

华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2018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:中国工商银行股份有限公司
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,并对其中内容的真实性、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确认,并由董事签署。

基金托管人中国工商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,应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	华夏3年封闭运作战略配售(LOF)
场内简称	华夏配售
基金代码	501198
交易代码	501198
基金运作方式	契约型开放式
基金的生效日期	2018年7月5日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期基金份额总额	11,322,334,023.67份
基金合同存续期	不长期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,追求超越行业比较基准的稳定回报,力争实现资产的长期、稳健增值。
本基金主要投资于通过战略配售获得的股票。固定收益部分,将结合对未来市场价格走势运用久期管理策略,通过严谨的研究发现价值低估的债券和货币市场工具,在严格控制风险的前提下,追求超越行业比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金管理人一贯对所持股票进行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,并通过系统化人工等方式在各环节严格执行公平交易政策。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。
业绩比较基准	在评估期内,基于基金的行业比较基准:沪深300指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,面临风险与收益高于债券基金与货币市场基金,低于股票基金。

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	中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人网址	www.ChinaAMC.com
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7月6日(基金合同生效日)至2018年12月31日
本期已实现收益	232,001,112.00
本期利润	298,623,392.76
加权平均基金份额本期利润	0.0264
本期平均净值利润率	2.61%
本期基金份额净值增长率为	2.64%

3.1.2 期末数据和指标

期末的可供分配利润	222,001,112.00
期末可供分配基金份额利润	0.0269
期末基金资产净值	11,620,967,416.43
期末基金份额净值	1.0264

3.1.3 本期利润

注:①本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的费用,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入。

③期末可供分配利润为期末资产价值中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④本基金合同于2018年7月5日生效。

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

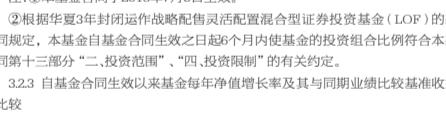
阶段	份额净值增长率为	份额净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去6个月	1.70%	0.023%	-6.41%	0.07%	8.11%	-0.94%
基金份额合同生同期	2.64%	0.019%	-6.03%	0.08%	7.67%	-0.05%

3.2.2 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的比较

华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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图

(2018年7月6日至2018年12月31日)



注:本基金合同于2018年7月6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 过去三年的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。

3.4 管理人报告

3.4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理制度的情况

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,在苏州、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CDH基金管理人、境内首批ETF基金管理人、境内首批养老金基金管理人、境内首批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、首批公募FOF基金管理人、首批公募目标基金管理人,以及特定客户资产管理人、华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金以深入的客户投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋取良好的回报。根据公司证券投资基金中心基金绩效统计报告,在基金分类排名中,截至2018年12月31日数据,华夏经济转型股票型基金“华夏经济转型股票型基金-灵活配置混合型基金(A类)”在中证500指数“股票型基金-灵活配置混合型基金(A类)”中排名第34位,华夏沪深300指数“股票型基金-灵活配置混合型基金(A类)”在中证500指数“股票型基金-灵活配置混合型基金(A类)”中排名第34位,华夏上证50ETF联接(A类)“股票型基金-股票型基金-指数基金-沪深300指数型基金”在中证500指数“股票型基金-灵活配置混合型基金(A类)”中分别排名第73和70位。

公司旗下基金在证券投资基金评价多项奖项中,在《中国证券报》“评奖活动中,公司荣获‘2018年卓越贡献公司’和‘被动投资金牛基金公司’两大奖项,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式混合型基金金牛基金”称号,华夏安康债券型基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式混合型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度平衡配置型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式混合型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,公司荣获“2018年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式混合型基金金牛基金”称号,华夏安康债券型基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式混合型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度平衡配置型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券时报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《上海证券报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号,华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型基金金牛基金”称号。在《证券日报》“评奖活动中,旗下华夏回报混合基金荣获“2017年度开放式债券型