

华夏收入混合型证券投资基金

2016年度报告摘要

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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

基金管理人在集中建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27日核对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。

基金管理人的基金管理并不代表其未尽到责任。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，安信华明会计师事务所（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。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏收入混合型证券投资基金
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 2006年1月17日

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

报告期基金份额总额 688,796,249.89份

基金净值 1.00元

基金份额净值 1.00元

基金管理人和基金托管人

2.2 基金产品说明

本基金严格执行投资风险管理的前提下，主要投资于流动性较高的债权类资产，追求稳定的收入和长期的资本增值。

本基金将积极主动的投资理念，以红利股为主要投资对象，通过上下方方法筛选出具有稳定分红收入的股票。

本基金将通过深入研究，精选具有稳定分红收入的股票，同时兼顾股票的流动性和稳定性，从而构建股票组合。

本基金的业绩比较基准为90%的中国债券基金100指数+2%的货币市场基金指数。

本基金的风险收益特征与货币市场基金、债券型基金相似。

本基金在投资过程中将充分考虑流动性风险、利率风险和通胀分险类资产对于利率的敏感性，力争在严格控制风险的基础上实现基金资产的中长期稳健增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

基金名称 华夏收入混合型证券投资基金

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 2006年1月17日

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

报告期基金份额总额 688,796,249.89份

基金净值 1.00元

基金份额净值 1.00元

基金管理人和基金托管人

2.4 信息披露方式

基金经理年度报告公告的管理人互联网网址 www.ChinaAMC.com

基金份额净值公告的基金管理人住所地 上海市浦东新区陆家嘴环路1000号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标 2016年 2015年

本期已实现收益 -18,798,276.03 1,702,043,563.00

本期利润 -314,403,999.37 1,506,045,010.03

加权平均基金份额本期利润 -0.2857 1.7665

本期平均净值利润率 -6.70% 40.13%

本期基金份额净值增长率 -7.48% 41.53%

3.1.2期间数据和指标 2016年末 2015年末

3.2.1期间数据和指标 2016年 2015年

期末基金资产净值增长率 907.85% 983.20%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，计价费用和赎回费用低于所列数字。

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本期利润的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏收入混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与其同期业绩比较基准收益率历史走势对比图（2006年1月17日至2016年12月31日）

华夏收入混合型证券投资基金过去五年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去三年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去半年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一个月的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

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及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2006年1月17日至2016年12月31日）

华夏收入混合型证券投资基金过去五年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去三年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去六个月的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一个月的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的对比

华夏收入混合型证券投资基金过去五年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去三年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一年的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去六个月的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

华夏收入混合型证券投资基金过去一个月的基金净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图

3.3过去三年基金的利润分配情况

华夏收入混合型证券投资基金过去三年的利润分配情况

4.1 管理人报告

4.1.1基金管理人及基金经理的经验

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、首批基本养老保险基金投资管理人、首批养老金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人，以及特定客户资产管理人、养老金投资管理人、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综合型基金管理公司之一。

华夏基金以深入的研究为基础，尽力把握市场机会，为投资人提供良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至2016年12月31日），华夏医疗健康混合A、华夏医疗健康混合C、华夏行业配置混合A、华夏行业配置混合C、华夏医药基金、华夏医药基金A、华夏医药基金C在所有基金中排名第10和第13；华夏沪深300指数增强A在58只偏股型基金股票型基金中排名第12；固定收益类基金中，华夏信用债在194只货币型基金中排名第13。

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年度被动投资金牛基金”奖；在《上海证券报》主办的“第十三屆中国基金业金牛奖”评选中，华夏基金获得“2015年度基金金牛奖-债券投资金管理公司”奖。

4.1.2基金经理的定期报告

4.1.3基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配的情况的专项说明

报告期内，基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理规定》、《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指引》、《公开募集证券投资基金销售行为规范指导意见》等法律法规及基金合同的规定，勤勉尽责地履行了基金管理人的职责，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的专项说明

报告期内，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》、《证券投资基金销售管理规定》、《公开募集证券投资基金销售行为规范指导意见》、《公开募集证券投资基金销售机构内部控制指引》和其他有关法律法规，诚实守信、勤勉尽责地履行了基金管理人的职责，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本基金未进行关联交易。

4.3.1 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.2 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.3 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.4 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.5 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.6 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.7 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.8 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.9 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.10 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.11 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.12 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.13 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.14 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.15 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.16 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.17 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.18 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.19 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.20 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.21 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.22 公平交易制度和控制情况

本基金未进行关联交易。

4.3.23 公平交易制度和控制情况