华夏财富宝货币市场基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华夏财富宝货币
基金主代码	000343
交易代码	000343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月25日
报告期末基金份额总额	54,542,495,466.66份
投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、个券选择策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的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	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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	571,298,692.48
2.本期利润	571,298,692.48
3.期末基金资产净值	54,542,495,466.66

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于本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本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

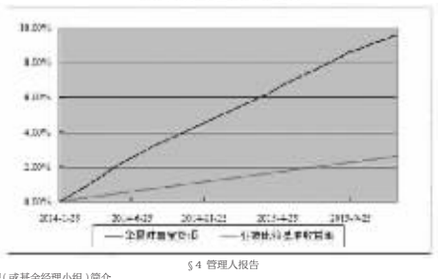
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8205%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.4802%	0.0016%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华夏财富宝货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年10月25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		
曲波	本基金的基金经理、现金管理部执行总经理	2013-10-25	-	12年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理、固定收益部总经理助理、现金管理部总经理,华夏货币市场基金基金经理(2012年11月1日至2014年7月25日期间),华夏安康信用优选债券型证券投资基金基金经理(2012年9月11日至2014年7月25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、研究活动的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,央行继续通过降准、降息等操作实际执行了宽松的货币政策,资金面持续处于宽松状态,回购利率维持在较低水平且成交量仍然较大。各类短期债券收益率继续下行约30bp,同业存款需求仍较为旺盛,但收益率受资金面宽松影响也出现约30bp的下行。

报告期内,本基金在资产的类别配置上绝大部分为短期存款,且在宽松的资金面环境下适当进行了部分杠杆操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金本报告期份额净值收益率为0.8205%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

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,由于经济基本面仍不乐观,且降低实体经济融资成本的任务仍然较重,预计货币政策仍将偏友好,利率水平有望继续下行,资金面仍将维持宽松。基于此,本基金将保持适当久期,做好资金期限匹配,在保持较好的流动性的同时努力抓住市场波段机会。

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	固定收益投资	26,476,283,755.90	42.04
	其中:债券	26,476,283,755.90	42.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	36,322,294,767.19	57.68
4	其他各项资产	178,466,761.48	0.28
5	合计	62,977,045,284.57	100.00

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	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	14.19	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	8,397,454,414.35	15.40
	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个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

报告期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	96
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	89

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	11.56	15.40
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	13.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	51.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	30.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	7.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	115.14	15.40

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	928,152,598.09	1.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,991,450,812.63	3.65
	其中:政策性金融债	1,991,450,812.63	3.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,373,580,700.20	11.69
6	中期票据	1,607,572,081.58	2.95
7	同业存单	15,575,527,563.40	28.56
8	其他	-	-
9	合计	26,476,283,755.90	48.54
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值比例(%)
1	111515115	15民生CD115	20,000,000	1,985,228,632.97	3.64
2	111507070	15招行CD070	20,000,000	1,985,109,740.06	3.64
3	111508141	15中信CD141	20,000,000	1,984,830,924.59	3.64
4	111510333	15兴业CD333	20,000,000	1,981,243,707.29	3.63
5	111511239	15平安CD239	18,000,000	1,786,353,579.07	3.28
6	111591662	15宁波银行CD098	10,000,000	993,204,027.43	1.82
7	111591675	15南京银行CD092	10,000,000	993,203,644.15	1.82
8	111591690	15上海农商银行CD029	10,000,000	993,049,482.92	1.82
9	111591712	15上海农商银行CD030	10,000,000	992,752,685.59	1.82
10	111511265	15平安CD265	10,000,000	989,532,971.50	1.81

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次
报告期内偏离度的最高值	0.10%
报告期内偏离度的最低值	0.06%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.07%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

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或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	177,640,716.08
4	应收申购款	826,045.40
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	178,466,761.48

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2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	79,093,750,718.92
本报告期基金总申购份额	27,799,750,407.68
减:本报告期基金总赎回份额	52,351,005,659.94
本报告期期末基金份额总额	54,542,495,466.66

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	635,174,282.34
报告期期间买入/申购总份额	466,530,614.09
报告期期间卖出/赎回总份额	320,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	781,704,896.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.43

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

金额单位:人民币元

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额	适用费率
1	申购	2015-10-12	220,000,000.00	220,000,000.00	0.00%
2	赎回	2015-11-01	-270,000,000.00	-270,000,000.00	0.00%
3	申购	2015-11-03	240,000,000.00	240,000,000.00	0.00%
4	赎回	2015-12-17	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
5	赎回	2015-12-23	-20,000,000.00	-20,000,000.00	0.00%
6	红利再投资	-	6,530,614.09	6,530,614.09	0.00%
合计		-	146,530,614.09	146,530,614.09	-

注:本基金的收益分配按日结转份额,列示在"红利再投资"项下一并披露。

§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。

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ROFII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募集的文件;

9.1.2《华夏财富宝货币市场基金基金合同》;

9.1.3《华夏财富宝货币市场基金托管协议》;

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

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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

2.1 基金产品概况

基金简称	华夏恒生ETF联接
基金主代码	000071
交易代码	000071
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21日
报告期末基金份额总额	79,611,169.45份
投资目标	本基金主要通过对恒生ETF基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合恒生ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金还将适度参与恒生ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利,以增强基金收益。基金也可以通过买入恒生指数成份股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标,基金还可投资于境外证券市场的股票、债券、跟踪同一标的指数的其他基金、金融衍生工具等产品,并在法规允许的条件下参与证券借贷,以增加收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:经人民币汇率调整的恒生指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为恒生ETF的联接基金,恒生ETF为股票型指数基金,因此本基金的风险与收益高于混合基金、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
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年10月22日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的恒生指数收益率。
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。

§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	37,719.32
2.本期利润	4,810,988.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0663
4.期末基金资产净值	85,971,821.01
5.期末基金份额净值	1.080

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 本报告期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

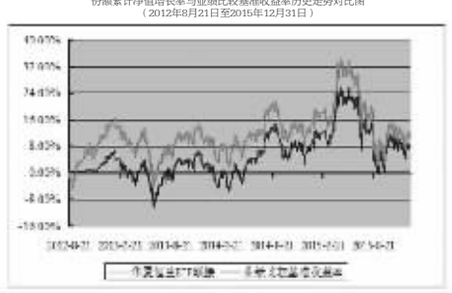
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.72%	1.27%	6.96%	1.30%	-0.23%	-0.03%

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

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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8月21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		
张弘弢	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理	2012-08-21	-	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。
王路	本基金的基金经理、数量投资部执行总经理、首席量化投资官	2012-08-21	-	17年	博士。曾任美国纽约德意志资产管理公司基金经理及定量股票研究负责人、美国纽约法兴银行组合经理、大成基金国际业务部副总监等。2008年11月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部总经理。
徐猛	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2015-12-21	-	12年	清华大学工学硕士。曾任财富证券助理研究员,原中关村证券研究员等。2006年2月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部基金经理助理等。

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。

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,预计美国经济将继续温和增长,美联储可能再次加息;欧洲、日本经济也将继续改善;其他主要发达国家和地区的经济总体会维持稳定;受中国经济偏弱和美元走强等因素的影响,预计油价仍会维持低位。国内方面,政府在继续推进改革的同时,也将在稳增长方面持续发力,经济有望探明底部,逐步企稳。改革政策的落实和货币宽松政策将会对经济和市场产生较大的影响。

市场方面,如果主要发达国家的经济能够保持稳定,国内经济能够在稳增长、促改革的推动下进一步改善,政府的救市举措能够成功稳定市场,则目前仍然处于历史相对较低估值水平的恒生指数将会有较好的投资机会;反之,可能面临压力。

本基金将根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,认真应对申购赎回等工作,力争和业绩比较基准保持一致。

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	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	79,171,431.65	91.85
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,803,525.08	7.89
8	其他各项资产	219,926.31	0.26
9	合计	86,194,883.04	100.00

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 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华夏恒生ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	79,171,431.65	92.09
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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	15,568.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	636.29
5	应收申购款	203,721.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,926.31

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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	69,531,450.25
本报告期基金总申购份额	15,322,308.41
减:本报告期基金总赎回份额	5,242,589.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	79,611,169.45

§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16日发布关于恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告。

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浙亚证行(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22日发布关于恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停申购、赎回、定期定额等业务的公告。

2015年12月23日发布华夏基金管理有限公司关于增聘恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理的公告。

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ROFII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。

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募集的文件;

9.1.2《恒生交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

9.1.3《恒生交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

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

恒生交易型开放式指数证券投资基金

【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	华夏恒生ETF
场内简称	恒生ETF
基金主代码	159920
交易代码	159920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年8月9日
报告期末基金份额总额	619,559,219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。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为经人民币汇率调整的恒生指数收益率。
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
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港