华夏稳定双利债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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。

根据基金管理人2016年2月27日刊登的《华夏基金管理有限公司关于中信稳定双利债券型证券投资基金更名的公告》,中信稳定双利债券型证券投资基金自2016年3月11日起更名为华夏稳定双利债券型证券投资基金。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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	华夏稳定双利债券型证券投资基金
基金简称	华夏稳定双利债券
基金主代码	288102
交易代码	288102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月20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
报告期末基金份额总额	1,656,814,595.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类产品,投资目标是在强调本金稳妥的基础上,积极追求资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据宏观经济运行状况、货币政策走势及利率走势的综合判断,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上,采取顺势策略控制组合久期的波动范围,充分运用各种套利策略提升组合的持有期收益率,实现基金的保值增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为80%×中证综合债券指数+20%×税后一年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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	2014年
本期已实现收益	54,447,530.32	86,421,825.75	55,060,949.64
本期利润	-2,555,201.47	111,759,799.55	98,947,574.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0015	0.1336	0.1347
本期加权平均净值利润率	-0.14%	12.26%	12.99%
本期基金份额净值增长率	0.45%	13.15%	14.17%
3.1.2期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	-1,381,807.47	4,280,851.52	10,795,067.32
期末可供分配基金份额利润	-0.0008	0.0033	0.0159
期末基金资产净值	1,744,232,685.40	1,388,433,401.11	731,117,984.10
期末基金份额净值	1.0528	1.0859	1.0765
3.1.3累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	122.47%	121.46%	95.72%

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。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-2.47%	0.17%	-1.05%	0.10%	-1.42%	0.07%
过去六个月	-0.26%	0.13%	0.58%	0.08%	-0.84%	0.05%
过去一年	0.45%	0.11%	2.00%	0.06%	-1.55%	0.05%
过去三年	29.77%	0.24%	16.16%	0.09%	13.61%	0.15%
过去五年	37.22%	0.20%	23.12%	0.07%	14.10%	0.13%
自基金合同生效起起至今	122.47%	0.25%	43.93%	0.06%	78.54%	0.19%

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

华夏稳定双利债券型证券投资基金
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
(2006年7月20日至2016年12月31日)

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏稳定双利债券型证券投资基金
过去五年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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.384	33,249,302.99	31,721,762.76	64,971,065.75	-
2015年	1.250	38,045,549.80	57,420,541.08	95,466,090.88	-
2014年	0.580	11,911,591.95	27,675,928.32	39,587,520.27	-
合计	2.214	83,206,444.74	116,818,232.16	200,024,676.90	-

§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、首批基本养老保险基金投资管理人资格,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。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。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30日数据),华夏策略混合在75只灵活配置混合型基金(股票上限80%)中排名第7,华夏医疗健康混合A及华夏兴华混合A分别在58只偏股型基金(股票上限95%)中排名第10和第13,华夏沪深300指数增强A在39只增强指数股票型基金中排名第12;固定收益类产品中,华夏理财30天债券在38只短期理财债券型基金中排名第9,华夏薪金宝货币在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)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对账单,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,并上线华夏财富网上交易系统,增加直销定投通等功能,为客户提供更多优惠便捷的理财渠道,提高交易便利性;(3)开展"你定,我投"、"客户个性化白皮书"、"2016活期通年底晒账单"、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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
毛颖	本基金的基金经理、固定收益部高级副总裁	2013-05-13	-	14年	北京大学金融学硕士,曾任西南证券研究员等。2003年8月加入原中信基金,曾任研究员、基金经理助理、华夏基金固定收益部研究员等。

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 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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司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,加强交易分配环节的内部控制,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。

4.3.2 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,本基金管理人严格执行了《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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年,全球经济整体有所复苏,大宗商品价格上涨,通胀预期回升,全球货币政策立场与前期相比均有所收紧。此外,英国脱欧、特朗普当选新任美国总统,政治上转向保守的趋势更加明确。国内方面,货币政策在8月份以后逐步收紧,伴随美元升值、资金外流,政策转向去杠杆、防风险。

债市在经过两年的牛市后,市场情绪转向谨慎,1月份和4月份有两波短暂下跌,之后企稳反弹,10月份以后,市场出现年度最大调整,以10年期金融债为例,全年持有期收益为负。权益方面,受流动性收紧和政策收紧影响,股票市场震荡下跌。可转债市场在股市和债市下跌的双重影响下,全年整体下跌。

报告期内,本基金在年中增加了债券配置,但在年底进行了下调,持有的信用债比例有所下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.0528元,本报告期份额净值增长率为0.45%,同期业绩比较基准增长率为2.00%。

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2017年,短期经济将保持稳定,但中期下行压力也将显现。美元指数上行带动的资金流出压力、特朗普对华贸易政策等外部因素存在较大风险,而内部监管政策将遏制自2016年蓬勃发展的同业理财空转现象,MPA和理财监管的逐步落地可能会对市场产生一定负面影响。基于上述背景,我们认为,市场波动性将会增大,整个社会的杠杆率水平会逐步下降,转债和可交换债的供给将有明显上升,转债市场将重新迎来配置的较好时机。

2017年,本基金将保持偏低久期和仓位,积极参与波段操作,并择机配置性价比较高的转债品种,争取获得较好的收益。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面,公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度,修订了保密管理制度和员工培训制度,进一步完善合规制度建设;公司开展多种形式的合规培训,重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育,不断提升员工的合规守法意识;强化事前事中合规风险管理,严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料,加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核,防范各类合规风险。在风险管理方面,公司秉承全员风险管理的理念,采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作,加强对日常投资运作的管理和监控,督促投研交易业务的合规开展;在监察稽核方面,公司定期和不定期开展多项内部稽核,对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查监督,促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心,坚持基金份额持有人利益优先的原则,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等,以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定,本基金本报告期实施利润分配4次,符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为64,971,065.75元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明(2017)审字第60739337_B11号

华夏稳定双利债券型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华夏稳定双利债券型证券投资基金财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表和2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华夏基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3审计意见

我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了华夏稳定双利债券型证券投资基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 汤骏 马剑英

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2017年3月10日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华夏稳定双利债券型证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款		60,107,971.57	63,579,855.90
结算备付金		29,120,659.15	5,758,700.53
存出保证金		41,492.24	63,553.99
交易性金融资产		1,639,121,195.77	1,525,196,683.67
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,556,475,195.77	1,523,169,950.87
资产支持证券投资		82,646,000.00	2,026,732.80
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		54,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		30,595,403.11	32,296,607.21
应收股利		-	-
应收申购款		1,737,985.21	23,650,886.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,814,724,707.05	1,650,546,288.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		10,000,000.00	226,600,000.00
应付证券清算款		54,000,000.00	31,006,070.66
应付赎回款		2,124,570.15	583,402.85
应付管理人报酬		1,029,273.91	658,777.94
应付托管费		316,699.67	202,700.90
应付销售服务费		633,399.36	405,401.78
应付交易费用		134,635.79	110,411.76
应交税费		2,191,311.60	2,191,311.60
应付利息		2,083.32	54,761.73
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		60,047.85	300,047.85
负债合计		70,492,021.65	262,112,887.07
所有者权益:			
实收基金		1,656,814,595.98	1,278,654,656.01
未分配利润		87,418,089.42	109,778,745.10
所有者权益合计		1,744,232,685.40	1,388,433,401.11
负债和所有者权益总计		1,814,724,707.05	1,650,546,288.18

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0528元,基金份额总额1,656,814,595.98份。

7.2 利润表

会计主体:华夏稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		27,608,668.64	130,587,056.96
1.利息收入		91,599,287.27	55,184,830.70
其中:存款利息收入		552,988.87	384,449.19
债券利息收入		90,179,701.45	54,339,264.80
资产支持证券利息收入		699,603.86	200,665.75
买入返售金融资产收入		166,993.09	260,450.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-7,652,475.69	49,870,934.46
其中:股票投资收益		-	11,657,593.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-7,652,475.69	37,917,158.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	296,182.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-57,002,731.79	25,337,973.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		664,588.85	193,318.00
减:二、费用		30,163,870.11	18,827,257.41
1.管理人报酬		11,713,686.74	5,910,862.09
2.托管费		3,604,211.35	1,818,726.80
3.销售服务费		7,208,422.65	3,637,453.57
4.交易费用		258,975.53	508,196.01
5.利息支出		7,005,643.11	6,582,685.40
其中:卖出回购金融资产支出		7,005,643.11	6,582,685.40
6.其他费用		372,930.73	369,333.54
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-2,555,201.47	111,759,799.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-2,555,201.47	111,759,799.55

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏稳定双利债券型证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,278,654,656.01	109,778,745.10	1,388,433,401.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,555,201.47	-2,555,201.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	378,159,939.97	45,165,611.54	423,325,551.51
其中:1.基金申购款	2,320,650,654.15	202,168,389.62	2,522,819,043.77
2.基金赎回款	-1,942,490,714.18	-157,002,778.08	-2,099,493,492.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-64,971,065.75	-64,971,065.75
五、期末所有者权益(基金净值)	1,656,814,595.98	87,418,089.42	1,744,232,685.40
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	679,152,294.00	51,965,690.10	731,117,984.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	111,759,799.55	111,759,799.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	599,502,362.01	41,519,346.33	641,021,708.34
其中:1.基金申购款	1,215,071,117.62	100,657,018.39	1,315,728,136.01
2.基金赎回款	-615,568,755.61	-59,137,672.06	-674,706,427.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-95,466,090.88	-95,466,090.88
五、期末所有者权益(基金净值)	1,278,654,656.01	109,778,745.10	1,388,433,401.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

杨明辉 汪贵华 汪贵华
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
中信证券(山东)有限责任公司("中信证券(山东)")	基金管理人股东控股的公司
上海华夏财富投资管理有限公司("华夏财富")	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

无。

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

无。

7.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,713,686.74	5,910,862.09
其中:支付销售机构的客户维护费	420,203.71	348,490.66

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.65%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.65%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算,从基金管理人收取的基金管理费中划支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,604,211.35	1,818,726.80

注:①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	4,240,135.21
中国建设银行	1,399,523.20
中信证券	102,178.07
中信证券(山东)	14,282.73
华夏财富	757.69
合计	5,756,876.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏基金管理有限公司	1,025,206.15
中国建设银行	1,298,589.59
中信证券	93,065.03
中信证券(山东)	10,084.05
合计	2,426,944.82

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	60,107,971.57	308,378.10	63,579,855.90	232,273.19

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.5 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
116455	京东5优A	2016-1-22	2017-02-20	新发流通受限	100.00	100.00	180,000	18,000,000.00	18,000,000.00	-
116418	万科3A1	2016-1-04	2017-01-24	新发流通受限	100.00	100.00	150,000	15,000,000.00	15,000,000.00	-

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额10,000,000.00元,于2017年1月12日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层次:

第一层次:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.6.2各层次金融工具公允价值

截至2016年12月31日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为133,202,356.37元,第二层次的余额为1,505,918,839.40元,第三层次的余额为0元。(截至2015年12月31日止:第一层次的余额为25,070,808.27元,第二层次的余额为1,500,125,875.40元,第三层次的余额为0元。)

7.4.6.3公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌的股票、收盘价异常的债券,本基金将相关股票和债券公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌、债券收盘价能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月20日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值,并将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

7.4.6.4第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§8 投资组合报告

8.1 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:股票	-	-
2	固定收益投资	1,639,121,195.77	90.32
	其中:债券	1,556,475,195.77	85.77
	资产支持证券	82,646,000.00	4.55
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	54,000,000.00	2.98
	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	89,228,630.72	4.92
7	其他各项资产	32,374,880.56	1.78
8	合计	1,814,724,707.05	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未持有股票。

8.5 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 |