

華夏回報證券投資基金

2018 年年度報告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

報告送出日期：二〇一九年三月二十六日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2018 年年度報告摘要

向香港投資者提供的資料

本基金是根據香港《證券及期貨條例》（「證券及期貨條例」）第 104 條在香港獲得證券及期貨事務監察委員會（「證監會」）認可。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業利弊或其表現作出保證。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或投資者類別。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

二〇一九年三月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2019 年 3 月 22 日覆核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證覆核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告中的財務資料經審計，安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）為本基金出具了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度報告摘要摘自年度報告正文，投資者欲了解詳細內容，應閱讀年度報告正文。

§2 基金簡介

2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001(前端)	002002(後端)
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	9,569,404,771.40 份	
基金合同存續期	不定期	

2.2 基金產品說明

投資目標	儘量避免基金資產損失，追求每年較高的絕對回報。
投資策略	正確判斷市場走勢，合理配置股票和債券等投資工具的比例，準確選擇具有投資價值的股票品種和債券品種進行投資，可以在儘量避免基金資產損失的前提下實現基金每年較高的絕對回報。
業績比較基準	本基金業績比較基準為絕對回報標準，為同期一年期定期存款利率。
風險收益特徵	本基金在證券投資基金中屬於中等風險的品種，其長期平均的預期收益和風險高於債券基金，低於股票基金。

2.3 基金管理人和基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	李彬	王永民
	聯絡電話	400-818-6666	010-66594896
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客戶服務電話		400-818-6666	95566
傳真		010-63136700	010-66594942

2.4 信息披露方式

刊登基金年度報告正文的管理人互聯 網網址	www.ChinaAMC.com
基金年度報告備置地地點	基金管理人和基金託管人的住所

§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況

3.1 主要會計資料和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間資料和指標	2018 年	2017 年	2016 年
本期已實現收益	-71,670,895.48	741,805,432.84	-71,543,169.09
本期利潤	-2,281,249,229.24	2,554,863,767.97	-262,031,257.05
加權平均基金份額本期利潤	-0.2574	0.3963	-0.0424
本期加權平均淨值利潤率	-18.61%	29.61%	-3.65%
本期基金份額淨值增長率	-16.81%	34.83%	-3.58%
3.1.2 期末資料和指標	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利潤	-237,651,206.77	80,331,916.44	15,731,841.97
期末可供分配基金份額利潤	-0.0248	0.0108	0.0027
期末基金資產淨值	11,511,435,818.08	10,980,999,722.83	7,023,985,211.05
期末基金份額淨值	1.203	1.475	1.184
3.1.3 累計期末指標	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份額累計淨值增長率	878.34%	1,076.08%	772.28%

注：①所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水平要低於所列數字。

②本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

③期末可供分配利潤為期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數。

3.2 基金淨值表現

3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
過去三個月	-9.68%	1.37%	0.38%	0.00%	-10.06%	1.37%
過去六個月	-17.66%	1.32%	0.76%	0.00%	-18.42%	1.32%
過去一年	-16.81%	1.22%	1.50%	0.00%	-18.31%	1.22%
過去三年	8.14%	0.94%	4.50%	0.00%	3.64%	0.94%
過去五年	41.54%	0.94%	9.59%	0.00%	31.95%	0.94%
自基金合同生效起至今	878.34%	1.01%	39.18%	0.00%	839.16%	1.01%

3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

華夏回報證券投資基金

基金份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖

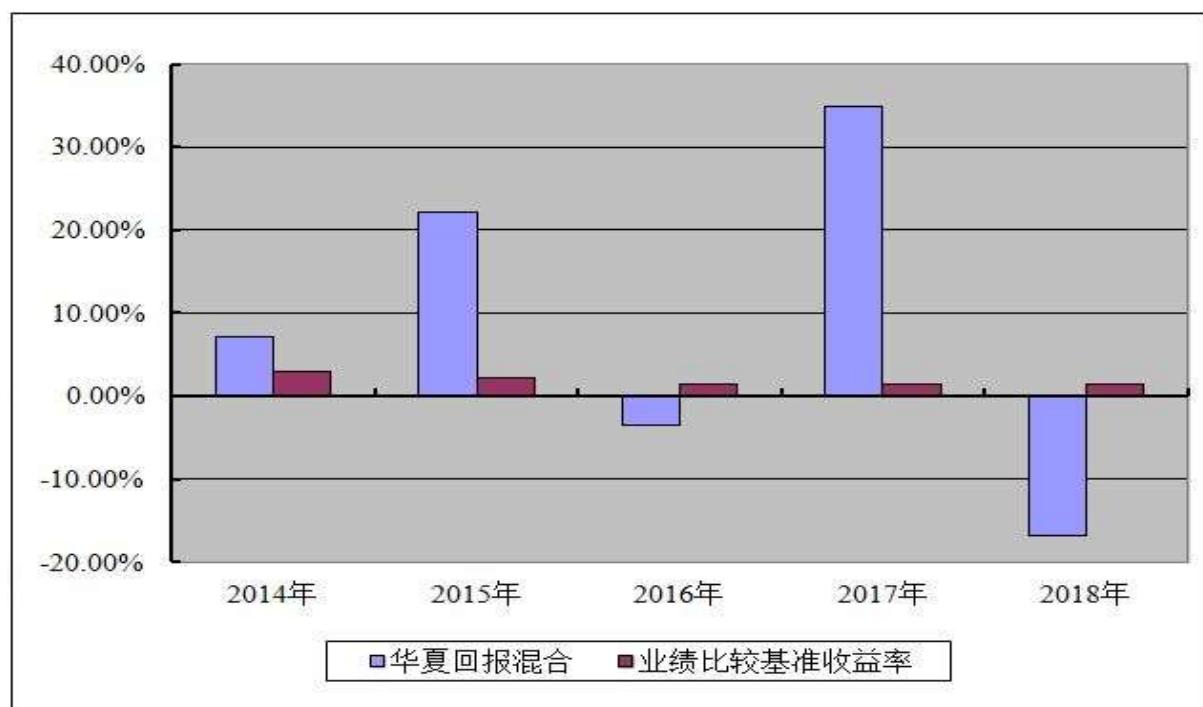
(2003 年 9 月 5 日至 2018 年 12 月 31 日)



3.2.3 過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

華夏回報證券投資基金

基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的對比圖



3.3 過去三年基金的利潤分配情況

單位：人民幣元

年度	每10份基金	現金形式發放總	再投資形式發放總	年度利潤分配	備註
----	--------	---------	----------	--------	----

	份額分紅數	額	額	合計	
2018 年	0.300	97,505,180.76	151,424,812.51	248,929,993.27	-
2017 年	1.070	251,579,525.61	442,407,035.96	693,986,561.57	-
2016 年	-	-	-	-	-
合計	1.370	349,084,706.37	593,831,848.47	942,916,554.84	-

§4 管理人報告

4.1 基金管理人及基金經理情況

4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

華夏基金管理有限公司成立於 1998 年 4 月 9 日，是經中國證監會批准成立的首批全國性基金管理公司之一。公司總部設在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、廣州和青島設有分公司，在香港、深圳、上海設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批 QDII 基金管理人、境內首隻 ETF 基金管理人、境內首隻滬港通 ETF 基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人、首批基本養老保險基金投資管理人資格、首家加入聯合國責任投資原則組織的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募養老目標基金管理人，以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資者謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心基金業績統計報告，在基金分類排名中（截至 2018 年 12 月 31 日資料），華夏經濟轉型股票在“股票基金-標準股票型基金-標準股票型基金(A 類)”中排名 2/152；華夏圓和混合在“混合基金-靈活配置型基金-靈活配置型基金（股票上下限 0-95%+基準股票比例 60%-100%）”中排名 9/346；華夏滬港通恒生 ETF、華夏金融 ETF 在“股票基金-指數股票型基金-股票 ETF 基金”中分別排名 1/109 和 9/109；華夏滬港通恒生 ETF 聯接(A 類)、華夏上證 50ETF 聯接(A 類)在“股票基金-指數股票型基金-股票 ETF 聯接基金（A 類）”中分別排名 2/73 和 10/73。

公司及旗下基金榮膺由基金評價機構頒發的多項獎項。在《中國證券報》評獎活動中，公司榮獲“中國基金業 20 周年卓越貢獻公司”和“被動投資金牛基金公司”兩大獎項，旗下華夏回報混合榮獲“2017 年度開放式混合型金牛基金”稱號，華夏安康債券榮獲“2017 年度開放式債券型金牛基金”稱號。在《證券時報》評獎活動中，旗下華夏永福混合和華夏回報混合榮獲“三年持續回報絕對收益明星基金”稱號，華夏安康債券榮獲“三年持續回報積極債券型明星基金”稱號，華夏消費升級混合榮獲“2017 年度平衡混合型明星基金”稱號。在《上海證券報》舉行的 2018 中國基金業峰會暨第十五屆“金基金”頒獎評選中，公司榮獲公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大獎，旗下華夏滬深 300ETF 榮獲第

十五屆“金基金”指數基金獎（一年期），華夏上證 50ETF 榮獲第十五屆“金基金”指數基金獎（三年期）。

在客戶服務方面，2018 年，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性和服務體驗：（1）華夏基金網上交易平台上線閃購業務，為客戶提供更便捷的基金交易方式；（2）微信服務號上線隨存隨取業務即時通知功能，方便客戶及時了解交易變動情況，進一步提升客戶體驗；（3）對線上智慧服務機器人小夏進行全新升級，幫助投資者一搜即達，讓投資理財更加便捷、高效；（4）與中原銀行、西安銀行、長沙銀行、開源證券等基金銷售機構合作，為客戶提供更多理財管道；（5）開展“四大明星基金有獎尋人”、“華夏基金 20 周年獻禮，華夏基金戶口本”、“揭秘‘團長與團員默契度’”、“大膽預測退休金”等活動，為客戶提供多樣化的投資者教育和關懷服務。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理（助理）期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
蔡向陽	本基金的基金經理、董事總經理	2014-05-28	-	12 年	中國農業大學金融學碩士。曾任天相投資顧問有限公司、新華資產管理股份有限公司研究員等。2007 年 10 月加入華夏基金管理有限公司，曾任研究員、基金經理助理、投資經理，華夏紅利混合型證券投資基金基金經理（2016 年 4 月 8 日至 2017 年 8 月 29 日期間）等。

注：①上述任職日期、離任日期根據本基金管理人對外披露的任免日期填寫。

②證券從業的含義遵從行業協會《證券業從業人員資格管理辦法》的相關規定。

4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》、《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《基金管理公司開展投資、研究活動防控內幕交易指導意見》等法律法規和基金合同，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理和運用基金資產，在嚴格控制投資風險的基礎上，為基金份額持有人謀求最大利益，沒有損害基金份額持有人利益的行為。

4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》等法規制定了《華夏基金

管理有限公司公平交易制度》。公司通過科學、制衡的投資決策體系，加強交易分配環節的內部控制，並通過工作制度、流程和技術手段保證公平交易原則的實現。同時，通過監察稽核、事後分析和信息披露來保證公平交易過程和結果的監督。

4.3.2 公平交易制度的執行情況

本基金管理人一貫公平對待旗下管理的所有基金和組合，制定並嚴格遵守相應的制度和流程，通過系統和人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本基金管理人嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》和《華夏基金管理有限公司公平交易制度》的規定。

本基金管理人通過統計檢驗的方法對管理的不同投資組合，在不同時間窗下（1 日內、3 日內、5 日內）的本年度同向交易價差進行了專項分析，未發現違反公平交易原則的異常情況。

4.3.3 異常交易行為的專項說明

報告期內未發現本基金存在異常交易行為。

報告期內，未出現涉及本基金的交易所公開競價同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該證券當日成交量 5% 的情況。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2018 年，世界主要經濟體運行趨勢從共振重新走向分化，美國經濟景氣高位持續，歐洲、日本高位回落，德國製造業 PMI 已跌破榮枯線，新興經濟體風險事件增多。中國經濟面對複雜多變的內外環境，保持平穩發展，結構調整和轉型升級持續推進，發展品質不斷提高。2018 年國內 GDP 增長 6.6%，最終消費支出對經濟增長的貢獻率為 76.2%，成為經濟的主要推動力量；製造業投資 2018 年同比增長 9.5%，增速持續改善，成為拉動投資增長的主要驅動力；地產投資增速保持平穩較快增長，基建投資增速明顯下降。出口則受到中美貿易戰擾動，短期波動較大。2018 年，以美國為代表的全球主要經濟體持續收緊流動性，努力實現貨幣政策的正常化。2018 年美聯儲加息四次，聯邦基金目標利率由 2017 年的 1.5% 提高到 2.50%，10 年美國國債收益率持續走高，最高突破 3%。在海外流動性收緊、國內經濟從景氣高點回落的背景下，2018 年中國人民銀行延續去槓桿防風險政策，但力度較美聯儲更為平緩：上調 7 天逆回購利率 1 次 5 bps，上調 1 年期 MLF 利率 1 次 5bps。國內政策利率調整的獨立性以及下半年中國經濟從高點回落，導致 10 年期國債到期收益率全年持續走低，最底點觸及 3.2%，較 2017 年 10 月底的高點下行近 80bps，中美利差明顯收窄，上半年外匯貶值壓力較大。

2018 年國內 A 股市場呈現單邊下行態勢，上證綜指全年下跌 24.5%，滬深 300 全年跌幅 25.31%，創業板指全年下跌 28.65%。行業板塊方面呈現普跌特徵，自年初 1 月出現上證 19 連陽後，2 月隨著

調整實現從白馬股到成長股的切換。3 月 22 日，中美貿易戰正式開打，並和國內經濟景氣度一道成為貫穿市場全年的主線，先期調整以科技電子板塊為主，8、9 月延伸至白酒、白電、醫藥等上半年表現強勢的板塊。11 月以後，政策密集出台，市場呈現震盪走勢。

報告期內，本基金適當降低了白酒和家電倉位，增加了保險倉位。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.203 元，本報告期份額淨值增長率為-16.81%，同期業績比較基準增長率為 1.50%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

展望 2019 年，我們認為，中國經濟進入政策密集出台對沖市場下行的經濟尋底階段，基建投資有望在積極的財政政策驅動下出現較明顯的回升，房地產投資仍有高位維持的慣性，減稅、促進消費等政策托底消費和製造業投資。

投資策略上，本基金將“自下而上”精選 ROE 高、壁壘高、增長持續性強的個股，主要集中在消費、醫藥、高端製造業等領域，以期通過長期持股分享這些優秀公司的成長。

珍惜基金份額持有人的每一分投資和每一份信任，本基金將繼續奉行華夏基金管理有限公司“為信任奉獻回報”的經營理念，規範運作，審慎投資，勤勉盡責地為基金份額持有人謀求長期、穩定的回報。

4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

本報告期內，基金管理人持續加強合規管理、風險控制和監察稽核工作。在合規管理方面，公司認真落實資管新規及其配套規則、債券交易合規管理、貨幣市場基金互聯網銷售等行業新規，緊密跟蹤監管要求，促進公司業務合法合規；公司不斷完善內部制度建設，制定了非居民金融帳戶涉稅資訊盡職調查管理制度、案件管理制度、合同管理制度、智慧財產權管理制度等多項制度，修訂了投資者適當性管理制度，編製了合規管理白皮書；公司以投資研究和銷售業務條線為重點，圍繞內幕交易、利用未公開信息交易等重點防範的違法違規行為和新頒布的法律法規，開展合規培訓，不斷提升員工的合規守法意識；強化事前事中合規風險管理，對信息披露文件嚴格把關，認真審核基金宣傳推介材料，加強銷售行為管理，防範各類合規風險。在風險管理方面，公司秉承全員風險管理的理念，採取事前防範、事中控制和事後監督等三階段工作，在持續對日常投資運作進行監督的同時，加強對基金流動性風險的管理、投資組合強制合規管理，督促投研交易業務的合規開展。在監察稽核方面，公司定期和不定期開展多項內部稽核，對投資決策、投資研究、交易執行、基金銷售、資訊技術等關鍵業務和崗位進行檢查監督，促進公司業務合規運作、穩健經營。

報告期內，本基金管理人所管理的基金整體運作合法合規。本基金管理人將繼續以風險控制為

核心，堅持基金份額持有人利益優先的原則，提高監察稽核工作的科學性和有效性，切實保障基金安全、合規運作。

4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人為準確、及時進行基金估值和份額淨值計價，制定了基金估值和份額淨值計價的業務管理制度，建立了估值委員會，使用可靠的估值業務系統，設有完善的風險監測、控制和報告機制。本基金託管人審閱本基金管理人採用的估值原則及技術，並覆核、審查基金資產淨值和基金份額申購、贖回價格。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在0.25%以上時對所採用的相關估值技術、假設及輸入值的適當性發表專業意見。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。

4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

根據《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及本基金的基金合同等規定，本基金本報告期實施利潤分配2次，符合相關法規及基金合同的規定。

4.9 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

§5 託管人報告

5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，中國銀行股份有限公司（以下稱“本託管人”）在華夏回報證券投資基金（以下稱“本基金”）的託管過程中，嚴格遵守《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了應盡的義務。

5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期內，本託管人根據《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的規定，對本基金管理人的投資運作進行了必要的監督，對基金資產淨值的計算、基金份額申購贖回價格的計算以及基金費用開支等方面進行了認真地覆核，未發現本基金管理人存在損害基金份額持有人利益的行為。

5.3 託管人對本年度報告中財務資訊等內容的真實、準確和完整發表意見

本報告中的財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告（注：財務會計報告中的“金融工具風險及管理”部分未在託管人覆核範圍內）、投資組合報告等資料真實、準確和完整。

§6 審計報告

安永華明（2019）審字第 60739337_A04 號

華夏回報證券投資基金全體基金份額持有人：

6.1 審計意見

我們審計了華夏回報證券投資基金的財務報表，包括 2018 年 12 月 31 日的資產負債表，2018 年度的利潤表、所有者權益（基金淨值）變動表以及相關財務報表附注。

我們認為，後附的華夏回報證券投資基金的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編製，公允反映了華夏回報證券投資基金 2018 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2018 年度的經營成果和淨值變動情況。

6.2 形成審計意見的基礎

我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的“註冊會計師對財務報表審計的責任”部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。按照中國註冊會計師職業道德守則，我們獨立於華夏回報證券投資基金，並履行了職業道德方面的其他責任。我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。

6.3 其他資訊

華夏回報證券投資基金管理層對其他資訊負責。其他資訊包括年度報告中涵蓋的資訊，但不包括財務報表和我們的審計報告。

我們對財務報表發表的審計意見不涵蓋其他資訊，我們也不對其他資訊發表任何形式的鑑證結論。

結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他資訊，在此過程中，考慮其他資訊是否與財務報表或我們在審計過程中了解到的情況存在重大不一致或者似乎存在重大錯報。

基於我們已執行的工作，如果我們確定其他資訊存在重大錯報，我們應當報告該事實。在這方面，我們無任何事項需要報告。

6.4 管理層和治理層對財務報表的責任

管理層負責按照企業會計準則的規定編製財務報表，使其實現公允反映，並設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。

在編製財務報表時，管理層負責評估華夏回報證券投資基金的持續經營能力，披露與持續經營相關的事項（如適用），並運用持續經營假設，除非計劃進行清算、終止運營或別無其他現實的選擇。

治理層負責監督華夏回報證券投資基金的財務報告過程。

6.5 註冊會計師對財務報表審計的責任

我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證，並出具包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證，但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致，如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策，則通常認為錯報是重大的。

在按照審計準則執行審計工作的過程中，我們運用職業判斷，並保持職業懷疑。同時，我們也執行以下工作：

(1) 識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險，設計和實施審計程序以應對這些風險，並獲取充分、適當的審計證據，作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或凌駕於內部控制之上，未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。

(2) 了解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。

(3) 評價管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。

(4) 對管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對華夏回報證券投資基金持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的資訊。然而，未來的事項或情況可能導致華夏回報證券投資基金不能持續經營。

(5) 評價財務報表的總體列報、結構和內容（包括披露），並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。

我們與治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。

安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）

中國註冊會計師

王珊珊 馬劍英

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層

2019 年 3 月 22 日

§7 年度財務報表

7.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2018 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
資產：			
銀行存款		627,927,325.34	253,909,224.48
結算備付金		3,923,133.80	2,844,088.69
存出保證金		1,104,787.70	385,582.65
交易性金融資產		9,812,504,653.89	9,547,790,716.78
其中：股票投資		5,495,501,763.84	6,715,164,982.96
基金投資		-	-
債券投資		4,316,740,865.80	2,821,631,286.00
資產支持證券投資		262,024.25	10,994,447.82
貴金屬投資		-	-
衍生金融資產		-	-
買入返售金融資產		1,049,951,694.90	1,299,865,349.80
應收證券清算款		7,796,924.69	6,398,661.26
應收利息		105,188,487.69	55,626,323.82
應收股利		-	-
應收申購款		7,853,315.29	42,226,519.76
遞延所得稅資產		-	-
其他資產		-	-
資產總計		11,616,250,323.30	11,209,046,467.24
負債和所有者權益	附注號	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
負債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債		-	-
賣出回購金融資產款		-	-
應付證券清算款		57,680,486.72	69,252,122.12
應付贖回款		12,479,772.84	16,759,318.69
應付管理人報酬		14,908,170.28	13,578,230.30
應付託管費		2,484,695.05	2,263,038.40
應付銷售服務費		-	-
應付交易費用		16,535,023.93	13,789,722.45
應交稅費		80,814.29	78,498.16
應付利息		-	-
應付利潤		-	111,662,652.43

遞延所得稅負債		-	-
其他負債		645,542.11	663,161.86
負債合計		104,814,505.22	228,046,744.41
所有者權益：			
實收基金		9,569,404,771.40	7,444,176,828.47
未分配利潤		1,942,031,046.68	3,536,822,894.36
所有者權益合計		11,511,435,818.08	10,980,999,722.83
負債和所有者權益總計		11,616,250,323.30	11,209,046,467.24

注：報告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.203 元，基金份額總額 9,569,404,771.40 份。

7.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-2,051,906,605.79	2,720,113,605.18
1.利息收入		129,977,161.33	103,920,558.30
其中：存款利息收入		6,943,902.52	4,990,184.66
債券利息收入		118,853,222.37	87,783,416.74
資產支持證券利息收入		354,765.67	1,498,591.01
買入返售金融資產收入		3,825,270.77	9,648,365.89
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		21,910,448.49	800,020,664.93
其中：股票投資收益		-115,807,052.14	749,510,085.38
基金投資收益		-	-
債券投資收益		-8,027,689.60	-14,889,669.30
資產支持證券投資收益		120,276.43	215,803.54
貴金屬投資收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		145,624,913.80	65,184,445.31
3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）		-2,209,578,333.76	1,813,058,335.13
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）		5,784,118.15	3,114,046.82
減：二、費用		229,342,623.45	165,249,837.21
1.管理人報酬		183,886,391.82	128,761,780.92
2.託管費		30,647,732.04	21,460,296.80
3.銷售服務費		-	-

4.交易費用		14,218,146.77	14,538,485.31
5.利息支出		164,452.06	69,140.37
其中：賣出回購金融資產支出		164,452.06	69,140.37
6.稅金及附加		19,701.22	-
7.其他費用		406,199.54	420,133.81
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		-2,281,249,229.24	2,554,863,767.97
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		-2,281,249,229.24	2,554,863,767.97

7.3 所有者權益（基金淨值）變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益（基金淨值）	7,444,176,828.47	3,536,822,894.36	10,980,999,722.83
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數（本期利潤）	-	-2,281,249,229.24	-2,281,249,229.24
三、本期基金份額交易產生的基金淨值變動數（淨值減少以“-”號填列）	2,125,227,942.93	935,387,374.83	3,060,615,317.76
其中：1.基金申購款	4,823,775,212.88	2,107,620,040.00	6,931,395,252.88
2.基金贖回款	-2,698,547,269.95	-1,172,232,665.17	-3,870,779,935.12
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動（淨值減少以“-”號填列）	-	-248,929,993.27	-248,929,993.27
五、期末所有者權益（基金淨值）	9,569,404,771.40	1,942,031,046.68	11,511,435,818.08
項目	上年度可比期間 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	實收基金	未分配利潤	所有者權益合計
一、期初所有者權益（基金淨值）	5,931,077,616.27	1,092,907,594.78	7,023,985,211.05
二、本期經營活動產生的基金淨值變動數（本期利潤）	-	2,554,863,767.97	2,554,863,767.97
三、本期基金份額交易	1,513,099,212.20	583,038,093.18	2,096,137,305.38

產生的基金淨值變動數 (淨值減少以“-”號填列)			
其中：1.基金申購款	3,331,232,694.29	1,256,023,396.52	4,587,256,090.81
2.基金贖回款	-1,818,133,482.09	-672,985,303.34	-2,491,118,785.43
四、本期向基金份額持有人分配利潤產生的基金淨值變動(淨值減少以“-”號填列)	-	-693,986,561.57	-693,986,561.57
五、期末所有者權益(基金淨值)	7,444,176,828.47	3,536,822,894.36	10,980,999,722.83

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4，財務報表由下列負責人簽署：

基金管理人負責人：楊明輝，主管會計工作負責人：汪貴華，會計機構負責人：汪貴華

7.4 報表附注

7.4.1 本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致的說明

本報告期所採用的會計政策、會計估計與最近一期年度報告相一致。

7.4.2 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

7.4.3 關聯方關係

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金管理人
中國銀行股份有限公司(“中國銀行”)	基金託管人
中信證券股份有限公司(“中信證券”)	基金管理人的股東
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股東
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股東
天津海鵬科技諮詢有限公司	基金管理人的股東

注：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

7.4.4 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

7.4.4.1 通過關聯方交易單元進行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金額	佔當期股票成交總額的比例	成交金額	佔當期股票成交總額的比例

中信證券	3,634,599,384.14	35.95%	5,708,626,945.80	55.20%
------	------------------	--------	------------------	--------

7.4.4.1.2 權證交易

無。

7.4.4.1.3 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券成交總額的比例
中信證券	107,876,391.90	19.46%	19,962,500.00	30.05%

7.4.4.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例
中信證券	770,000,000.00	100.00%	17,860,000,000.00	64.13%

7.4.4.1.5 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	3,070,700.22	35.12%	1,256,578.29	7.60%
關聯方名稱	上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	4,770,887.13	54.16%	649,074.45	4.71%

注：上述佣金按市場佣金率計算，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取證管費、經手費和由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。

該類佣金協議的服務範圍還包括佣金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場訊息服務。

7.4.4.2 關聯方報酬

7.4.4.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日
當期發生的基金應支付的管理費	183,886,391.82	128,761,780.92
其中：支付銷售機構的客戶維護費	26,569,343.96	17,796,695.03

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.5%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬=前一日基金資產淨值×1.5%/當年天數。

③客戶維護費是指基金管理人與基金銷售機構約定的用以向基金銷售機構支付客戶服務及銷售活動中產生的相關費用，該費用按照代銷機構所代銷基金的份額保有量作為基數進行計算，從基金管理人收取的基金管理費中列支，不屬於從基金資產中列支的費用項目。

7.4.4.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	30,647,732.04	21,460,296.80

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.25%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費=前一日基金資產淨值×0.25%/當年天數。

7.4.4.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

單位：人民幣元

本期 2018年1月1日至2018年12月31日						
銀行間市場交易的各關聯方 名稱	債券交易金額		基金逆回購		基金正回購	
	基金買入	基金賣出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中國銀行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期間 2017年1月1日至2017年12月31日						
銀行間市場交易的各關聯方 名稱	債券交易金額		基金逆回購		基金正回購	
	基金買入	基金賣出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中國銀行	-	81,504,875.62	-	-	-	-

7.4.4.4 各關聯方投資本基金的情況

7.4.4.4.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

份額單位：份

項目	本期	上年度可比期間
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
期初持有的基金份額	-	16,278,317.76
期間申購/買入總份額	-	-
期間因拆分變動份額	-	-
減：期間贖回/賣出總份額	-	16,278,317.76
期末持有的基金份額	-	-
期末持有的基金份額佔基金總份額比例	-	-

7.4.4.4.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

無。

7.4.4.5 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期		上年度可比期間	
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國銀行活期存款	627,927,325.34	6,831,344.86	253,909,224.48	4,713,227.89

注：本基金的活期銀行存款由基金託管人中國銀行保管，按銀行同業利率計息。

7.4.4.6 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

無。

7.4.4.7 其他關聯交易事項的說明

7.4.4.7.1 其他關聯交易事項的說明

無。

7.4.5 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限證券

7.4.5.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

7.4.5.1.1 受限證券類別：債券										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	可流通日	流通受限類	認購價格	期末估值單價	數量(單位：股)	期末成本總額	期末估值總額	備註

				型						
110049	海爾轉債	2018-12-18	2019-01-18	新發流通受限	100.00	100.00	1,130	113,000.00	113,000.00	-

7.4.5.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

7.4.5.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

7.4.5.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

7.4.5.3.2 交易所市場債券正回購

無。

7.4.6 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

7.4.6.1 金融工具公允價值計量的方法

根據企業會計準則的相關規定，以公允價值計量的金融工具，其公允價值的計量可分為三個層次：

第一層次：對存在活躍市場報價的金融工具，可以相同資產/負債在活躍市場上的報價確定公允價值。

第二層次：對估值日活躍市場無報價的金融工具，可以類似資產/負債在活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值；對估值日不存在活躍市場的金融工具，可以相同或類似資產/負債在非活躍市場上的報價為依據做必要調整確定公允價值。

第三層次：對無法獲得相同或類似資產可比市場交易價格的金融工具，可以其他反映市場參與者對資產/負債定價時所使用的參數為依據確定公允價值。

7.4.6.2 各層次金融工具公允價值

截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允價值計量的金融工具第一層次的餘額為 5,497,453,698.79 元，第二層次的餘額為 4,315,050,955.10 元，第三層次的餘額為 0 元。（截至 2017 年 12 月 31 日止：第一層次的餘額為 6,480,843,999.62 元，第二層次的餘額為 3,066,946,717.16 元，第三層次的餘額為 0 元。）

7.4.6.3 公允價值所屬層次間的重大變動

對於特殊事項停牌的股票，本基金將相關股票公允價值所屬層次於其進行估值調整之日起從第一層次轉入第二層次或第三層次，於股票復牌能體現公允價值並恢復市價估值之日起從第二層次或第三層次轉入第一層次。對於持有的非公開發行股票，本基金於限售期內將相關股票公允價值所屬層次列入第二層次，於限售期滿並恢復市價估值之日起從第二層次轉入第一層次。

7.4.6.4 第三層次公允價值本期變動金額

本基金持有的以公允價值計量的金融工具第三層次公允價值本期未發生變動。

§8 投資組合報告

8.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例（%）
1	權益投資	5,495,501,763.84	47.31
	其中：股票	5,495,501,763.84	47.31
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	4,317,002,890.05	37.16
	其中：債券	4,316,740,865.80	37.16
	資產支持證券	262,024.25	0.00
4	貴金屬投資	-	-
5	金融衍生品投資	-	-
6	買入返售金融資產	1,049,951,694.90	9.04
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
7	銀行存款和結算備付金合計	631,850,459.14	5.44
8	其他各項資產	121,943,515.37	1.05
9	合計	11,616,250,323.30	100.00

8.2 期末按行業分類的股票投資組合

8.2.1 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

金額單位：人民幣元

代碼	行業類別	公允價值	佔基金資產淨值比例（%）
A	農、林、牧、漁業	-	-
B	採礦業	143,019,468.00	1.24
C	製造業	3,753,201,383.11	32.60
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	11,716,470.00	0.10

E	建築業	-	-
F	批發和零售業	203,742.00	0.00
G	交通運輸、倉儲和郵政業	68,876,447.04	0.60
H	住宿和餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體和資訊技術服務業	23,746,418.40	0.21
J	金融業	312,644,530.50	2.72
K	房地產業	693,316,038.73	6.02
L	租賃和商務服務業	158,610,136.76	1.38
M	科學研究和技術服務業	2,903,517.04	0.03
N	水利、環境和公共設施管理業	36,666,435.30	0.32
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	221,607,219.00	1.93
R	文化、體育和娛樂業	68,989,957.96	0.60
S	綜合	-	-
	合計	5,495,501,763.84	47.74

8.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前十名股票投資明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量(股)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	000858	五糧液	9,050,572	460,493,103.36	4.00
2	600519	貴州茅台	735,347	433,862,083.47	3.77
3	000333	美的集團	9,636,967	355,218,603.62	3.09
4	000002	萬科 A	11,902,232	283,511,166.24	2.46
5	603833	歐派家居	3,357,432	267,654,479.04	2.33
6	600867	通化東寶	17,897,791	248,779,294.90	2.16
7	601318	中國平安	4,340,011	243,474,617.10	2.12
8	300124	匯川技術	12,068,828	243,066,195.92	2.11
9	600048	保利地產	19,845,300	233,976,087.00	2.03
10	601012	隆基股份	13,158,473	229,483,769.12	1.99

注：投資者欲了解本報告期末基金投資的所有股票明細，應閱讀刊登於基金管理人網站的年度報告正文。

8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

8.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例(%)
1	600519	貴州茅台	659,541,492.01	6.01
2	600809	山西汾酒	364,960,077.01	3.32

3	000002	萬科 A	339,529,095.05	3.09
4	601012	隆基股份	323,852,774.66	2.95
5	601318	中國平安	319,935,024.43	2.91
6	600048	保利地產	278,911,575.71	2.54
7	600867	通化東寶	270,225,487.99	2.46
8	002415	海康威視	233,585,551.40	2.13
9	600438	通威股份	229,565,467.56	2.09
10	300015	愛爾眼科	201,636,901.82	1.84
11	000651	格力電器	199,985,057.77	1.82
12	300124	匯川技術	186,685,130.97	1.70
13	601899	紫金礦業	182,323,244.62	1.66
14	600885	宏發股份	172,140,841.45	1.57
15	600066	宇通客車	161,170,216.61	1.47
16	600201	生物股份	119,066,819.88	1.08
17	000568	瀘州老窖	117,425,228.38	1.07
18	600779	水井坊	109,493,477.11	1.00
19	000858	五糧液	99,982,048.77	0.91
20	002304	洋河股份	99,116,895.84	0.90

注：“買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例（%）
1	600276	恒瑞醫藥	397,128,547.25	3.62
2	000568	瀘州老窖	326,731,767.67	2.98
3	600779	水井坊	266,228,603.32	2.42
4	000858	五糧液	240,825,413.67	2.19
5	601155	新城控股	231,317,320.11	2.11
6	000963	華東醫藥	222,263,761.24	2.02
7	000333	美的集團	214,536,715.06	1.95
8	000786	北新建材	212,665,614.16	1.94
9	000651	格力電器	142,847,623.61	1.30
10	300156	神霧環保	134,013,148.49	1.22
11	002043	兔寶寶	130,293,703.66	1.19
12	603801	志邦家居	115,762,525.81	1.05
13	000596	古井貢酒	111,654,354.14	1.02
14	601012	隆基股份	110,735,596.05	1.01
15	002415	海康威視	110,122,200.05	1.00
16	600519	貴州茅台	95,108,405.49	0.87
17	300408	三環集團	91,658,101.60	0.83
18	600702	捨得酒業	76,020,647.00	0.69
19	600885	宏發股份	75,582,224.03	0.69

20	600438	通威股份	72,601,963.05	0.66
----	--------	------	---------------	------

注：“賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	5,725,627,487.85
賣出股票收入（成交）總額	4,538,723,647.60

注：“買入股票成本”、“賣出股票收入”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	國家債券	218,360,955.10	1.90
2	央行票據	-	-
3	金融債券	4,076,546,000.00	35.41
	其中：政策性金融債	4,076,546,000.00	35.41
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	20,144,000.00	0.17
6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	1,689,910.70	0.01
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	4,316,740,865.80	37.50

8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量(張)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	180404	18 農發 04	9,200,000	922,300,000.00	8.01
2	180208	18 國開 08	6,300,000	641,529,000.00	5.57
3	180204	18 國開 04	6,100,000	638,792,000.00	5.55
4	180209	18 國開 09	4,100,000	411,312,000.00	3.57
5	108902	農發 1802	4,000,000	401,360,000.00	3.49

8.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細

金額單位：人民幣元

序號	證券代碼	證券名稱	數量(份)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	142400	PR 聚肆 A2	50,000.00	262,024.25	0.00
---	--------	----------	-----------	------------	------

8.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

本基金本報告期末未持有貴金屬。

8.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

本基金本報告期末未持有權證。

8.10 報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

8.10.1 報告期末本基金投資的股指期貨持倉和損益明細

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.10.2 本基金投資股指期貨的投資政策

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

8.11.1 本期國債期貨投資政策

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.2 報告期末本基金投資的國債期貨持倉和損益明細

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.3 本期國債期貨投資評價

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.12 投資組合報告附注

8.12.1 報告期內，本基金投資決策程序符合相關法律法規的要求，未發現本基金投資的前十名證券的發行主體本期出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

8.12.2 基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

8.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
1	存出保證金	1,104,787.70
2	應收證券清算款	7,796,924.69
3	應收股利	-
4	應收利息	105,188,487.69
5	應收申購款	7,853,315.29
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-

9	合計	121,943,515.37
---	----	----------------

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

本基金本報告期末未持有處於轉股期的可轉換債券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。

8.12.6 投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

§9 基金份額持有人資訊

9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

持有人戶數 (戶)	戶均持有的基金 份額	持有人結構			
		機構投資者		個人投資者	
		持有份額	佔總份額比 例	持有份額	佔總份額比 例
1,536,893	6,226.46	163,251,051.55	1.71%	9,406,153,719.85	98.29%

9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	持有份額總數(份)	佔基金總份額比 例
基金管理人所有從業人員持有 本基金	3,715,062.87	0.04%

9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間情況

項目	持有基金份額總量的數量區間(萬份)
本公司高級管理人員、基金投資和 研究部門負責人持有本開放式基金	50~100
本基金基金經理持有本開放式基金	10~50

§10 開放式基金份額變動

單位：份

基金合同生效日(2003年9月5日)基金份額總額	3,796,885,823.40
本報告期期初基金份額總額	7,444,176,828.47
本報告期基金總申購份額	4,823,775,212.88
減：本報告期基金總贖回份額	2,698,547,269.95
本報告期基金拆分變動份額	-

本報告期末基金份額總額	9,569,404,771.40
-------------	------------------

§11 重大事件披露

11.1 基金份額持有人大會決議

本報告期內，本基金未召開基金份額持有人大會。

11.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

本基金管理人於 2018 年 4 月 28 日發布公告，楊明輝先生代任華夏基金管理有限公司總經理，湯曉東先生不再擔任華夏基金管理有限公司總經理。

本基金管理人於 2018 年 5 月 19 日發布公告，李一梅女士擔任華夏基金管理有限公司總經理。

報告期內，2018 年 8 月，劉連舸先生擔任中國銀行股份有限公司行長職務。上述人事變動已按相關規定備案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期無涉及本基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟事項。

11.4 基金投資策略的改變

本基金本報告期投資策略未發生改變。

11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金本報告期應支付給安永華明會計師事務所（特殊普通合伙）的報酬為 100,000 元人民幣。截至本報告期末，該事務所已向本基金提供 11 年的審計服務。

11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本基金管理人、基金託管人涉及託管業務的部門及其高級管理人員在本報告期內無受稽查或處罰等情況。

11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

11.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及佣金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的佣金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	佣金	佔當期佣金總量的比例	
中信證券	3	3,634,599,384.14	35.95%	3,070,700.22	35.12%	-
長江證券	1	1,665,807,257.13	16.47%	1,551,366.12	17.74%	-
西南證券	2	1,294,908,664.49	12.81%	1,134,589.99	12.98%	-
安信證券	1	1,132,815,468.51	11.20%	1,054,991.81	12.07%	-

興業證券	1	788,384,491.82	7.80%	734,222.38	8.40%	-
川財證券	1	766,346,726.31	7.58%	560,421.83	6.41%	-
西部證券	1	465,967,677.73	4.61%	340,762.40	3.90%	-
國都證券	1	206,339,684.09	2.04%	150,896.88	1.73%	-
海通證券	1	156,094,843.93	1.54%	145,371.20	1.66%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇券商的標準，即：

i 經營行為規範，在近一年內無重大違規行為。

ii 公司財務狀況良好。

iii 有良好的內控制度，在業內有良好的聲譽。

iv 有較強的研究能力，能及時、全面、定期提供品質較高的宏觀、行業、公司和證券市場研究報告，並能根據基金投資的特殊要求，提供專門的研究報告。

v 建立了廣泛的資訊網路，能及時提供準確的資訊資訊和服務。

② 券商專用交易單元選擇程序：

i 對交易單元候選券商的研究服務進行評估

本基金管理人組織相關人員依據交易單元選擇標準對交易單元候選券商的服務品質和研究實力進行評估，確定選用交易單元的券商。

ii 協議簽署及通知託管人

本基金管理人與被選擇的券商簽訂交易單元租用協議，並通知基金託管人。

③ 除本表列示外，本基金還選擇了東方證券、廣發證券、國泰君安證券、申萬宏源證券、信達證券、中國銀河證券、中金公司、中銀國際證券、瑞銀證券、財通證券的交易單元作為本基金交易單元，本報告期無股票交易及應付佣金。

④ 在上述租用的券商交易單元中，興業證券、西部證券、財通證券的交易單元為本基金本期新增的交易單元，本期沒有剔除的券商交易單元。

11.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		回購交易	
	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期回購成交總額的比例
中信證券	107,876,391.90	19.46%	770,000,000.00	100.00%
長江證券	10,362,521.20	1.87%	-	-
西南證券	-	-	-	-
安信證券	400,202,300.00	72.20%	-	-
興業證券	5,010,000.00	0.90%	-	-

川財證券	30,839,496.60	5.56%	-	-
西部證券	-	-	-	-
國都證券	-	-	-	-
海通證券	-	-	-	-

§12 影響投資者決策的其他重要資訊

12.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況

本基金本報告期內未出現單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況。

華夏基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日