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）上市交易公告书

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
登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市推荐人：第一创业证券股份有限公司
上市地点：上海证券交易所
上市时间：2019年3月29日
公告日期：2019年3月26日

一、重要声明与提示

《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）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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）（以下简称“本基金”）基金管理人华夏基金管理有限公司的董事会及董事保证本公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责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

受市场供求关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险，敬请投资者关注。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2019年2月18日登载于《中国证券报》和华夏基金管理有限公司网站（www.ChinaAMC.com）上的《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）招募说明书（更新）》。

二、基金概览

1、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）。
2、基金简称：华夏3年封闭运作战略配售（LOF）。
3、基金二级市场交易简称：华夏配售。
4、基金二级市场交易代码：501186。
5、截至公告日前两个工作日即2019年3月22日基金份额总额：11,335,971,538.12份。
6、截至公告日前两个工作日即2019年3月22日基金份额净值：1.0396元。
7、本次上市交易份额：575,298,609份。
8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9、上市交易日期：2019年3月29日。
10、基金管理人：华夏基金管理有限公司。
11、基托管人：中国工商银行股份有限公司。
12、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。
13、上市推荐人：第一创业证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证监会2018年6月6日证监许可[2018]924号文。
2、基金运作方式：契约型开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：2018年6月11日至2018年6月19日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售方式：本基金通过场外方式公开发售，即通过本公司的直销机构和本公司指定的场外发售代理机构公开发售。
7、本基金场外发售机构

华夏基金管理有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、河北银行股份有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司、厦门银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、泉州银行股份有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海挖财基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、乾道盈泰基金销售（北京）有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、上海基煜基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、中民财富基金销售（上海）有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、中欧钱袋滚基金销售（上海）有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、新时代证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、中航证券有限公司、华林证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、财通证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、西藏东方财富证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、江海证券有限公司、国金证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城国瑞证券有限公司、爱建证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、上海华夏财富投资管理有限公司等。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。
9、募集资金总额及入账情况

本基金自2018年6月11日起公开募集，截至2018年6月19日，基金募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集期间净认购金额为11,320,361,616.50元人民币，认购资金在募集期间产生的利息为1,972,407.17元人民币。本次募集资金及其产生的利息已于2018年6月20日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的本基金托管专户。

10、基金备案情况

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《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）基金合同》（以下简称“基金合同”）、《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）招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，华夏基金管理有限公司已于2018年6月20日向中国证监会办理基金备案手续，并于2018年7月6日获得证监会书面确认。

11、基金合同生效日：2018年7月5日。
12、基金合同生效日的基金份额总额：按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计11,322,334,023.67份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2019]44号。
2、上市交易日期：2019年3月29日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
4、基金二级市场交易简称：华夏配售。
5、基金二级市场交易代码：501186。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、本次上市交易份额：575,298,609份。
7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额托管在场外，持有人将其转托管至上海证券交易所场内居即可上市流通。经向上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司申请，本基金跨系统转托管业务将自2019年3月29日起正常办理。
9、基金资产净值的披露：在基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即2019年3月22日，本基金基金份额持有人户数为486,632户，平均每户持有的基金份额为23,294.75份。其中，本基金场内基金份额持有人户数为2,982户，平均每户持有的基金份额为192,923.75份；本基金场外基金份额持有人户数为483,650户，平均每户持有的基金份额为22,248.88份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即2019年3月22日，场内机构投资者持有的本基金基金份额为212,584,853份，占场内基金总份额的36.95%；场内个人投资者持有的本基金基金份额为362,713,756份，占场内基金总份额的63.05%。

截至公告日前两个工作日即2019年3月22日，本基金管理人的从业人员未持有本基金场内基金份额；本基金管理人的从业人员持有本基金场外基金份额5,388,543.55份，占本基金总份额的0.05%，本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理持有本基金场外基金份额的数量区间为100万份以上。

（三）前十名持有人

截至公告日前两个工作日即2019年3月22日，本基金前十名场内基金份额持有人情况如下：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	中国工商银行股份有限公司企业年金计划–中国建设银行	49,999,000.00	8.69
2	基本养老保险基金三零一组合	35,999,000.00	6.26
3	中国银行股份有限公司企业年金计划–农行	29,999,000.00	5.21
4	国家电力投资集团有限公司企业年金计划–中国工商银行股份有限公司	26,999,000.00	4.69
5	中国华能集团公司企业年金计划–中国工商银行股份有限公司	19,999,000.00	3.48
6	工银瑞信添泰混合型养老金产品–中国工商银行股份有限公司	15,999,000.00	2.78
7	中国邮政速递物流股份有限公司企业年金计划–中国建设银行股份有限公司	11,999,000.00	2.09
8	平安建行河南省电力公司企业年金计划	5,049,446.00	0.88
9	中国印钞造币总公司企业年金计划–中国光大银行股份有限公司	3,999,000.00	0.70
10	国网辽宁省电力有限公司企业年金计划–中国农业银行股份有限公司	2,699,000.00	0.47

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基金管理人概况
名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：杨明辉
总经理：李一梅
信息披露负责人：李彬
客户服务电话：400-818-6666
传真：010-63136700
注册资本：23800万元
设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]16号
工商登记注册的法人营业执照文号：911100006336940653
经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动）。

2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
合计	100%

3、内部组织结构与人员情况

公司设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司业务部门主要分为投研部门、风险控制部门、营销部门、后台运作部门等。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；风险控制部门主要负责投资的事前、事中、事后风险合规监控等工作；营销部门主要负责营销和市场推广等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。

4、基金管理业务情况

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。近21年来，公司秉承“为信任奉献回报”的企业宗旨，坚持以专业、严谨的投资研究为基础，为投资人提供优质的基金产品和理财服务。凭借规范的经营管理和良好的品牌声誉，公司多次荣获境内外权威奖项。

截至目前，公司旗下管理142只开放式基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、QDII、FOF等不同类型，建立了覆盖高中低风险等级的公募基金产品线，为各类风险偏好投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

5、本基金基金经理简介

张城源先生，中国人民大学法学硕士。2009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、基金经理助理、投资研究部总经理助理、华夏磐泰定期开放混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2016年12月26日至2018年7月16日期间）、华夏磐晟定期开放灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2017年5月31日至2018年7月24日期间）等，现任股票投资部高级副总裁，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）基金经理（2018年7月5日起任职）、华夏磐泰混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2018年7月17日起任职）。

刘明宇先生，经济学硕士。2009年6月加入华夏基金管理有限公司，曾任机构债券投资部研究员、投资经理助理、投资经理、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理（2017年12月19日至2018年3月14日期间）、华夏鼎盛债券型证券投资基金基金经理（2017年12月19日至2019年1月7日期间）等，现任固定收益部执行总经理，华夏鼎瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎诺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎隆债券型证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎智债券型证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎茂债券型证券投资基金基金经理（2017年12月11日起任职）、华夏鼎兴债券型证券投资基金基金经理（2018年2月12日起任职）、华夏上证3–5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年5月30日起任职）、华夏上证3–5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2018年5月30日起任职）、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）基金经理（2018年7月30日起任职）、华夏鼎禄三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年10月11日起任职）、华夏鼎通债券型证券投资基金基金经理（2018年10月23日起任职）、华夏稳定双利债券型证券投资基金基金经理（2018年12月17日起任职）、华夏中短债债券型证券投资基金基金经理（2018年12月25日起任职）、华夏短债债券型证券投资基金基金经理（2019年1月8日起任职）、华夏鼎康债券型证券投资基金基金经理（2019年1月24日起任职）、华夏鼎略债券型证券投资基金基金经理（2019年3月21日起任职）。

（二）基金托管人

1、基本情况
名称：中国工商银行股份有限公司（简称：中国工商银行）
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
成立时间：1984年1月1日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币35,640,625.71万元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号
基金托管部门负责人：李男
信息披露负责人：郭明
联系电话：010-66105799
2、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金674只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

3、主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金上市推荐人

名称：第一创业证券股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
电话：0755-25831754
传真：0755-23838750
联系人：毛诗莉
网址：www.firstcapital.com.cn
客户服务电话：95358

（四）验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：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
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
法定代表人：毛鞍宁
联系电话：010-58153000
传真：010-85188298
经办注册会计师：徐艳、马剑英
联系人：徐艳

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金招募说明书中已披露的基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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，计入费用后实际净值收益水平要低于所列数字。该业绩数据已在2019年2月18日发布的《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）招募说明书（2019年第1次）》中披露。

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	①–③	②–④
2018年7月5日至2018年12月31日	2.64%	0.04%	-5.03%	0.89%	7.67%	-0.85%

（四）基金资产负债表

截至公告前两个工作日即2019年3月22日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	2019年3月22日
资产：	
银行存款	61,179,494.14
结算备付金	61,961,523.27
存出保证金	89,245.66
交易性金融资产	14,281,196,222.20
其中：股票投资	–
基金投资	–
债券投资	14,281,196,222.20
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	–
应收利息	255,087,767.95
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	14,659,514,258.22
负债和所有者权益	
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	2,816,600,000.00
应付证券清算款	55,152,500.33
应付赎回款	–
应付管理人报酬	709,437.96
应付托管费	212,831.39
应付销售服务费	–
应付交易费用	27,486.31
应交税费	1,099,067.12
应付利息	714,292.16
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	90,117.73
负债合计	2,874,605,733.00
所有者权益：	
实收基金	11,335,971,538.12
未分配利润	448,936,987.10
所有者权益合计	11,784,908,525.22
负债和所有者权益总计	14,659,514,258.22

注：截至2019年3月22日，基金份额净值1.0396元，基金份额总额11,335,971,538.12份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即2019年3月22日（本基金合同自2018年7月5日起生效，本报告期自2018年7月5日至2019年3月22日），本基金的投资组合情况如下：

（一）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	14,281,196,222.20	97.42
	其中：债券	14,281,196,222.20	97.42
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	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	123,141,022.41	0.84
7	其他各项资产	255,177,013.61	1.74
8	合计	14,659,514,258.22	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期未未持有股票。

（三）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

本基金本报告期未未持有股票。

（四）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	434,987,800.00	3.69
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	5,186,502,022.20	44.01
5	企业短期融资券	498,265,900.00	4.23
6	中期票据	5,273,018,500.00	44.74
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	2,888,422,000.00	24.51
9	其他	–	–
10	合计	14,281,196,222.20	121.18

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	111912015	19北京银行CD015	7,000,000.00	679,210,000.00	5.76
2	111914042	19江苏银行CD042	7,000,000.00	678,930,000.00	5.76
3	111990606	19郑州银行CD003	5,000,000.00	484,800,000.00	4.11
4	111888983	18长沙银行CD208	5,000,000.00	483,950,000.00	4.11
5	111887870	18贵阳银行CD174	5,000,000.00	483,900,000.00	4.11

（六）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未未持有资产支持证券。

（七）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期未未持有贵金属。

（八）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

本基金本报告期未未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

1、本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未无股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未未无股指期货投资。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期未未无国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未无国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期未未无国债期货投资。

（十一）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵阳银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、国家开发银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

2、本基金本报告期未未持有股票。

3、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	89,245.66
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	255,087,767.95
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	255,177,013.61

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未未持有处于转股期的可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期未未持有股票。

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。

九、重大事件揭示

（一）2018年7月7日发布华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同生效公告。

（二）2018年8月1日发布华夏基金管理有限公司关于增聘华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告。

（三）2018年12月7日发布华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告。

（四）2018年12月26日发布华夏基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在直销机构及华夏财富申购、赎回等业务最低数额限制的公告。

（五）2019年1月3日发布华夏基金管理有限公司关于华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）第一个受限开放期开放申购业务的公告。

（六）2019年1月30日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金在大泰金石基金销售有限公司暂停办理认购、申购等业务的公告。

（七）2019年3月2日发布华夏基金管理有限公司公告。

（八）2019年3月18日发布华夏基金管理有限公司关于华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开通场外分额转托管至场内业务的公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：严格遵守《基金法》等相关法规以及《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）基金合同》、《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）托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

（二）基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会准予华夏3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的批复
2、《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）基金合同》
3、《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）托管协议》
4、《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）招募说明书》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件、营业执照
7、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一九年三月二十六日

附件：基金合同摘要

第一部分　基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司
住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区
法定代表人：杨明辉
设立日期：1998年4月9日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文
组织形式：有限责任公司
注册资本：2.38亿元人民币
存续期限：100年
联系电话：400-818-6666

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在条件允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人

（一）基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
成立时间：1984年1月1日
批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币35,640,625.71万元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号

（二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费