

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日
§ 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,并对所载内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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2019年1月17日核对了本基金中的财务指标、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2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	华安生态优先混合型证券投资基金
基金代码	000594
交易代码	000595
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月19日
报告期末基金资产总额	63,136,472,049.00
投资目标	本基金在充分考虑和控制投资组合的系统性风险、资产配置风险的前提下,力争为投资者提供高于业绩基准的收益。
投资策略	本基金在充分考虑和控制投资组合的系统性风险、资产配置风险的前提下,力争为投资者提供高于业绩基准的收益。
业绩比较基准	90%×中证环保指数+20%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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	2018年10月1日-2018年12月31日
1.本期已实现收益		-402,636.16
2.本期利润		-13,191,900.74
3.加权平均基金份额本期利润		-0.2377
4.期末基金份额净值		1.022,371.00
5.期末基金资产净值		1,069

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(例如:封闭式基金的申购赎回费、开放式基金的申购赎回费、红利再投资、基金转换费等),计价方式对实际收益的影响所导致的误差不列于所列数字。

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 本期报告期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	①-③⑤	②-④⑥
过去6个月	-10.30%	1.01%	-0.05%	1.32%	-0.08%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安生态驱动量化策略混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比如图
(2016年12月14日至2018年12月31日)

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(例如:封闭式基金的申购赎回费、开放式基金的申购赎回费、红利再投资、基金转换费等),计价方式对实际收益的影响所导致的误差不列于所列数字。

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。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 本期报告期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	①-③⑤	②-④⑥
过去6个月	-10.30%	1.01%	-0.05%	1.32%	-0.08%	0.29%

3.2.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安生态驱动量化策略混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比如图
(2016年12月14日至2018年12月31日)

华安生态优先混合型证券投资基金 2018年第四季度报告

临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据《中国证监会关于证券投资基金公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资部、交易部等部门制定了《交易基金公平交易制度》,客户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间同业反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、客户间的同向反向交易的监控,并定期对组合间的同向反向交易分析系统,对相关同向交易行为进行持续监控,并定期对组合间的同向反向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资基金组合与交易所公开竞价交易中,出现同日反向交易成交较少的单个交易日超过该证券当个交易日成交量的5%的次数为1次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投票决策和表决情况

4.4.1 报告期内基金的投票决策和表决情况

4.4.2 报告期内基金的投票决策和表决情况

4.5 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同,并根据基金合同的规定,履行信息披露义务,不存在违反基金合同规定及有关法律法规的情形。

4.6 管理人对基金投资组合的说明

4.6.1 投资组合情况

4.6.2 投资组合情况

4.6.3 投资组合情况

4.6.4 投资组合情况

4.6.5 投资组合情况

4.6.6 投资组合情况

4.6.7 投资组合情况

4.6.8 投资组合情况

4.6.9 投资组合情况

4.6.10 投资组合情况

4.6.11 投资组合情况

4.6.12 投资组合情况

4.6.13 投资组合情况

4.6.14 投资组合情况

4.6.15 投资组合情况

4.6.16 投资组合情况

4.6.17 投资组合情况

4.6.18 投资组合情况

4.6.19 投资组合情况

4.6.20 投资组合情况

4.6.21 投资组合情况

4.6.22 投资组合情况

4.6.23 投资组合情况

4.6.24 投资组合情况

4.6.25 投资组合情况

4.6.26 投资组合情况

4.6.27 投资组合情况

4.6.28 投资组合情况

4.6.29 投资组合情况

4.6.30 投资组合情况

4.6.31 投资组合情况

4.6.32 投资组合情况

4.6.33 投资组合情况

4.6.34 投资组合情况

4.6.35 投资组合情况

4.6.36 投资组合情况

4.6.37 投资组合情况

4.6.38 投资组合情况

4.6.39 投资组合情况

4.6.40 投资组合情况

4.6.41 投资组合情况

4.6.42 投资组合情况

4.6.43 投资组合情况

4.6.44 投资组合情况

4.6.45 投资组合情况

4.6.46 投资组合情况

4.6.47 投资组合情况

4.6.48 投资组合情况

4.6.49 投资组合情况

4.6.50 投资组合情况

4.6.51 投资组合情况

4.6.52 投资组合情况

4.6.53 投资组合情况

4.6.54 投资组合情况

4.6.55 投资组合情况

4.6.56 投资组合情况

4.6.57 投资组合情况

4.6.58 投资组合情况

4.6.59 投资组合情况

4.6.60 投资组合情况

4.6.61 投资组合情况

4.6.62 投资组合情况

4.6.63 投资组合情况

4.6.64 投资组合情况

4.6.65 投资组合情况

4.6.66 投资组合情况

4.6.67 投资组合情况

4.6.68 投资组合情况

4.6.69 投资组合情况

4.6.70 投资组合情况

4.6.71 投资组合情况

4.6.72 投资组合情况

4.6.73 投资组合情况

4.6.74 投资组合情况

4.6.75 投资组合情况

4.6.76 投资组合情况

4.6.77 投资组合情况

4.6.78 投资组合情况

4.6.79 投资组合情况

4.6.80 投资组合情况

4.6.81 投资组合情况

4.6.82 投资组合情况

4.6.83 投资组合情况

4.6.84 投资组合情况

4.6.85 投资组合情况</p