华夏沪深300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

2.1 基金产品概况

基金简称	华夏沪深300ETF联接
基金主代码	000051
交易代码	000051
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月10日
报告期末基金份额总额	9,874,658,867.15份
投资目标	采用指数化投资方式,追求对标的指数的有效跟踪,获得与标的指数收益相似的回报及适当的其他收益。
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的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标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。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率,评价时应按期间折算)。
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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年12月25日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年1月16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	中国工商银行股份有限公司

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	本基金业绩比较基准为沪深300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。

§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	251,563,978.09
2.本期利润	1,709,142,254.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1664
4.期末基金资产净值	11,387,961,850.53
5.期末基金份额净值	1.153

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

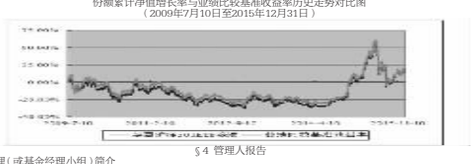
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.46%	1.60%	15.91%	1.59%	0.55%	0.01%

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

华夏沪深300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

(2009年7月10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	2009-07-10	-	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。
方军	本基金的基金经理、数量投资部总监	2009-07-10	-	16年	硕士。1999年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理、华夏回报证券投资基金基金经理助理、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沪深300指数,业绩基准为沪深300指数收益率×95%+1%(指年收益率,评价时应按期间折算)。沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成,于2005年4月8日正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深300指数是市场首只股指期货的标的指数,本基金的投资策略主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF(华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金)的份额,从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

4季度,国际方面,美国经济继续复苏,失业率持续下降,美联储在12月份的议息会议上如期做出加息决定,将联邦基金利率提高0.25个百分点;新兴市场承受了资大的资金出口压力,欧洲经济同期持稳定,宽松政策低于市场预期。国内方面,虽然政府实施了积极的稳增长政策,然而经济复苏依然乏力,经济的边际改善减缓,出口依然难见起色并面临计提不确定的外部环境,传统的需求管理政策遭遇诸多困境。为切实解决当前的结构性问题,引导经济持续健康发展,政府系统性地提出加强"供给侧改革"。报告期内,人民币如愿纳入国际货币基金组织(IMF)特别提款权货币篮子,加速了国际化进程,然而时逢美元强势周期,人民币对美元贬值明显,外汇交易中心发布CFETS人民币汇率指数,旨在更全面地反映人民币的价值变化。货币政策方面,央行降息降准,放开存款利率上限,继续深化利率市场化改革,并力图建立中国的利率走廊。

市场方面,经监管层前期的积极努力,A股逐步走出流动性危机。各项改革举措的不断推进与积极落实,也使得市场情绪逐渐恢复,流动性回暖,A股市场企稳回升。报告期内,沪深300指数上涨16.49%。

报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.153元,本报告期份额净值增长率为16.46%,同期业绩比较基准增长率为15.91%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.55%,与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数结构调整、申购赎回、成份股分红等产生的差异。

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2016年1季度,国际方面,美元加息的靴子落地后,其对全球经济包括美国自身复苏进程的影响尚需进一步观察。国内方面,经济仍面临较大挑战,政府将全力推进"供给侧改革",预计在削减过剩产能、降低企业成本、消化房地产库存、扩大有效供给等方面将有较大动作。财政政策将更为积极,为了改革的顺利推进,货币政策料将维持宽松。如果经济企稳,改革措施落到实处,沪深300指数将会有较好的投资机会;反之,则可能呈现震荡走势。

本基金将会根据基金合同要求,在紧密跟踪标的指数的基础上,做好相关投资工作。

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	13,758,025.15	0.12
	其中:股票	13,758,025.15	0.12
2	基金投资	10,796,571,990.89	94.65
3	固定收益投资	240,619,790.40	2.11
	其中:债券	240,619,790.40	2.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	344,755,793.96	3.02
8	其他各项资产	11,037,915.30	0.10
9	合计	11,406,743,515.70	100.00

5.2 报告期末投资目标基金明细

金额单位:人民币元

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	华夏沪深300ETF	股票型	交易型开放式	华夏基金管理有限公司	10,796,571,990.89	94.81

5.3 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	-	-
C	制造业	7,414,646.13	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	710,190.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,003,770.34	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,265,803.36	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,632.32	0.00
J	金融业	638.00	0.00
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	63,345.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	13,758,025.15	0.12

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	600271	航天信息	57,400	4,102,378.00	0.04
2	601018	宁波港	400,221	3,265,803.36	0.03
3	600690	青岛海尔	243,556	2,839,862.96	0.02
4	600153	建发股份	135,941	2,003,770.34	0.02
5	600578	京能电力	117,000	710,190.00	0.01
6	000876	新 希 望	15,857	301,124.43	0.00
7	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.00
8	600219	南山铝业	14,300	94,094.00	0.00
9	600880	博瑞传播	8,446	63,345.00	0.00
10	600873	梅花生物	6,091	55,671.74	0.00

5.5 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	49,775,000.00	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,426,000.00	1.67
	其中:政策性金融债	190,426,000.00	1.67
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)	418,790.40	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	240,619,790.40	2.11

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

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	150403	15农发03	1,100,000	110,220,000.00	0.97
2	150307	15进出07	500,000	50,165,000.00	0.44
3	020083	15贴债09	500,000	49,775,000.00	0.44
4	150301	15进出01	200,000	20,018,000.00	0.18
5	150416	15农发16	100,000	10,023,000.00	0.09

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 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	1,661,923.96
2	应收证券清算款	38,458.09
3	应收股利	-
4	应收利息	6,052,873.35
5	应收申购款	2,083,324.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,201,335.36
9	合计	11,037,915.30

5.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	航信转债	170,090.40	0.00

5.12.5 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	4,102,378.00	0.04	重大事项
2	601018	宁波港	3,265,803.36	0.03	重大事项
3	600690	青岛海尔	2,839,862.96	0.02	重大事项
4	600153	建发股份	2,003,770.34	0.02	重大事项
5	600578	京能电力	710,190.00	0.01	重大事项
6	000876	新 希 望	301,124.43	0.00	重大事项
7	600219	南山铝业	94,094.00	0.00	重大事项
8	600880	博瑞传播	63,345.00	0.00	重大事项
9	600873	梅花生物	55,671.74	0.00	重大事项

5.12.6 报告基金存在时点的其他文予描述部分

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	10,330,456,532.67
本报告期基金总申购份额	910,980,009.23
减:本报告期基金总赎回份额	1,366,777,674.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,874,658,867.15

§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商证券代销(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。

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"感恩情规,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《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》;

9.1.3《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

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

华夏沪深300指数增强型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	华夏沪深300指数增强
基金主代码	001015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月10日
报告期末基金份额总额	217,130,717.97份
投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过7.75%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金主要通过采取股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+1.5%(指年收益率,评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	华夏沪深300指数增强A / 华夏沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	001015 / 001016
报告期末下属分级基金的份额总额	145,121,038.15份 / 72,009,679.82份

§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)	
	华夏沪深300指数增强A	华夏沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	2,736,384.15	1,349,253.58
2.本期利润	30,497,628.00	16,527,682.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.2076	0.2158
4.期末基金资产净值	175,938,631.94	86,907,389.69
5.期末基金份额净值	1.212	1.207

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

华夏沪深300指数增强A:

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	20.24%	1.69%	16.04%	1.59%	4.20%	0.10%

华夏沪深300指数增强C:

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	20.22%	1.69%	16.04%	1.59%	4.18%	0.10%

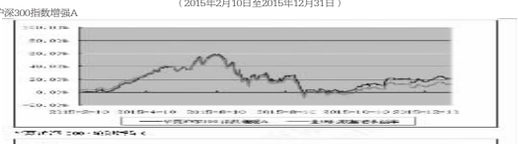
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深300指数增强型证券投资基金

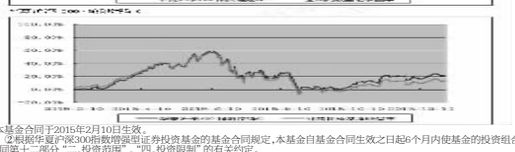
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年2月10日至2015年12月31日)

华夏沪深300指数增强A



华夏沪深300指数增强C



注:①本基金合同于2015年2月10日生效。

②根据华夏沪深300指数增强型证券投资基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分"二、投资范围"、"四、投资限制"的有关约定。

§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	2015-02-10	-	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。2009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。
周清	本基金的基金经理、数量投资部副总裁	2015-11-19	-	5年	北京大学应用数学专业硕士、2010年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任数量投资部研究员、投资经理、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沪深300指数,业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+1.5%(指年收益率,评价时应按期间折算)。沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好、最具代表性的300只股票组成,自2005年4月8日起正式发布,以综合反映沪深A股市场整体表现。沪深300指数是内地首只股指期货的标的指数,本基金的投资策略主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF(华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金)的份额,从而实现基金投资目标。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。

4季度,国际方面,美国经济继续复苏,美联储在12月份的议息会议上如期做出加息决定,新兴市场面临较大的资本流出压力。国内方面,宏观经济依然较弱,外需不振,经济内生增长动力不足,政府一方面多措并举确保经济的平稳运行,一方面继续通过改革推进结构调整。报告期内,人民币纳入特别提款权(SDR)货币篮子,加速了国际化进程;货币政策方面,央行继续降息降准,释放流动性,资金面相对宽松。

市场方面,在监管的积极引导下,A股逐步走出流动性危机,市场情绪逐渐恢复,流动性回暖,A股市场企稳回升。报告期内,沪深300指数上涨16.49%。基金投资运作方面,报告期内,本基金在做好跟踪标的指数的基础上,认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,华夏沪深300指数增强A基金份额净值为1.212元,本报告期份额净值增长率为20.24%;华夏沪深300指数增强C基金份额净值为1.207元,本报告期份额净值增长率为20.22%,同期业绩比较基准增长率为16.04%。本基金本报告期内类份额跟踪偏离度为+4.20%,C类份额跟踪偏离度为+4.18%。

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,美国经济将持续复苏,美联储加息进程会对全球市场带来较大影响。国内方面,经济仍面临较大的挑战,政府在继续推进改革仍同时也将继续出台一系列稳增长措施,财政政策将持续发力,政策的方向及落实情况将对市场、风格、行业及个股产生较大影响。如果经济企稳回升,政策的推进及落实超出预期,市场或将迎来不错的行情。

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超额收益。

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	222,279,537.33	83.84
	其中:股票	222,279,537.33	83.84
2	固定收益投资	81,799.20	0.03
	其中:债券	81,799.20	0.03
	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	37,491,265.19	14.14
7	其他各项资产	5,261,599.13	1.98
8	合计	265,114,200.85	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

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	619,920.00	0.24
B	采矿业	6,923,287.00	2.63
C	制造业	77,274,299.85	29.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,435,505.00	3.21
E	建筑业	9,045,894.78	3.44
F	批发和零售业	4,267,316.20	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	9,110,623.92	3.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,290,665.80	5.06
J	金融业	78,265,071.35	29.78
K	房地产业	10,349,967.43	3.94
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	1,798,170.00	0.68
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	2,898,816.00	1.10
S	综合	-	-
	合计	222,279,537.33	84.57

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	600837	海通证券	531,184	8,403,330.88	3.20
2	601318	中国平安	221,500	7,974,000.00	3.03
3	600016	民生银行	814,258	7,849,447.12	2.99
4	600036	招商银行	396,113	7,126,072.87	2.71
5	601328	交通银行	907,000	5,841,080.00	2.22
6	600705	中航资本	320,500	4,993,390.00	1.90
7	000001	平安银行	345,200	4,138,948.00	1.57
8	600276	恒瑞医药	82,300	4,042,576.00	1.54
9	601818	光大银行	873,000	3,701,520.00	1.41
10	600637	东方明珠	89,900	3,406,311.00	1.30

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-