

华夏海外收益债券型证券投资基金

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法律责任。
基金管理人中国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预示其未来表现，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	华夏收益债券(QDII)
基金代码	001061
交易场所	深圳证券交易所
基金合同生效日	2012年12月7日
报告期末基金份额总额	116,543,160.08
投资目标	在控制风险的前提下，追求长期稳定的回报。
投资策略	本基金主要通过全球证券市场公开募集的固定收益类金融工具，通过采取国内/境外股票策略、全球资产配置策略、行业配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略、大宗商品策略、汇率策略等，进行全球资产配置，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	同期人民币三年期定期存款税后利率。
风险收益特征	本基金为债券基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金、混合基金、另类投资基金等证券投资基金。本基金投资于境外资产的比例不高于基金资产的80%，其中投资于境外股票资产的比例不高于基金资产的20%。本基金投资于境外资产的比例不高于基金资产的80%，其中投资于境外股票资产的比例不高于基金资产的20%。
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
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank, National Association
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行
下属分级基金的基本情况	华夏收益债券(QDIIA) 华夏收益债券(QDII)
基金管理人	001061
报告期末下属分级基金的份额总额	10,487,843.47份 11,685,316.61份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	华夏收益债券(QDIIA) 213,190.58 华夏收益债券(QDII) 213,190.58
2.本期公允价值变动收益	华夏收益债券(QDIIA) 71,545.38 华夏收益债券(QDII) 71,545.38
3.本期加权平均基金份额本期利润	0.0090 0.0159
4.本期基金份额净值	1.1663,1032 1.2866,7007
5.本期基金份额净值增长率	1.11% 1.40%

注：①上述净值增长率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。
③2.2 基金净值表现
3.2.1 报告期内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
华夏收益债券(QDII) A

注：①上述净值增长率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。
③2.2 基金净值表现
3.2.2 报告期内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
华夏海外收益债券型证券投资基金

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
(2012年12月7日至2015年6月30日)

华夏收益债券(QDII) A

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

华夏收益债券(QDII) C

序号	权益投资	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中：普通股	-	-	-
2	权益投资	9,360,968.94	7.13
3	固定收益投资	101,114,688.32	77.05
其中：债券	-	-	-
4	资产支持证券	1,560,650.00	1.50
其中：固定收益	-	-	-
5	其他资产	1,560,650.00	1.50
其中：货币	-	-	-
6	衍生工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,701,810.65	6.63
8	其他资产	10,000,955.22	7.68
9	其他资产	13,270,070.13	10.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。
5.3 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。
5.4 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。
5.5 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.6 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.7 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.8 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.9 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.10 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.11 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.12 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.13 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.14 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.15 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.16 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.17 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.18 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.19 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.20 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.21 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.22 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.23 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.24 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.25 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.26 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.27 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.28 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.29 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.30 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.31 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.32 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.33 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.34 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.35 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.36 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.37 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.38 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.39 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.40 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.41 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.42 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.43 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.44 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.45 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.46 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.47 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.48 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.49 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.50 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.51 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.52 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.53 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.54 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.55 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.56 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.57 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.58 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.59 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.60 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.61 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.62 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.63 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.64 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.65 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.66 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.67 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.68 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.69 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.70 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.71 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.72 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.73 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.74 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.75 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.76 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.77 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.78 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.79 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.80 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.81 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.82 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.83 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.84 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.85 报告期末未持有股票及存托凭证投资分布
本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

恒生交易型开放式指数证券投资基金

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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年七月十八日

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法律责任。
基金管理人中国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预示其未来表现，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	恒生ETF
基金代码	159920
交易场所	深圳证券交易所
基金合同生效日	2012年8月10日
报告期末基金份额总额	941,559,210.65
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	本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，本基金将采用适当的替代策略以更好的跟踪标的指数，实现投资目标。
业绩比较基准	恒生指数收益率（扣除估值费、托管费、管理费及其他费用后的净值）
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险收益高于混合基金、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	中国银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

3.2 基金净值表现

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.4 基金管理人

3.5 基金托管人

3.6 基金销售机构

3.7 基金注册登记机构

3.8 基金审计机构

3.9 基金管理人

3.10 基金托管人

3.11 基金销售机构

3.12 基金注册登记机构

3.13 基金审计机构

3.14 基金管理人

3.15 基金托管人

3.16 基金销售机构