 6 7 8	600153 600578 000578 000876 300493 600219 600873 未夜债券品种分类的 债券 與行彈相 金融债券 身中,政策性金融 企业债券 企业债券 企业团制融资券 中期限据 可持續 行交執债 同业存单	建发股份 京邮电力 新希望 浏吹科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124,43 299,632,33 94,094,00 63,345,00 55,671.74 49,775,000,00 190,426,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0
4 5 6 7 8 9 10 5.5 报告期 序号 1 2 3 4 5 6 7	600153 600578 000876 300493 600219 600880 600873 末夜供券品种分类的 使养 夹行弹组 鱼种创势 使生金融 企业期勤债券 企业团等 企业团等 企业团等	建发股份 京邮电力 新希望 浏吹科技 南山铝业 博瑞传播 梅花生物 债券投资组合	135,941 117,000 15,857 7,248 14,300 8,446 6,091	2,839,862,96 2,003,770,34 710,190,00 301,124,43 299,632,33 94,094,00 63,345,00 55,671.74 49,775,000,00 190,426,000,00	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0

1	国家颁安	国家惯券			49,775,000.00		0.44
2	央行票据				-		-
3	金融债券			190,426,000.00			1.67
	其中:政策性金	融债			190,426,000.00		1.67
4	企业债券	企业债券			-		-
5	企业短期融资类	企业短期融资券			-	-	
6	中期票据	中期票据		-		-	
7	可转债 何交换	可转债(可交换债)		418,790.40			0.00
8	同业存单		_		-		-
9	其他	其他		-			-
10	合计				240,619,790.40		2.11
5.6 报告期末	按公允价值占基金	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	150403	15次发0	13	1,100,000	110,220,	,000.000,	0.97

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	150403	15次发03	1,100,000	110,220,000.00	0.97	
2	150307	15进出07	500,000	50,165,000.00	0.44	
3	020083	15贴债09	500,000	49,775,000.00	0.44	
4	150301	15进出01	200,000	20,018,000.00	0.18	
5	150416	15次发16	100,000	10,023,000.00	0.09	
5.7 接货票未按公允的信息基金资产的值比例大小排序的前十名资产支持证券投资财施 本基金本报告期来持有资产分拣证券。 5.8 报告期末按公允的信息基金资产等值比例大小排序的前五名贵金园投资明细 本基金本报告期末共持有股金园。 5.9 报号期末投入允的信息基金资产等值比例大小排序的前五名权证投资明细 未基金本报告期末共持有股金。						

	5.10.1 报告》 本基金本报 5.10.2 本基: 本基金本报 5.11.1 本期 本基金本报 5.11.2 报告》 本基金本报 5.11.2 报告》 5.11.3 本期	本本基金投資的股指期貨役支持衛民说明 期本本基金投資的股指期貨稅在和概益明细 起期末天股指期稅稅稅 经稅稅抵捐期稅稅稅 建期末天股指期稅稅稅 定期末天風指期稅稅稅 在關稅投稅稅稅 原則未至基金投稅的固條期稅稅稅 因果本基金投稅的固條期稅稅稅。 即其本基金投稅的固條期稅稅稅。 即其本基金投稅的固條期稅稅稅。 即其本國稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅稅	
ì	5.12.1 报告》 高查,或在报告编 5.12.2 基金	日职人可任 日职人可任 線制日前一年內受到公开谴责,处罚的情形。 及管的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。 其他各项资产构成	资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案 单位:人民币元
	序号	名称	金額
	1	存出保证金	1,661,923.96
	2	应收证券清算款	38,458.09
		3.45.88.45	

1,201,335.36			8		
11,037,915.30			9		
金额单位:人民币			可转换债券明细	有的处于转股期的中	5.12.4 期末持
占基金资产净值比例 66)	公允价值	债券名称	债券代码		序号
0.00	170,090.40	航信转债		110031	1
金额单位:人民币			重受限情况的说明	十名股票中存在流过	5.12.5 期末前
流通受限情况说明	占基金资产净值比例 %)	流通受限部分的公允价 值	股票名称	股票代码	序号
重大事项	0.04	4,102,378.00	航天信息	600271	1
重大事项	0.03	3,265,803.36	宁波港	601018	2
重大事项	0.02	2,839,862.96	青岛海尔	600690	3
重大事项	0.02	2,003,770.34	建发股份	600153	4
重大事项	0.01	710,190.00	京能电力	600578	5
重大事项	0.00	301,124.43	新希望	000876	6
重大事项	0.00	94,094.00	南山铝业	600219	7
重大事项	0.00	63,345.00	博瑞传播	600880	8
eri-Luterrali	0.00	55 (21 24	Mortt Halada	600073	0

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价 值	占基金资产净值比例 66)	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	4,102,378.00	0.04	重大事项
2	601018	宁波港	3,265,803.36	0.03	重大事项
3	600690	青岛海尔	2,839,862.96	0.02	重大事项
4	600153	建发股份	2,003,770.34	0.02	重大事项
5	600578	京能电力	710,190.00	0.01	重大事项
6	000876	新希望	301,124.43	0.00	重大事项
7	600219	南山铝业	94,094.00	0.00	重大事项
8	600880	博瑞传播	63,345.00	0.00	重大事项
9	600873	梅花生物	55,671.74	0.00	重大事项
5.12.6 投资组织 由于四含五人的	合报告附注的其他 的原因,分项之和与	文字描述部分 5合计项之间可能	存在尾差。 § 6 开放式基金份额变动	1	单位
Total Control of the			y 71 100 - 010 110 100 100 100 100 100 100		

本报告期期初基金份额总额	10,330,456,532.67
本报告期基金总申购份额	910,980,009.23
减:本报告期基金总赎回份額	1,366,777,674.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,874,658,867.15
57 基金管理人沒用固有资金投资本基。 57 基金管理人沒用固有资金投资本基。 本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。	金情况

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易申细 本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 \$8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 报告期内披露的主要事项
2015年10月4日发布年度基金型有限公司关于前下部分开放式基金新维生京但工明泽基金销售有限公司为代销机构的公告。
2015年10月21日发布年度基金型有限公司关于前下部分开放式基金新维生京但工明泽基金销售有限公司为代销机构的公告。
2015年11月3日发布年度基金型有限公司关于前下部分开放式基金新售上商工作金融服务有限公司为代销机构的公告。
2015年11月3日发布年度基金型有限公司关于通信部分分司经营场所变更的公告。
2015年11月24日发布年度基金型有限公司关于通信分分司经营场所变更的公告。
2015年11月24日发布年度基金营工程和公司关于通信分分司经营场所变更的公告。
2015年11月24日发布年度基金营工程和公司关于通信分分司经营场所变更的公告。
2015年11月24日发布年度基金营工程和公司关于通信分子标工基金特性发生基础的公告。
2015年12月1日发布年度基金管理有限公司关于通信公司发生所依靠

2015年12月18日发布华夏基金管理有限公司关于版下部分开放式基金增加基亚正行(上海)基金销售投资则向有限公司分代销机构的公告。
2015年12月11日发布华夏基金管理有限公司关于版文部的机制实施信能下基金业务配套工作支撑的公告。
23.其他相关信息
— 2015年12月11日发布华夏基金管理有限公司关于报数指新机制实施信能下基金业务配套工作支撑的公告。
23.其他相关信息
— 24.其他相关信息
— 25.其他相关信息
— 26.其他相关信息
— 26.其他

倡导和传递投资及生活建全。

9.4 备查文件目录

9.4 备查文件目录

9.1 每查文件目录

9.1 中国证金结构基金募集的文件。

9.1 工作证金合格体基金募集的文件。

9.1 工作证金合格体基金募集的文件。

9.1 工作证金合格体基金募集的文件。

9.1 工作证金合格体基金募集的文件。

9.1 工作业金件。

1.1 工作业金件。

1.2 在发生。

1.3 工作业本、基金管理人和或基金托管人的住所。

2.4 发生。

1.4 发生。

1.5 工作业本、基金管理人和或基金托管人的住所。

2.5 发生。

1.5 发生。