华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）

【2015】第四季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	华夏蓝筹混合（LOF）
场内简称	华夏蓝筹
基金主代码	160311
交易代码	160311
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2007年4月24日
报告期末基金份额总额	3,465,476,879.87份
投资目标	追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。基准收益率=沪深300指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金是混合基金，风险高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金，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	交通银行股份有限公司

§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	396,742,263.97
2.本期利润	559,426,615.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.1570
4.期末基金资产净值	5,000,388,572.96
5.期末基金份额净值	1.443

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

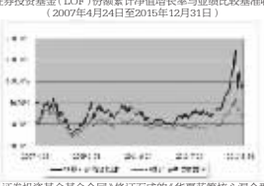
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.95%	1.29%	10.65%	1.00%	1.30%	0.29%

3.2.2 7日基金转型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

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）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

（2007年4月24日至2015年12月31日）



注：自2007年4月24日起，由《兴科证券投资基金基金合同》修订而成的《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

§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		
王怡欢	本基金的基金经理、股票投资部执行总经理	2011-02-22	-	11年	北京大学经济学硕士。2004年6月加入华夏基金管理有限公司，曾任行业研究员、行业研究主管、基金经理助理等。
董阳阳	本基金的基金经理、股票投资部总监	2013-03-11	-	7年	美国波士顿学院金融学硕士、工商管理学硕士。曾任中国国际金融有限公司投行业务部经理。2009年8月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理、投资经理等。

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

4季度，在管理层的持续大力维稳下，A股市场情绪逐渐修复，指数企稳反弹，但由于增量资金匮乏，反弹的结构性极为鲜明，以部分创业板个股、次新股和主题炒作类个股为代表的中小市值股票超额收益巨大，价值股和传统成长股涨幅明显滞后。场内资金风险偏好再度高涨，甚至创出新高。

报告期内，本基金在底部及时增加了仓位，但由于创业板持股相对较少，表现相对落后。

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1.443元，本报告期份额净值增长率为11.95%，同期业绩比较基准增长率为10.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内宏观经济将逐渐接近底部，但短期内还将处于惯性下滑状态；积极的财政政策和大刀阔斧的供给侧改革的有力落实尚待时日，这些措施对实体经济的正面影响短期尚难以体现。A股的潜在资金供给仍很充裕，但这些场外资金入市较难一蹴而就。我们认为，市场将呈现大格局的震荡态势，但不乏结构性、阶段性的机会。本基金将坚持长期投资理念和选股标准，努力规避风险，并在此基础上积极选股、灵活操作，更好地把握阶段性的市场机会。

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	4,178,096,133.70	82.36
	其中：股票	4,178,096,133.70	82.36
2	固定收益投资	232,003,072.80	4.57
	其中：债券	232,003,072.80	4.57
	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	655,644,151.96	12.92
7	其他各项资产	7,129,209.46	0.14
8	合计	5,072,872,567.92	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	35,626,249.46	0.71
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,044,041,064.38	40.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	178,625,676.52	3.57
E	建筑业	66,225,099.86	1.32
F	批发和零售业	208,777,068.53	4.18
G	交通运输、仓储和邮政业	206,186,521.37	4.12
H	住宿和餐饮业	18,045.30	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	287,818,737.80	5.76
J	金融业	752,931,374.84	15.06
K	房地产业	201,040,204.63	4.02
L	租赁和商务服务业	69,074,384.57	1.38
M	科学研究和技术服务业	12,630,000.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	53,573,228.00	1.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,842,591.90	0.32
R	文化、体育和娱乐业	45,685,896.54	0.91
S	综合	-	-
	合计	4,178,096,133.70	83.56

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	600612	老凤祥	7,796,576	337,279,877.76	6.75
2	600036	招商银行	18,299,940	329,215,920.60	6.58
3	600004	白云机场	9,701,829	138,057,026.67	2.76
4	601166	兴业银行	7,529,700	128,531,979.00	2.57
5	601318	中国平安	2,900,000	104,400,000.00	2.09
6	600900	长江电力	7,399,950	100,343,322.00	2.01
7	600728	佳都科技	2,390,000	89,099,200.00	1.78
8	600271	航天信息	1,099,803	78,602,920.41	1.57
9	600398	海澜之家	5,029,605	70,213,285.80	1.40
10	600826	兰生股份	1,778,817	61,262,457.48	1.23

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	128,889,000.00	2.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,118,100.00	1.22
	其中：政策性金融债	61,118,100.00	1.22
4	企业债券	41,995,972.80	0.84
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	232,003,072.80	4.64

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	020083	15贴债09	1,000,000	98,880,000.00	1.98
2	150416	15农发16	500,000	50,115,000.00	1.00
3	019501	15国债01	300,000	30,009,000.00	0.60
4	110402	11农发02	100,000	10,003,000.00	0.20
5	122641	PR武城投	80,000	6,160,000.00	0.12

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	2,745,388.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,838,950.39
5	应收申购款	544,870.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,129,209.46

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

金额单位：人民币元

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（%）	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	78,602,920.41	1.57	重大事项

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	3,649,139,247.37
本报告期基金总申购份额	44,326,086.50
减：本报告期基金总赎回份额	227,988,454.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,465,476,879.87

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	57,727,975.27
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	57,727,975.27
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.67

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成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30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，为客户购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、基金搜索等功能，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”等客户互动活动，倡导和传递投资及生活理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金兴科转型的文件；

9.1.2《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

9.1.3《华夏蓝筹核心混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

9.1.4法律意见书；

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照；

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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

二〇一六年一月二十一日

华夏收入混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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	华夏收入混合
基金主代码	288002
交易代码	288002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年11月17日
报告期末基金份额总额	710,770,539.67份
投资目标	本基金在严格执行投资风险管理的前提下，主要投资于盈利增长稳定的红利股，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。
投资策略	本基金遵循积极主动的投资理念，以红利股为主要投资对象，通过自下而上的方法精选个股获得股息收入和资本的长期增值。以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为80％富时中国A股红利150指数+20％富时中国国债指数。
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。本基金遵循积极主动的投资理念，以盈利增长稳定的高股息和连续分红股票类资产为主要投资工具，力争在严格控制风险的前提下实现基金资产的中长期稳定增值。
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	174,349,771.56
2.本期利润	689,823,538.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.9604
4.期末基金资产净值	3,432,536,382.70
5.期末基金份额净值	4.829

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

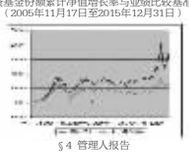
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	24.68%	1.53%	14.17%	1.26%	10.51%	0.27%

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

华夏收入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

（2005年11月17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		
郑煜	本基金的基金经理、董事总经理	2009-02-04	-	17年	中国科技大学管理科学与工程学硕士。曾任华夏证券高级分析师，大成基金高级分析师、投资经理，原中信基金股权投资部总监，华夏基金股票投资部副总经理、华夏经典配置混合型证券投资基金基金经理（2006年8月11日至2011年3月17日期间）、华夏红利混合型证券投资基金基金经理（2010年1月16日至2011年3月17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

4季度，美联储加息，美国经济仍处于改善趋势中，欧元区经济温和复苏，新兴市场开始感受到美元加息带来的压力。中国经济仍然未能摆脱疲态，制造业、消费增速放缓，进出口数据不佳，经济增速整体上仍处于向下寻底阶段，但以信息技术和社会服务业为代表的第三产业则保持了较快增长。

A股市场在经历了3季度快速下跌后，出现了较大幅度反弹，市场整体估值水平得到修复，不同行业和公司间呈现出较为明显的分化走势，新兴行业成长股仍然受到市场认可。

报告期内，本基金保持了既定的投资策略，维持了基本面踏实、未来增长前景清晰的中低估值成长股的核心配置，并增加了信息技术、旅游、教育、养老等新兴行业的配置比例。

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4.829元，本报告期份额净值增长率为24.68％，同期业绩比较基准增长率为14.17％。

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，国内经济增速仍将处于向下寻底的过程中，且没有明确的触底回升迹象。整体货币环境有望持续宽松，但货币政策空间已受美元加息和人民币汇率等因素制约。国内资本市场经历了2015年的剧烈波动，金融创新与金融改革进程需要持续观察。投资者可能需要降低对权益类资产的预期收益水平。

基于上述背景，预期市场将进入震荡格局，把握结构性投资机会成为重点，我们认为，2016年1季度或将迎来较好的结构性投资机会。

本基金将密切关注代表经济转型方向的新兴行业和具有明确基本面改善预期的细分行业投资机会，延续低PEG选股原则，主要配置公司基本面扎实、长期行业前景好、估值水平能与成长性相匹配的中等市值成长股。

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	2,910,547,119.03	83.53
	其中：股票	2,910,547,119.03	83.53
2	固定收益投资	114,660,169.40	3.29
	其中：债券	114,660,169.40	3.29
	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	313,000,000.00	8.98
	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	115,970,237.93	3.33
7	其他各项资产	30,374,181.39	0.87
8	合计	3,484,551,707.75	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	13,193,230.35	0.38
B	采矿业	57,634,355.90	1.68
C	制造业	1,675,293,735.06	48.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,122,420.78	2.80
E	建筑业	16,520,492.50	0.48
F	批发和零售业	74,453,160.70	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	36,530,605.49	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,520,009.90	2.72
J	金融业	106,510,597.77	3.10
K	房地产业	60,865,697.72	1.77
L	租赁和商务服务业	147,554,031.06	4.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	484,536,235.71	14.12
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	47,812,546.09	1.39
S	综合	-	-
	合计	2,910,547,119.03	84.79

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	300070	碧水源	3,968,133	205,430,245.41	5.98
2	000069	华侨城A	19,557,826	172,108,868.80	5.01
3	601888	中国国旅	1,754,821	104,078,433.51	3.03
4	002241	歌尔声学	2,798,248	96,819,380.80	2.82
5	000826	启迪桑德	2,432,233	96,365,071.46	2.81
6	002094	青岛金王	2,399,887	74,756,480.05	2.18
7	601166	兴业银行	4,000,000	68,280,000.00	1.99
8	600011	华能国际	7,700,000	67,221,000.00	1.96
9	002065	东华软件	2,589,269	64,990,651.90	1.89
10	002665	首航节能	2,078,271	63,387,265.50	1.85

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	60,018,000.00	1.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	54,199,419.40	1.58
	其中：政策性金融债	54,199,419.40	1.58
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）	442,750.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,660,169.40	3.34

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	600,000	60,018,000.00	1.75
2	018001	国开1301	541,940	54,199,419.40	1.58
3	132002	15天集EB	3,850	442,750.00	0.01
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	1,099,504.45
2	应收证券清算款	22,214,688.65
3	应收股利	-
4	应收利息	4,984,351.20
5	应收申购款	2,075,637.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,374,181.39

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

金额单位：人民币元

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（%）	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	64,990,651.90	1.89	重大事项

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	723,564,378.28
本报告期基金总申购份额	57,649,912.06
减：本报告期基金总赎回份额	70,443,750.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	710,770,539.67

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,481,290.61
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,481,290.61
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.63

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成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1日发布华夏基金管理有限公司关于旗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、