

客户服务电话:400-836-6366  
(86)太平洋证券股份有限公司  
住所:广西省梧州市青年路389号志远大厦18层  
办公地址:北京市西城区北辰西路9号华远企业号D座3单元  
法定代表人:李长伟  
电话:010-88321717,18505050236  
传真:010-88321763  
联系人:唐昌田  
网址:www.tyzq.com

客户服务电话:400-665-0999  
(87)上海华夏财富投资管理有限公司  
住所:上海市虹口区东大名路677号一幢二楼268室  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法定代表人:汤晓东  
电话:010-88066632  
联系人:仲秋羽  
客户服务电话:400-817-5666  
(二)登记机构  
名称:华夏基金管理有限公司  
住所:北京市顺义区空港工业区A区  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层  
法定代表人:杨明辉

5.9 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

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

代码	名称	持仓量(手)	合约市值	公允价值变动	风险敞口
IP0007	期现TF1607合	26	23,360,500.00	766,220.00	买入指期购多头合约的 持仓是进行风险管理 的持仓部分
				746,220.00	
				746,400.00	
				-404,340.00	

5.9.2 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,主要投资的目标为指数成份股和备选成份股。基金留存的货币头寸或现金合同约定,投资于标的指数为基础资产的股指期货,旨在配合基金管理需要,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。

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。

5.11 投资组合公告

5.11.1 2016年9月10日广发证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。本基金为指数增强型基金,上述证券系标的指数成份股,投资决策程序符合相关法律规定的要求。

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  
金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,731,279.02
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收利润	9,312.01
5	应收申购款	60,179.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,790,763.01

5.11.4 期末持有的处于转换期的待转换债券明细  
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	航新债	69,402.70	0.02

5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名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,分项之和与合计数之间可能存在尾差。”

十二、基金的业绩  
1.基金的名称

本基金名称:华夏沪深300指数增强型证券投资基金。

5.基金的类型

通过量化方法进行积极的投资组合与风险管理,力争在控制本基金净值增长与业绩比较基准之间的跟踪误差不超过7.75%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。

5.1.基金的投资目标

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监管机构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)。

5.2.基金的投资策略

本基金为指数增强型基金,以沪深300指数为标的的指数,基金股票投资方面将主要采用指数增强型投资策略,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。

5.3.基金的投资策略  
(一)股票投资策略

本基金为指数增强型基金,在追求超额收益的同时,需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的跟踪误差,对组合跟踪误差

5.4.基金的投资策略  
本基金的投资策略主要借鉴国内外成熟的投资策略,在对标的指数成分股及其他股票基本面进行深入的研究后,运用多因子分析模型构建投资组合,同时优化交易组合、严格执行止损规则,实现超额收益。

5.5.基金的风险控制  
本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%。

(二)债券投资策略

结合对宏观经济运行周期判断策略、收益率曲线配置策略、券类属性

5.6.基金的投资策略  
5.6.1.基金的投资管理  
5.6.2.基金的投资决策  
5.6.3.基金的投资操作  
5.6.4.基金的投资组合  
5.6.5.基金的投资策略  
5.6.6.基金的投资组合  
5.6.7.基金的投资组合  
5.6.8.基金的投资组合  
5.6.9.基金的投资组合  
5.6.10.基金的投资组合  
5.6.11.基金的投资组合  
5.6.12.基金的投资组合  
5.6.13.基金的投资组合  
5.6.14.基金的投资组合  
5.6.15.基金的投资组合  
5.6.16.基金的投资组合  
5.6.17.基金的投资组合  
5.6.18.基金的投资组合  
5.6.19.基金的投资组合  
5.6.20.基金的投资组合  
5.6.21.基金的投资组合  
5.6.22.基金的投资组合  
5.6.23.基金的投资组合  
5.6.24.基金的投资组合  
5.6.25.基金的投资组合  
5.6.26.基金的投资组合  
5.6.27.基金的投资组合  
5.6.28.基金的投资组合  
5.6.29.基金的投资组合  
5.6.30.基金的投资组合  
5.6.31.基金的投资组合  
5.6.32.基金的投资组合  
5.6.33.基金的投资组合  
5.6.34.基金的投资组合  
5.6.35.基金的投资组合  
5.6.36.基金的投资组合  
5.6.37.基金的投资组合  
5.6.38.基金的投资组合  
5.6.39.基金的投资组合  
5.6.40.基金的投资组合  
5.6.41.基金的投资组合  
5.6.42.基金的投资组合  
5.6.43.基金的投资组合  
5.6.44.基金的投资组合  
5.6.45.基金的投资组合  
5.6.46.基金的投资组合  
5.6.47.基金的投资组合  
5.6.48.基金的投资组合  
5.6.49.基金的投资组合  
5.6.50.基金的投资组合  
5.6.51.基金的投资组合  
5.6.52.基金的投资组合  
5.6.53.基金的投资组合  
5.6.54.基金的投资组合  
5.6.55.基金的投资组合  
5.6.56.基金的投资组合  
5.6.57.基金的投资组合  
5.6.58.基金的投资组合  
5.6.59.基金的投资组合  
5.6.60.基金的投资组合  
5.6.61.基金的投资组合  
5.6.62.基金的投资组合  
5.6.63.基金的投资组合  
5.6.64.基金的投资组合  
5.6.65.基金的投资组合  
5.6.66.基金的投资组合  
5.6.67.基金的投资组合  
5.6.68.基金的投资组合  
5.6.69.基金的投资组合  
5.6.70.基金的投资组合  
5.6.71.基金的投资组合  
5.6.72.基金的投资组合  
5.6.73.基金的投资组合  
5.6.74.基金的投资组合  
5.6.75.基金的投资组合  
5.6.76.基金的投资组合  
5.6.77.基金的投资组合  
5.6.78.基金的投资组合  
5.6.79.基金的投资组合  
5.6.80.基金的投资组合  
5.6.81.基金的投资组合  
5.6.82.基金的投资组合  
5.6.83.基金的投资组合  
5.6.84.基金的投资组合  
5.6.85.基金的投资组合  
5.6.86.基金的投资组合  
5.6.87.基金的投资组合  
5.6.88.基金的投资组合  
5.6.89.基金的投资组合  
5.6.90.基金的投资组合  
5.6.91.基金的投资组合  
5.6.92.基金的投资组合  
5.6.93.基金的投资组合  
5.6.94.基金的投资组合  
5.6.95.基金的投资组合  
5.6.96.基金的投资组合  
5.6.97.基金的投资组合  
5.6.98.基金的投资组合  
5.6.99.基金的投资组合  
5.6.100.基金的投资组合  
5.6.101.基金的投资组合  
5.6.102.基金的投资组合  
5.6.103.基金的投资组合  
5.6.104.基金的投资组合  
5.6.105.基金的投资组合  
5.6.106.基金的投资组合  
5.6.107.基金的投资组合  
5.6.108.基金的投资组合  
5.6.109.基金的投资组合  
5.6.110.基金的投资组合  
5.6.111.基金的投资组合  
5.6.112.基金的投资组合  
5.6.113.基金的投资组合  
5.6.114.基金的投资组合  
5.6.115.基金的投资组合  
5.6.116.基金的投资组合  
5.6.117.基金的投资组合  
5.6.118.基金的投资组合  
5.6.119.基金的投资组合  
5.6.120.基金的投资组合  
5.6.121.基金的投资组合  
5.6.122.基金的投资组合  
5.6.123.基金的投资组合  
5.6.124.基金的投资组合  
5.6.125.基金的投资组合  
5.6.126.基金的投资组合  
5.6.127.基金的投资组合  
5.6.128.基金的投资组合  
5.6.129.基金的投资组合  
5.6.130.基金的投资组合  
5.6.131.基金的投资组合  
5.6.132.基金的投资组合  
5.6.133.基金的投资组合  
5.6.134.基金的投资组合  
5.6.135.基金的投资组合  
5.6.136.基金的投资组合  
5.6.137.基金的投资组合  
5.6.138.基金的投资组合  
5.6.139.基金的投资组合  
5.6.140.基金的投资组合  
5.6.141.基金的投资组合  
5.6.142.基金的投资组合  
5.6.143.基金的投资组合  
5.6.144.基金的投资组合  
5.6.145.基金的投资组合  
5.6.146.基金的投资组合  
5.6.147.基金的投资组合  
5.6.148.基金的投资组合  
5.6.149.基金的投资组合  
5.6.150.基金的投资组合  
5.6.151.基金的投资组合  
5.6.152.基金的投资组合  
5.6.153.基金的投资组合  
5.6.154.基金的投资组合  
5.6.155.基金的投资组合  
5.6.156.基金的投资组合  
5.6.157.基金的投资组合  
5.6.158.基金的投资组合  
5.6.159.基金的投资组合  
5.6.160.基金的投资组合  
5.6.161.基金的投资组合  
5.6.162.基金的投资组合  
5.6.163.基金的投资组合  
5.6.164.基金的投资组合  
5.6.165.基金的投资组合  
5.6.166.基金的投资组合  
5.6.167.基金的投资组合  
5.6.168.基金的投资组合  
5.6.169.基金的投资组合  
5.6.170.基金的投资组合  
5.6.171.基金的投资组合  
5.6.172.基金的投资组合  
5.6.173.基金的投资组合  
5.6.174.基金的投资组合  
5.6.175.基金的投资组合  
5.6.176.基金的投资组合  
5.6.177.基金的投资组合  
5.6.178.基金的投资组合  
5.6.179.基金的投资组合  
5.6.180.基金的投资组合  
5.6.181.基金的投资组合  
5.6.182.基金的投资组合  
5.6.183.基金的投资组合  
5.6.184.基金的投资组合  
5.6.185.基金的投资组合  
5.6.186.基金的投资组合  
5.6.187.基金的投资组合  
5.6.188.基金的投资组合  
5.6.189.基金的投资组合  
5.6.190.基金的投资组合  
5.6.191.基金的投资组合  
5.6.192.基金的投资组合  
5.6.193.基金的投资组合  
5.6.194.基金的投资组合  
5.6.195.基金的投资组合  
5.6.196.基金的投资组合  
5.6.197.基金的投资组合  
5.6.198.基金的投资组合  
5.6.199.基金的投资组合  
5.6.200.基金的投资组合  
5.6.201.基金的投资组合  
5.6.202.基金的投资组合  
5.6.203.基金的投资组合  
5.6.204.基金的投资组合  
5.6.205.基金的投资组合  
5.6.206.基金的投资组合  
5.6.207.基金的投资组合  
5.6.208.基金的投资组合  
5.6.209.基金的投资组合  
5.6.210.基金的投资组合  
5.6.211.基金的投资组合  
5.6.212.基金的投资组合  
5.6.213.基金的投资组合  
5.6.214.基金的投资组合  
5.6.215.基金的投资组合  
5.6.216.基金的投资组合  
5.6.217.基金的投资组合  
5.6.218.基金的投资组合  
5.6.219.基金的投资组合  
5.6.220.基金的投资组合  
5.6.221.基金的投资组合  
5.6.222.基金的投资组合  
5.6.223.基金的投资组合  
5.6.224.基金的投资组合  
5.6.225.基金的投资组合  
5.6.226.基金的投资组合  
5.6.227.基金的投资组合  
5.6.228.基金的投资组合  
5.6.229.基金的投资组合  
5.6.230.基金的投资组合  
5.6.231.基金的投资组合  
5.6.232.基金的投资组合  
5.6.233.基金的投资组合  
5.6.234.基金的投资组合  
5.6.235.基金的投资组合  
5.6.236.基金的投资组合  
5.6.237.基金的投资组合  
5.6.238.基金的投资组合  
5.6.239.基金的投资组合  
5.6.240.基金的投资组合  
5.6.241.基金的投资组合  
5.6.242.基金的投资组合  
5.6.243.基金的投资组合  
5.6.244.基金的投资组合  
5.6.245.基金的投资组合  
5.6.246.基金的投资组合  
5.6.247.基金的投资组合  
5.6.248.基金的投资组合  
5.6.249.基金的投资组合  
5.6.250.基金的投资组合  
5.6.251.基金的投资组合  
5.6.252.基金的投资组合  
5.6.253.基金的投资组合  
5.6.254.基金的投资组合  
5.6.255.基金的投资组合  
5.6.256.基金的投资组合  
5.6.257.基金的投资组合  
5.6.258.基金的投资组合  
5.6.259.基金的投资组合  
5.6.260.基金的投资组合  
5.6.261.基金的投资组合  
5.6.262.基金的投资组合  
5.6.263.基金的投资组合  
5.6.264.基金的投资组合  
5.6.265.基金的投资组合  
5.6.266.基金的投资组合  
5.6.267.基金的投资组合  
5.6.268.基金的投资组合  
5.6.269.基金的投资组合  
5.6.270.基金的投资组合  
5.6.271.基金的投资组合  
5.6.272.基金的投资组合  
5.6.273.基金的投资组合  
5.6.274.基金的投资组合  
5.6.275.基金的投资组合  
5.6.276.基金的投资组合  
5.6.277.基金的投资组合  
5.6.278.基金的投资组合  
5.6.279.基金的投资组合  
5.6.280.基金的投资组合  
5.6.281.基金的投资组合  
5.6.282.基金的投资组合  
5.6.283.基金的投资组合  
5.6.284.基金的投资组合  
5.6.285.基金的投资组合  
5.6.286.基金的投资组合  
5.6.287.基金的投资组合  
5.6.288.基金的投资组合  
5.6.289.基金的投资组合  
5.6.290.基金的投资组合  
5.6.291.基金的投资组合  
5.6.292.基金的投资组合  
5.6.293.基金的投资组合  
5.6.294.基金的投资组合  
5.6.295.基金的投资组合  
5.6.296.基金的投资组合  
5.6.297.基金的投资组合  
5.6.298.基金的投资组合  
5.6.299.基金的投资组合  
5.6.300.基金的投资组合  
5.6.301.基金的投资组合  
5.6.302.基金的投资组合  
5.6.303.基金的投资组合  
5.6.304.基金的投资组合  
5.6.305.基金的投资组合  
5.6.306.基金的投资组合  
5.6.307.基金的投资组合  
5.6.308.基金的投资组合  
5.6.309.基金的投资组合  
5.6.310.基金的投资组合  
5.6.311.基金的投资组合  
5.6.312.基金的投资组合  
5.6.313.基金的投资组合  
5.6.314.基金的投资组合  
5.6.315.基金的投资组合  
5.6.316.基金的投资组合  
5.6.317.基金的投资组合  
5.6.318.基金的投资组合  
5.6.319.基金的投资组合  
5.6.320.基金的投资组合  
5.6.321.基金的投资组合  
5.6.322.基金的投资组合  
5.6.323.基金的投资组合  
5.6.324.基金的投资组合  
5.6.325.基金的投资组合  
5.6.326.