中加货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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
报告送出日期:2016年01月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据基金合同的规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	12,837,913,566.87份
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,追求超过缴比较基准的现金收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,力求将各类风险降到最低,在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。主要投资策略包括:①短期利率水平预期策略;②收益率曲线分析策略;③组合剩余期限策略、期限配置策略;④类别品种配置策略;⑤短动投资策略;⑥流动性管理策略
业绩比较基准	七天通知存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,平均剩余期限控制在120天以内,属于低风险、高流动性、预期收益稳健的基金产品。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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 / 中加货币C
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月01日-2015年12月31日)	
	中加货币A	中加货币C
1.本期已实现收益	9,181,304.80	100,536,864.19
2.本期利润	9,181,304.80	100,536,864.19
3.期末基金资产净值	1,210,023,092.17	11,627,890,474.70

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,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金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中加货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7368%	0.0012%	0.3456%	0.0000%	0.3912%	0.0012%

2.中加货币C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7977%	0.0012%	0.3456%	0.0000%	0.4521%	0.0012%

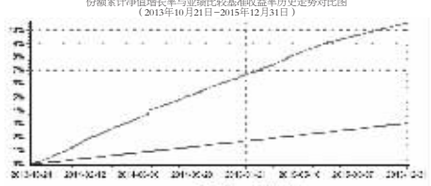
注:本基金(包括中加货币A和中加货币C)的收益分配是按月结转。

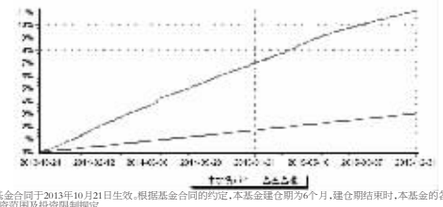
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中加货币

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

(2013年10月21日-2015年12月31日)





注:本基金基金合同于2013年10月21日生效,根据基金合同的约定,本基金建仓期为6个月,建仓期结束时,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
闫沛贤	基金经理	2013年10月21日	-	7	闫沛贤,帝国理工大学金融学硕士。2008年至2013年曾任职于平安银行资金交易部、北京银行资金交易部,担任债券交易员。2013年加入中加基金管理有限公司,现任投资研究部总监助理,固定收益部主管。中加货币市场基金基金经理(2013年10月至今),中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(2014年3月24日至今),中加纯债分级债券型证券投资基金基金经理(2014年12月17日至今),中加心享灵活配置混合型证券投资基金(2015年12月28日至今)。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时侯的价格和指令投放要因较大,可能存在瞬间价格、利益输送等违法违规风险情况进行监控,公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时交易同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了回反向交易控制的规则,同时加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时,公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,定期对组合间的同向交易分析,本报告期内基金管理人管理的所有投资组合间不存在同日反向交易,投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分析比较,并结合市场行情和潜在利益输送金额统计结果,表明投资组合间不存在利益输送的可能性,未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年在连续的降准降息时护下,资金价格一直维持在低位,但也呈现阶段性的特点。银行间市场资金价格中枢在农历新年前后出现阶段性反复后,3月中旬快速下行,7天回购利率从4.82%的阶段高点快速下行至3月末的1.98%。随后经历了一个月左右的小幅回升,7月以来一直维持在2.5%以下的水平。

在资金价格快速下行的推动下,二季度开始短端收益率出现了快速下行,曲线明显陡峭化。7月份股市的持续下跌,改变了市场的风险偏好和资金流向,债市也加速进入牛市轨道,2015年全年各券种收益率基本都回到了历史低位。由于经济的持续疲弱,美联储加息落地,及市场强烈的宽松预期,进入四季度,股市的反弹、IPO重启、财政刺激政策出台及人民币贬值加速引起外汇占款持续下降等利空因素均无法阻止收益率的继续下行,10年期国债收益率创下2009年以来的新低。

资金价格的快速下行带来了稳定的套息空间,其中二季度息差空间最大,三季度的资金价格和套息空间最为稳定,而进入四季度以来,息差空间出现明显波动,特别是11月下旬随着低评级信用市场出现明显调整,息差空间缩窄并贴穿至年底。

报告期内,基金规模增长较快,组合结合市场的波动特点,通过对资金面进行阶段性判断,择机调整杠杆水平和债券投资比例,同时合理安排了资产的预期分布,保持组合的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内中加货币A净值收益率为0.7368%,中加货币C净值收益率为0.7977%,业绩比较基准收益率0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值本低于预警值。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	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	买入返售金融资产	5,631,947,807.91	34.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
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

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	13.33
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,484,197,521.69	27.14
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	100

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

根据本基金的基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	50.68	27.14
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
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	27.14

注: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。

5.4 报告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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	840,727,414.54	6.55
	其中:政策性金融债	840,727,414.54	6.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,472,213,389.53	42.63
6	中期票据	50,035,411.35	0.39
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	6,362,976,215.42	49.56

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011599596	15宛矿SCP004	3,000,000	300,062,795.88	2.34
2	041566016	15包钢CP001	2,500,000	250,182,076.26	1.95
3	041566018	15淮南矿业CP003	2,500,000	250,033,195.01	1.95
4	011581004	15淮南矿SCP004	2,000,000	199,993,531.36	1.56
5	041569046	15山钢CP002	2,000,000	199,714,904.50	1.56
6	041556039	15沪华信CP001	2,000,000	199,707,385.04	1.56
7	011581005	15淮南矿SCP005	1,700,000	170,148,500.10	1.33
8	041561038	15万向钱潮CP001	1,500,000	150,679,532.40	1.17
9	041556023	15开滦CP002	1,300,000	129,990,717.97	1.01
10	110214	11国开14	1,200,000	120,307,917.11	0.94

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2357%
报告期内偏离度的最低值	0.1102%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1535%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

1.本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用"摊余成本法"估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

2.为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后,参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值,并且按相关规定进行临时公告。

3.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

4.相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过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基金资产净值20%。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
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:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	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	1,496,622,073.36	24,083,573,754.53
减:报告期基金总赎回份额	1,582,288,616.77	26,684,645,886.77
报告期期末基金份额总额	1,210,023,092.17	11,627,890,474.70

注:总申购份额中包含红利再投份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人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	交易份额(份)	交易金额(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	-	-

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准中加货币市场基金设立的文件

《中加货币市场基金基金合同》

《中加货币市场基金托管协议》

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市丰台区南四环西路188号17区15号楼12层

基金托管人地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话:400-00-95526(免长途费)

基金管理人网址:www.bobhm.com

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

2015年12月31日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。基金管理人的董事徐刚先生、葛小波先生未能对本报告发表意见。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏盛世混合
基金主代码	000061
交易代码	000061
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月11日
报告期末基金份额总额	1,941,078,775.16份
投资目标	紧密跟踪中国经济动向,把握中国经济的长期发展趋势和周期变动特征,挖掘不同发展阶段下的优势资产及行业投资机会,更好地分享中国经济持续、较快成长的发展成果,追求基金资产的长期、持续增值,抵御通货膨胀。
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。
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%。
风险收益特征	本基金风险与收益高于债券基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的品种。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

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.本期利润	580,091,971.60
3.加权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.期末基金份额净值	1.217

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

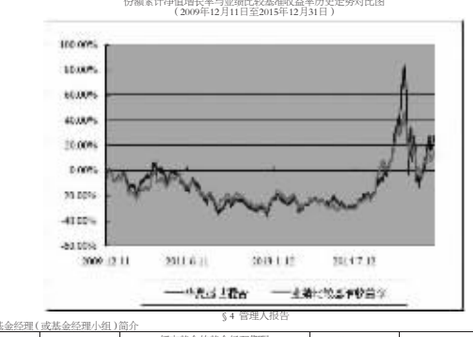
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	29.88%	2.33%	13.57%	1.34%	16.31%	0.99%

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

华夏盛世精选混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年12月11日至2015年12月31日)



§4 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
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月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理等。

注:①上述任职日期,离任日期按本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《基金管理公司异常交易管理办法》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时侯的价格和指令投放要因较大,可能存在瞬间价格、利益输送等违法违规风险情况进行监控,公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时交易同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为专项说明

报告期内,公司制定了回反向交易控制的规则,同时加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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,业绩基准为沪深300指数收益率×95%+1%(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,于2005年4月8日正式发布,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。本基金的投资策略主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF(华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金)的份额,从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

4季度,国际方面,美国经济继续复苏,失业率持续下降,美联储在12月份的议息会议上如期做出加息决定,将联邦基金利率提高0.25个百分点;新兴市场承受了较大的资金流出压力;欧洲经济则维持稳定,宽松政策低于市场预期,国内方面,虽然政府实施了积极的稳增长政策,然而经济复苏依然乏力,投资的边际改应递减,出口依然难见起色并面临日益不确定的外部环境,传统的需求管理政策遭遇诸多困境。为切实解决当前的结构性问题,引导经济持续健康发展,政府系统性地提出加强"供给侧改革"。报告期内,人民币如愿纳入国际货币基金组织(IMF)特别提款权货币篮子,加速了国际化进程,然而时逢美元强势周期,人民币对美元贬值明显,外汇交易中心发布CFETS人民币汇率指数,旨在更全面地反映人民币的价值变化。货币政策方面,央行降息降准,放开存款利率上限,继续深化利率市场化改革,并力图建立中国的利率走廊。

市场方面,经监管层前期的积极努力,A股逐步走出流动性危机,各项改革举措的不断推进与积极落实,也使得市场情绪逐渐恢复,流动性回暖,A股市场企稳回升。报告期内,沪深300指数上涨16.49%。

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、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.153元,本报告期份额净值增长率为16.46%,同期业绩比较基准增长率为15.91%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.55%,与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年1季度,国际方面,美元加息的靴子落地后,其对全球经济包括美国自身复苏进程的影响尚需进一步观察。国内方面,经济仍面临较大挑战,政府将全力推进"供给侧改革",预计在削减过剩产能、降低企业成本、消化房地产库存、扩大有效供给等方面将有较大动作。财政政策将更为积极,为了改革的顺利推进,货币政策料将维持宽松。如果经济企稳、改革措施落到实处,沪深300指数将会有较好的投资机会;反之,则可能呈震荡走势。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好相关投资工作。

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 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
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	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,572,247,994.88	66.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,351.26	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,333.97	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	224,574,637.64	9.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	150,190,452.48	6.36
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,178,588,680.96	92.22

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

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	300008	上海佳豪	5,969,781	158,796,174.60	6.72
2	300310	宜通世纪	2,399,976	149,590,504.08	6.33
3	000687	华讯方舟	5,242,282	141,646,459.64	6.00
4	002665	首航节能	4,603,532	140,407,726.00	5.94
5	300202	聚龙股份	4,319,857	139,056,196.83	5.89
6	600171	上海贝岭	6,200,000	131,378,000.00	5.56
7	300156	神雾环保	2,528,986	126,424,010.14	5.35
8	300195	长荣股份	4,956,043	118,399,867.27	5.01
9	002085	万丰奥威	3,413,120	109,834,201.60	4.65
10	002387	黑牛食品	5,229,837	97,693,355.16	4.14

5.4 报告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	50,015,000.00	2.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,015,000.00	2.12

5.5 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	019501	15国债01	500,000	50,015,000.00	2.12
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 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	3,638,322.02
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	50,337,659.07

5.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末按行业股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,094,013,784.07
本报告期基金总申购份额	132,772,428.08
减:本报告期基金总赎回份额	285,707,436.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本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资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

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销机构的公告。

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或都分公司经营场所变更的公告。

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的公告。

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旗下基金业务配套工作安排的公告。

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,在北京、上海、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理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2015年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、聚宝盆等互联网金融平台合作,为客户