

# 华夏节能环保股票型证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十六日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（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 2018 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	华夏节能环保股票型证券投资基金
基金简称	华夏节能环保股票
基金主代码	004640
交易代码	004640
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月11日
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
报告期末基金份额总额	288,300,555.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	把握市场发展趋势，在有效管理投资风险的前提下，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	贺倩
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816

### 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	2018 年	2017 年 8 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-90,209,286.48	-11,823,117.82
本期利润	-76,208,895.28	-32,326,312.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2366	-0.0470
本期加权平均净值利润率	-30.72%	-4.75%
本期基金份额净值增长率	-24.10%	-8.01%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-88,357,885.40	-33,653,741.86
期末可供分配基金份额利润	-0.3065	-0.0801
期末基金资产净值	201,290,318.25	386,674,958.47
期末基金份额净值	0.6982	0.9199
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-30.18%	-8.01%

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	-2.54%	1.62%	-8.80%	1.64%	6.26%	-0.02%
过去六个月	-6.46%	1.41%	-18.09%	1.35%	11.63%	0.06%
过去一年	-24.10%	1.30%	-35.40%	1.26%	11.30%	0.04%
自基金合同生效起至今	-30.18%	1.15%	-33.44%	1.17%	3.26%	-0.02%

#### 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

华夏节能环保股票型证券投资基金

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 8 月 11 日至 2018 年 12 月 31 日)

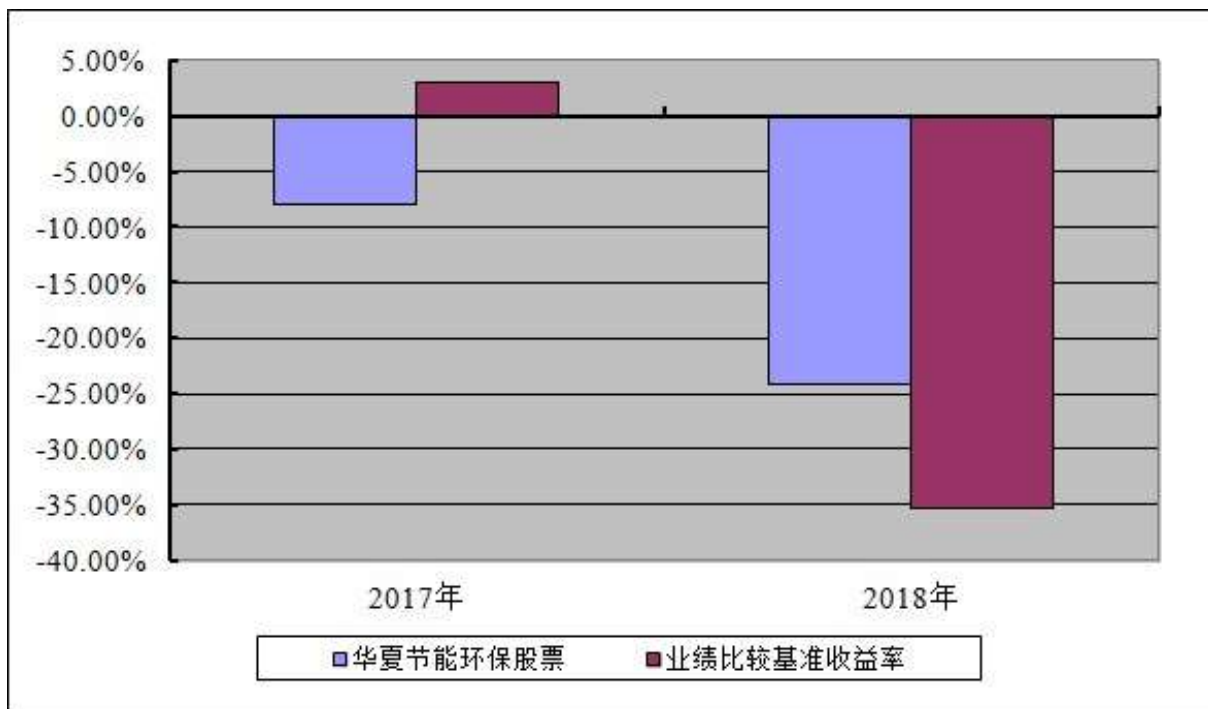


注：根据华夏节能环保股票型证券投资基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。

### 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比较

#### 华夏节能环保股票型证券投资基金

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



注：本基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §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、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人，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 2018 年 12 月 31 日数据），华夏经济转型股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金(A 类)”中排名 2/152；华夏圆和混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 60%-100%）”中排名 9/346；华夏沪港通恒生 ETF、华夏金融 ETF 在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 基金”中分别排名 1/109 和 9/109；华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)、华夏上证 50ETF 联接(A 类)在“股票基金-指数股票型基金-股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排名 2/73 和 10/73。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“中国基金业 20 周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”

颁奖评选中，公司荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖，旗下华夏沪深 300ETF 荣获第十五届“金基金”指数基金奖(一年期)，华夏上证 50ETF 荣获第十五届“金基金”指数基金奖(三年期)。

在客户服务方面，2018 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）华夏基金网上交易平台上线闪购业务，为客户提供更便捷的基金交易方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动情况，进一步提升客户体验；（3）对在线智能服务机器人小夏进行全新升级，帮助投资人一搜即达，让投资理财更加便捷、高效；（4）与中原银行、西安银行、长沙银行、开源证券等基金销售机构合作，为客户提供更多理财渠道；（5）开展“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”、“揭秘‘团长与团员默契度’”、“大胆预测退休金”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕佳玮	本基金的基金经理、投资研究部副总裁	2017-08-11	-	6 年	清华大学工学硕士。2012 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员等。

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合规守信情况的说明

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》等法律法规和基金合同，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，本基金出现 1 次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，为 ETF 基金因被动跟踪标的指数和本基金发生的反向交易。

#### 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

2018 年 A 股主要受到贸易战和国内去杠杆的宏观因素影响，全年呈现单边下跌态势。上证综指全年下跌 24.6%，创业板指和中小板指数跌幅更大，分别下跌 28.7% 和 37.8%。去杠杆使得 PPP 投资大幅收缩，融资环境变化更导致大量民营环保公司出现风险性事件，全年中证环保指数下跌 40.55%。

报告期内，本基金坚持精选个股的投资策略，“自下而上”选择了成长性好、壁垒高的公司进行集中投资。上半年由于环保板块集中杀跌，净值下跌较快。下半年，组合增加了具有逆周期属性的火电板块的配置，取得了较好的相对收益。但总体而言基金净值在全年仍然下跌较多，给投资者造成了亏损，对此我们深表歉意。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.6982 元，本报告期份额净值增长率为-24.10%，同期业绩比较基准增长率为-35.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，国内经济的下行压力仍然较大。虽然贸易战有可能达成暂时的缓解，但是去年的“抢出口”使得今年出口增长仍然面临较大压力。更重要的是国内需求的压力，我们认为主要来自地产和财政刺激两个方面。繁荣了 40 多个月的三四线地产在 2018 年下半年进入衰退周期，预计 2019 年地产销售将持续负增长。财政方面，2015-2018 年广义财政大幅扩张，通过 PPP、棚改、基建等形式，政府消耗了过去 20 年积累的结转基金结余。这意味着，在地产下行周期的制约下，政府再进一步通过财政刺激需求的手段是很有限的。除非看到地产的放松，或者是改革的进一步深化，否则经济在出清之前很难看到企稳的迹象。

2019 年 A 股市场可能会比经济乐观。首先，A 股目前的整体估值处于历史底部。其次，全社会



的流动性也在改善。基本面趋势在改善的行业，预计能够取得较好的相对收益和绝对收益。

板块方面，火电行业除了受益于经济下行、燃料成本下跌之外，还受益于火电行业供给侧改革带来的利用小时上行以及市场化电价上行的趋势。环保行业中，垃圾焚烧作为盈利能力好、需求增长快的稳定公用事业，当前估值下也具备长期投资的价值。此外，全球汽车的电气化、智能化、网联化、共享化的趋势已经越来越清晰，各大传统主机厂、新兴的造车势力以及整条产业链的大量资本开支已经在往这些方面投入。A 股中也已经产生了在这个趋势下、全球范围内都具有很强竞争力的公司，预计将充分受益于行业未来的成长趋势。

投资策略上，本基金仍将坚持价值成长的投资风格，在环保、新能源车、高端制造等行业“自下而上”精选成长性好、壁垒高、净资产收益率较高的公司进行集中投资。同时，也将重点关注火电板块的估值修复机会，以及金融地产等大蓝筹可能存在的估值修复机会。

珍惜基金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，公司认真落实资管新规及其配套规则、债券交易合规管理、货币市场基金互联网销售等行业新规，紧密跟踪监管要求，促进公司业务合法合规；公司不断完善内部制度建设，制定了非居民金融账户涉税信息尽职调查管理制度、案件管理制度、合同管理制度、知识产权管理制度等多项制度，修订了投资者适当性管理制度，编制了合规管理白皮书；公司以投资研究和销售业务条线为重点，围绕内幕交易、利用未公开信息交易等重点防范的违法违规行为和新颁布的法律法规，开展合规培训，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，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，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，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理、投资组合强制合规管理，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，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术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，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净

值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

安永华明（2019）审字第 60739337\_A44 号

华夏节能环保股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了华夏节能环保股票型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏节能环保股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏节能环保股票型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏节能环保股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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 其他信息

华夏节能环保股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华夏节能环保股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏节能环保股票型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，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。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏节能环保股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏节能环保股票型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

王珊珊 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

2019 年 3 月 22 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华夏节能环保股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		32,320,018.19	83,345,671.82
结算备付金		546,128.99	439,892.03
存出保证金		88,577.15	183,439.85
交易性金融资产		171,614,984.56	293,152,637.34
其中：股票投资		170,835,104.86	293,152,637.34
基金投资		-	-
债券投资		779,879.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	11,795,718.76
应收利息		7,554.27	20,439.81
应收股利		-	-
应收申购款		35,739.54	74,437.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		204,613,002.70	389,012,237.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		2,315,893.99	-
应付赎回款		311,401.20	1,206,519.69
应付管理人报酬		257,593.38	504,567.73
应付托管费		42,932.22	84,094.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		344,654.64	489,540.88
应交税费		4.84	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债		50,204.18	52,556.07
负债合计		3,322,684.45	2,337,278.99
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		288,300,555.08	420,328,700.33
未分配利润		-87,010,236.83	-33,653,741.86
所有者权益合计		201,290,318.25	386,674,958.47
负债和所有者权益总计		204,613,002.70	389,012,237.46

注：①报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6982 元，基金份额总额 288,300,555.08 份。

②本基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效，上年度可比期间自 2017 年 8 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华夏节能环保股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 11 日（基 金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-69,928,056.07	-26,887,160.51
1.利息收入		295,224.53	3,906,767.39
其中：存款利息收入		292,837.66	3,256,937.97
债券利息收入		144.69	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,242.18	649,829.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-84,568,095.05	-13,206,176.76
其中：股票投资收益		-87,109,657.99	-13,206,176.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		2,541,562.94	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		14,000,391.20	-20,503,194.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		344,423.25	2,915,443.53

<b>减：二、费用</b>		6,280,839.21	5,439,151.98
1.管理人报酬		3,722,825.51	3,946,798.91
2.托管费		620,470.95	657,799.77
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,794,571.58	740,472.72
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.44	-
7.其他费用		142,970.73	94,080.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-76,208,895.28	-32,326,312.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-76,208,895.28	-32,326,312.49

注：本基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效，上年度可比期间自 2017 年 8 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏节能环保股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	420,328,700.33	-33,653,741.86	386,674,958.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-76,208,895.28	-76,208,895.28
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）	-132,028,145.25	22,852,400.31	-109,175,744.94
其中：1.基金申购款	58,401,803.94	-11,963,934.67	46,437,869.27
2.基金赎回款	-190,429,949.19	34,816,334.98	-155,613,614.21
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	288,300,555.08	-87,010,236.83	201,290,318.25
项目	上年度可比期间 2017 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 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）	1,176,467,739.43	-	1,176,467,739.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,326,312.49	-32,326,312.49
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）	-756,139,039.10	-1,327,429.37	-757,466,468.47
其中：1.基金申购款	39,529,134.99	-219,724.41	39,309,410.58
2.基金赎回款	-795,668,174.09	-1,107,704.96	-796,775,879.05
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	420,328,700.33	-33,653,741.86	386,674,958.47

注：本基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效，上年度可比期间自 2017 年 8 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日。

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：

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

#### 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。

##### 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年8月11日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,722,825.51	3,946,798.91
其中：支付销售机构的客户维护费	1,194,762.34	1,298,257.95

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 1.50%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×1.50%/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列支，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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年8月11日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	620,470.95	657,799.77

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 0.25%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×0.25%/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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年8月11日（基金合同生效日） 至2017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
中国农业银行活期存款	32,320,018.19	281,924.42	83,345,671.82	840,281.11

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2018 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：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫	2018-12-20	2019-01-03	新	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

	金 银 行			发 流 通 受 限						
--	-------------	--	--	-----------------------	--	--	--	--	--	--

#### 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

无。

#### 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 2018 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 171,614,984.56 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2017 年 12 月 31 日止，第一层次的余额为 293,152,637.34 元，第二层次的余额为 0 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，本基金将相关股票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。

#### 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	170,835,104.86	83.49
	其中：股票	170,835,104.86	83.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	779,879.70	0.38
	其中：债券	779,879.70	0.38
	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	32,866,147.18	16.06
8	其他各项资产	131,870.96	0.06
9	合计	204,613,002.70	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	7,854,481.50	3.90
C	制造业	59,431,812.31	29.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	78,627,778.25	39.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,020,276.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.02
K	房地产业	5,727,819.00	2.85
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	18,122,792.00	9.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	170,835,104.86	84.87

## 8.3 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	603568	伟明环保	793,120	18,122,792.00	9.00
2	600900	长江电力	1,095,207	17,391,887.16	8.64
3	603659	璞泰来	300,000	14,220,000.00	7.06
4	600011	华能国际	1,671,324	12,334,371.12	6.13
5	600323	瀚蓝环境	708,426	9,939,216.78	4.94
6	002616	长青集团	1,331,004	9,716,329.20	4.83
7	600886	国投电力	1,175,800	9,465,190.00	4.70
8	000543	皖能电力	1,898,534	9,093,977.86	4.52
9	000968	蓝焰控股	737,510	7,854,481.50	3.90
10	000539	粤电力 A	1,647,247	7,626,753.61	3.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	37,477,845.05	9.69
2	600011	华能国际	27,100,107.50	7.01
3	600674	川投能源	24,171,195.64	6.25
4	600885	宏发股份	23,676,703.45	6.12
5	601012	隆基股份	22,883,802.37	5.92
6	603568	伟明环保	20,119,375.56	5.20

7	603659	璞泰来	20,054,902.94	5.19
8	600970	中材国际	19,046,192.00	4.93
9	601398	工商银行	17,925,160.46	4.64
10	002050	三花智控	17,908,705.00	4.63
11	300070	碧水源	17,770,116.98	4.60
12	600438	通威股份	16,608,865.31	4.30
13	600027	华电国际	16,063,044.37	4.15
14	600886	国投电力	15,702,867.88	4.06
15	600519	贵州茅台	15,048,429.00	3.89
16	000539	粤电力 A	13,812,465.82	3.57
17	000543	皖能电力	13,684,321.65	3.54
18	300388	国祯环保	12,779,745.40	3.31
19	300750	宁德时代	12,493,705.60	3.23
20	600217	中再资环	11,858,244.03	3.07
21	000333	美的集团	11,105,364.56	2.87
22	600323	瀚蓝环境	10,834,781.12	2.80
23	600167	联美控股	10,800,538.16	2.79
24	002415	海康威视	9,474,988.79	2.45
25	002466	天齐锂业	8,257,387.00	2.14
26	600168	武汉控股	8,114,739.00	2.10
27	603799	华友钴业	8,061,651.00	2.08
28	002616	长青集团	8,011,688.44	2.07
29	300124	汇川技术	7,990,365.00	2.07
30	600461	洪城水业	7,889,751.97	2.04
31	000685	中山公用	7,729,003.80	2.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600027	华电国际	32,302,235.47	8.35
2	300388	国祯环保	29,388,131.12	7.60
3	600011	华能国际	29,125,049.68	7.53
4	600970	中材国际	28,720,577.79	7.43
5	000546	金圆股份	26,701,569.55	6.91
6	600900	长江电力	25,088,747.84	6.49
7	603200	上海洗霸	24,362,606.18	6.30
8	601012	隆基股份	21,395,965.00	5.53
9	300145	中金环境	20,139,510.79	5.21
10	603686	龙马环卫	20,088,103.85	5.20
11	600452	涪陵电力	19,801,369.83	5.12
12	000968	蓝焰控股	17,057,358.88	4.41

13	601398	工商银行	16,991,646.04	4.39
14	600885	宏发股份	16,722,285.11	4.32
15	600674	川投能源	16,051,827.10	4.15
16	000826	启迪桑德	14,854,931.52	3.84
17	300750	宁德时代	14,697,394.19	3.80
18	600438	通威股份	13,375,530.57	3.46
19	300070	碧水源	13,280,367.10	3.43
20	600217	中再资环	12,518,213.80	3.24
21	600461	洪城水业	12,268,973.60	3.17
22	600116	三峡水利	12,030,907.00	3.11
23	600741	华域汽车	11,818,139.00	3.06
24	002050	三花智控	11,295,842.40	2.92
25	000685	中山公用	10,987,468.25	2.84
26	600114	东睦股份	10,780,818.15	2.79
27	300203	聚光科技	10,357,876.00	2.68
28	600167	联美控股	10,228,143.99	2.65
29	002573	清新环境	9,874,790.00	2.55
30	603799	华友钴业	8,211,742.50	2.12
31	002466	天齐锂业	7,993,193.00	2.07
32	600519	贵州茅台	7,759,830.64	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	596,783,648.47
卖出股票收入（成交）总额	645,985,034.46

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	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	-	-
7	可转债（可交换债）	779,879.70	0.39

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	779,879.70	0.39

## 8.6 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	113523	伟明转债	7,730	779,879.70	0.39
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 8.10.1 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。

## 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 8.11.1 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。

## 8.11.2 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。

## 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

## 8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	88,577.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,554.27
5	应收申购款	35,739.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,870.96

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

## 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例
9,278	31,073.57	1,691,692.05	0.59%	286,608,863.03	99.41%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	82,278.39	0.03%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年8月11日)基金份额总额	1,176,467,739.43
本报告期期初基金份额总额	420,328,700.33
本报告期基金总申购份额	58,401,803.94
减：本报告期基金总赎回份额	190,429,949.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	288,300,555.08

## §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 4 月 28 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 5 月 19 日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

本报告期内，中国农业银行股份有限公司聘任刘琳、李智同志为本行托管业务部高级专家。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 50,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	440,251,894.61	35.52%	321,956.38	31.00%	-
华泰证券	1	230,723,713.36	18.62%	214,869.16	20.69%	-
国信证券	1	149,514,160.42	12.06%	139,241.25	13.41%	-
中国银河证券	1	148,600,607.49	11.99%	138,392.99	13.32%	-
东吴证券	1	137,408,734.78	11.09%	100,487.38	9.67%	-
海通证券	1	95,642,541.91	7.72%	89,070.61	8.58%	-
长江证券	1	37,169,071.07	3.00%	34,615.50	3.33%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、财富证券、方正证券、高华证券、光大证券、国海证券、国泰君安证券、华西证券、联讯证券、申万宏源证券、西部证券、新时代证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④本报告期内，新时代证券、联讯证券、方正证券、财富证券的交易单元为本基金本期新增的

交易单元。中投证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	11,000,000.00	100.00%
中国银河证券	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-

**§12 影响投资者决策的其他重要信息**

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

华夏基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日