上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏能源ETF
场内简称	能源行业
基金主代码	510610
交易代码	510610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年3月28日
报告期末基金份额总额	60,586,925份
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,以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为上证能源行业指数。
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。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。
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 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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	18,106,725.96
2.本期利润	19,024,190.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.2586
4.期末基金资产净值	77,830,458.17
5.期末基金份额净值	1.2846

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。

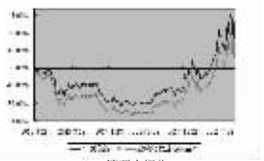
3.2 基金净值表现

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	21.07%	3.01%	19.65%	3.11%	1.42%	-0.10%

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

上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金
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
(2013年3月28日至2015年6月30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		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理	2013-03-28	-	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。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 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上证能源行业指数,是上证行业指数系列的组成部分。上证行业指数选择上海证券市场各行业中规模大、流动性好的股票组成样本股,自2009年1月9日起正式发布,以反映上海证券市场不同行业公司股票的整体表现。本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2季度,国际方面,美国经济稳定,美联储维持利率不变。国内方面,宏观经济依然较弱,经济增长动能不足。政府一方面积极实施稳增长政策,并通过改革推进结构调整;另一方面,通过对地方政府进行债务置换,降低地方融资平台债务风险。在政策刺激下,房地产价格和销量明显回升,但房地产投资仍然疲软。为降低实体经济融资成本,报告期内央行下调存贷款基准利率、降低存款准备金率。

市场方面,本季度以来,由于政府的一系列举措降低了股票市场的风险溢价水平,投资者风险偏好明显上升,资金持续流入股票市场,报告期内A股先是震荡上涨走势,但在6月中旬以后,由于受监管机构整顿两融及场外配资等影响,市场出现深度调整,跌幅明显。上证能源行业指数本报告期上涨19.65%,表现高于市场平均水平。

报告期内,本基金严格按照基金合同要求,在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对成份股的定期调整,努力降低成本、减少市场冲击。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行,经上海证券交易所同意,部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前,本基金的流动性服务商包括中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.2846元,本报告期份额净值增长率为21.07%,同期上证能源行业指数增长率为19.65%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.42%,与标的指数产生偏离的主要原因为成份股分红、成份股调整、申购赎回、日常运作费用等产生的差异。

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3季度,国际方面,预计美国经济将继续温和增长。国内方面,为应对宏观经济持续走弱,政府在财政政策方面料将更为积极、货币政策大概率也会相对宽松。房地产销量的复苏有助于宏观经济的企稳。如果经济或货币政策超预期,A股市场或呈震荡上涨走势,上证能源行业指数作为周期性指数,受宏观经济影响较大,在经济或政策超预期时或有强于大盘的表现。

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其他模式盈利的投资目标。同时,我们也将积极争取推动产品的进一步创新,充分发挥ETF的功能,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	76,043,975.25	96.21
	其中:股票	76,043,975.25	96.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	2,974,023.63	3.76
7	其他各项资产	20,461.94	0.03
8	合计	79,038,460.82	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	59,416,754.88	76.34
C	制造业	7,469,590.37	9.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,076,902.56	1.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,788,683.44	3.58
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	5,307,276.00	6.82
	合计	76,059,207.25	97.72

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	600028	中国石化	1,286,292	9,081,221.52	11.67
2	601857	中国石油	770,471	8,729,436.43	11.22
3	601088	中国神华	302,051	6,297,763.35	8.09
4	600583	海油工程	345,059	5,748,682.94	7.39
5	600256	广汇能源	510,315	5,307,276.00	6.82
6	600688	上海石化	359,710	3,859,688.30	4.96
7	601918	国投新集	233,985	3,601,029.15	4.63
8	601898	中煤能源	305,239	3,485,829.38	4.48
9	600157	永泰能源	466,422	3,208,983.36	4.12
10	601808	中海油服	105,921	2,959,432.74	3.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	19,959.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	501.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,461.94

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	86,586,925
本报告期基金总申购份额	3,320,500,000
减:本报告期基金总赎回份额	3,346,500,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,586,925

§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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

金额单位:人民币元

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	10,001,000	16.51%	10,001,000	16.51%	不少于三年
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,000	16.51%	10,001,000	16.51%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内披露的主要事项

2015年5月9日发布华夏基金管理有限公司公告。

9.2 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ODII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,目前旗下管理12只ETF产品,分别为华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股ETF、华夏中证500ETF、华夏上证50ETF、华夏中小板ETF、华夏能源ETF、华夏材料ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏恒生ETF和华夏沪港通恒生ETF,初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数以及海外市场指数的ETF产品线。

2季度,在《上海证券报》主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中,华夏永福养老理财混合基金、华夏沪深300ETF基金获得“金基金”产品奖。

在客户服务方面,2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)将华夏基金网上查询和自助语音的数据更新时间提前,让客户能更及时地了解交易信息;(2)在华夏基金网上交易平台新增账户损益数据展示,为网上交易客户提供了解投资盈亏情况的便捷渠道;(3)开展“我的投资我的团”、“2015年北京马拉松华夏基金训练营”等客户互动活动,倡导和传递投资及生活理念。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

10.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

10.1.2《上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》;

10.1.3《上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》;

10.1.4法律意见书;

10.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

10.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

10.2 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。

10.3 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
二〇一五年七月十八日

华夏盛世精选混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月16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。

根据基金管理人2015年7月3日刊登的《华夏基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》,华夏盛世精选股票型证券投资基金自2015年7月15日起更名为华夏盛世精选混合型证券投资基金。

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4月1日起至6月30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	2,361,538,563.44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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,658,185,083.29
2.本期利润	726,777,192.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2400
4.期末基金资产净值	3,244,652,255.80
5.期末基金份额净值	1.374

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。

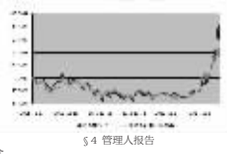
3.2 基金净值表现

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	13.27%	2.84%	8.85%	2.09%	4.42%	0.75%

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

华夏盛世精选混合型证券投资基金(原华夏盛世精选股票型证券投资基金)
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6月30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		
阳琨	本基金的基金经理、公司副总经理、投资总监	2009-12-18	-	20年	北京大学MBA。曾任宝盈基金基金经理助理,益民基金投资部部门经理,中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理等。2006年8月加入华夏基金管理有限公司,曾任策略研究员、股票投资部副总经理、兴和证券投资基金基金经理(2009年1月1日至2012年1月12日期间)、兴华证券投资基金基金经理(2007年6月12日至2013年4月11日期间)等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 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

本基金主要采取完全复制法及其他合理方法构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等原因导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 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

2季度,国际经济方面较为稳定但也存在一定不确定性,美国经济持续复苏,预期美联储将于9月进入加息周期,希腊债务违约加剧,使得欧洲行存较大不确定性;中国经济增速依然处在寻底过程中,在稳增长的背景下货币政策较为宽松,央行降准降息,金融市场流动性充裕,但实体经济融资成本仍维持在较高水平,房地产销售略有起色。A股市场保持活跃,创业板在“全民创业、万众创新”、“互联网+”政策带动下不断创出新高,但在季末监管层清查两融的影响下,向下波动显著。

报告期内,本基金大部分时间内保持了较高的股票仓位,精选行业发展前景远大、公司战略明晰、管理层执行力较强的公司进行投资,主要关注互联网及其与传统行业的结合、半导体及芯片行业、移动医疗、国企改革、传统行业整合等机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.374元,本报告期份额净值增长率为13.27%,同期业绩比较基准增长率为8.85%。

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3季度,中国经济仍难有明显起色,房地产销售的短期回暖并不能迅速带动整个产业链的复苏,货币政策仍将处在宽松周期中,地方债务置换等措施仍有望稳步推进,而财政政策的影响则会比有望推动基建发展。2季度监管层规范两融带来的市场大幅波动使得前期杠杆过高的资金损失显著,后续金融杠杆的使用将更为谨慎,规范,居民资产配置从固定资产向金融资产转移的逻辑仍然延续,预计3季度A股市场仍存在结构性机会。本基金将重点关注国企改革、互联网及其对传统行业的改造、医疗大健康、半导体产业链、工业4.0等相关行业,精选个股。

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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,006,888,680.82	86.55
	其中:股票	3,006,888,680.82	86.55
2	固定收益投资	219,252,602.20	6.31
	其中:债券	219,252,602.20	6.31
	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	232,288,787.95	6.69
7	其他各项资产	15,629,647.35	0.45
8	合计	3,474,059,718.32	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

序号	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	2,454,484,769.60	75.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	102,758,682.26	3.17
E	建筑业	6,640,634.00	0.20
F	批发和零售业	1,492.09	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	350,156,241.99	10.79
J	金融业	240,397.25	0.01
K	房地产业	389.61	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	51,895.00	0.00
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	50,354,179.02	1.55
R	文化、体育和娱乐业	42,200,000.00	1.30
S	综合	-	-
	合计	3,006,888,680.82	92.67

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	002601	佰利联	6,090,766	277,129,853.00	8.54
2	300077	国民技术	5,503,662	234,125,781.48	7.22
3	300418	昆仑万维	1,470,630	212,917,811.40	6.56
4	002085	万丰奥威	2,599,700	159,283,619.00	4.91
5	002612	朗姿股份	2,342,861	158,025,974.45	4.87
6	300195	长荣股份	4,956,043	140,553,379.48	4.33
7	300104	乐视网	2,649,655	137,146,142.80	4.23
8	002665	首航节能	4,099,750	113,563,075.00	3.50
9	002479	富春环保	5,599,847	102,757,192.45	3.17
10	600651	飞乐音响	4,698,586	96,649,914.02	2.98

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	100,675,000.00	3.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,577,602.20	3.65
	其中:政策性金融债	118,577,602.20	3.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	219,252,602.20	6.76

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	150301	15进出01	600,000	60,348,000.00	1.86
2	018001	国开1301	568,260	58,229,602.20	1.79
3	019501	15国债01	500,000	50,385,000.00	1.55
4	019428	14国债28	500,000	50,290,000.00	1.55
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	1,967,471.06
2	应收证券清算款	4,087,913.75
3	应收股利	-
4	应收利息	4,267,686.15
5	应收申购款	5,306,576.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,629,647.35

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	3,916,100,286.33
本报告期基金总申购份额	609,970,584.05
减:本报告期基金总赎回份额	2,164,532,306.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,361,538,563.44

§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4月27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代销机构的公告。

2015年5月9日发布华夏基金管理有限公司公告。

2015年6月4日发布华夏基金管理有限公司关于在中国工商银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告。

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ODII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求满意的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告,在基金分类排名中(截至2015年6月30日数据),华夏盛世混合在36只偏股型基金(股票上限80%)中排名第12,华夏永福养老理财混合在16只偏债型基金中排名第6,华夏回报及回报二号混合基金分别在14只特定策略混合型基金中排名第5和第4;固定收益类产品中,华夏双债债券在88只普通债券型基金中排名第14,华夏薪金宝货币及华夏财富宝货币分别在150只货币型基金中排名第4和第8。在《上海证券报》主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中,华夏永福养老理财混合基金、华夏沪深300ETF基金获得“金基金”产品奖。

在客户服务方面,2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)将华夏基金网上查询和自助语音的数据更新时间提前,让客户能更及时地了解交易信息;(2)在华夏基金网上交易平台新增账户损益数据展示,为网上交易客户提供了解投资盈亏情况的便捷渠道;(3)开展“我的投资我的团”、“2015年北京马拉松华夏基金训练营”等客户互动活动,倡导和传递投资