

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2016年度报告摘要

数、海外市场指数等的产品线。

2016年,在中国证券报主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中,华夏基金获得“2015年度被动投资基金牛基金公司”奖;在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中,华夏基金获得“2015年度基金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面,2016年,华夏基金坚持以客户为导向,努力提高客户使用的便利性和服务体验:(1)改进业务流程,客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务,还可自助办理资产证明和盖章申请单,业务处理更加高效便捷;(2)增加交易渠道,与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财,并上线华夏理财网上交易系统,增加直销投递功能,为客户提供更多便捷的理财渠道,提高交易便利性;(3)开展“你定,我投”、“客户个性化白皮书”、“2016活期通年底账单”,2016北京马拉松等系列宣传活动,为客户提供多样化的关怀服务。

基金管理人秉承以诚实信用、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。

基金管理人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及其更新。

本报告中的财务数据经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。本报告期截至2016年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要须自年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

2016年12月31日
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:二〇一七年三月二十九日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人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及其更新。

本报告中的财务数据经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。本报告期截至2016年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要须自年度报告正文、投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 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联接基金
基金简称	华夏恒生ETF联接基金
基金主代码	000071
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年01月21日
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
报告期内基金总份额	908,629,614.87份
基金份额净值	不定价

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
基金简称	华夏恒生ETF
基金主代码	150900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012年01月21日
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
报告期内基金总份额	908,629,614.87份
基金份额净值	不定价

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金基金管理人对外披露的任命书填写。

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。

③根据本基金基金管理人发布的《华夏基金管理有限公司关于调整恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告》,自2017年2月10日起,王晔先生不再担任本基金基金经理。

④基金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》、《证券投资基金管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构指引》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、《基金管理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。

⑤管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金基金管理人根据《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》,公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易行为环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

⑥管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格执行相应的制度和流程,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,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理办法》公平交易制度指导意见》及《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗口(1日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

⑦管理人对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。

⑧管理人对报告期内涉及不公平交易、利益输送等违法违规行为的专项说明

本基金基金管理人不存在不公平交易、利益输送等违法违规行为。

⑨期间可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

⑩基金管理费

⑪基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

主要会计数据和指标	2016年末	2016年初	2015年末	2014年末
本期利润	21,000,622.33	10,261,246.00	-1,760,898.00	-1,760,898.00
本期利润	61,404,487.77	2,077,970.02	3,633,056.00	-
加权平均基金份额利润	0.1468	0.0323	0.0308	-
本期期末基金资产净值	12.47%	2.28%	3.02%	-
本期期末基金份额净值	10.64%	1.03%	3.09%	-
本期末可供分配利润	2016年末	2015年末	2014年末	-
本期可供分配利润	181,292,436.93	6,360,615.16	4,711,740.40	-
本期可供分配利润	0.1938	0.0799	0.2966	-
期末基金资产净值	1,116,922,660.79	85,071,212.01	89,127,094.90	-
期末基金份额净值	1.0308	1.0000	1.0000	-
期末可供分配利润	2016年末	2015年末	2014年末	-
期末可供分配利润	10.38%	0.00%	0.00%	-

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,计价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)扣除非费用后的余额,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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④基金净值表现

⑤基金份额净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的比较

3.2 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及其与同期业绩比较基准收益率历史走势图

(2012年8月21日至2016年12月31日)

3.2.1 基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势

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及其与同期业绩比较基准收益率历史走势图

(2012年8月21日至2016年12月31日)

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配记录。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金托管人、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ETP基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批境内与境外基金互认基金管理人、保险资金养老保险基金投资管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金养老保险基金投资管理人。华夏基金是业内ETF基金资产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,目前旗下管理华夏沪深300ETF、华夏MSCI中国A股ETF、华夏上证50ETF、华夏恒生ETF、华夏中小板ETF、华夏消费ETF、华夏金融ETF、华夏医药ETF、华夏恒生ETF、华夏沪港深恒生ETF、华夏上证50AH优选指数(LOF)和华夏快线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、海外市场指数等的产品线。

2016年,在中国证券报主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中,华夏基金获得“2015年度被动投资基金牛基金公司”奖;在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中,华夏基金获得“2015年度基金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面,2016年,华夏基金坚持以客户为导向,努力提高客户使用的便利性和服务体验:(1)改进业务流程,客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务,还可自助办理资产证明和盖章申请单,业务处理更加高效便捷;(2)增加交易渠道,与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财,并上线华夏理财网上交易系统,增加直销投递功能,为客户提供更多便捷的理财渠道,提高交易便利性;(3)开展“你定,我投”、“客户个性化白皮书”、“2016活期通年底账单”,2016北京马拉松等系列宣传活动,为客户提供多样化的关怀服务。

4.2 基金经理(基金经理)的基本情况

4.2.1 基金经理(基金经理)的基本情况

汪贵华,男,1970年1月出生,大学本科,中共党员,中国注册会计师,高级会计师,具有基金从业资格,现任华夏基金管理有限公司基金经理。

4.2.2 基金经理(基金经理)的过往管理经历

汪贵华先生于2002年7月至2006年1月就职于国泰君安证券有限公司,历任研究员、助理研究员、高级研究员,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理,2012年1月至今任基金经理。

4.2.3 基金经理(基金经理)的管理风格

汪贵华先生注重对宏观经济和政策的深入研究,善于把握市场脉搏,

善于挖掘行业景气度变化,精选个股,操作风格稳健,追求绝对收益。

4.2.4 基金经理(基金经理)的从业年限

汪贵华先生于2002年7月开始从事证券研究工作,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,2012年1月至今任基金经理,至今已有15年的证券从业经验。

4.2.5 基金经理(基金经理)的过往业绩

汪贵华先生于2002年7月开始从事证券研究工作,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,2012年1月至今任基金经理,至今已有15年的证券从业经验。

4.2.6 基金经理(基金经理)的获奖情况

汪贵华先生于2002年7月开始从事证券研究工作,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,2012年1月至今任基金经理,至今已有15年的证券从业经验。

4.2.7 基金经理(基金经理)的联系方式

汪贵华先生于2002年7月开始从事证券研究工作,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,2012年1月至今任基金经理,至今已有15年的证券从业经验。

4.2.8 基金经理(基金经理)的声明

汪贵华先生于2002年7月开始从事证券研究工作,2006年1月加入华夏基金管理有限公司,2012年1月至今任基金经理,