

# 华夏能源革新股票型证券投资基金

## 2021 年第 4 季度报告

### 2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

## §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，并对其内容的真实性、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 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	华夏能源革新股票	
基金主代码	003834	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 6 月 7 日	
报告期末基金份额总额	6,136,828,148.03 份	
投资目标	通过精选能源革新的优质企业，在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、权证投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略等。在股票投资策略上，本基金投资的能源革新主题界定如下：①直接从事新能源产业相关的行业，②受益于能源革新主题的行业，③新能源推广及其服务行业。	
业绩比较基准	中证内地新能源指数收益率*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。	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华夏能源革新股票 A	华夏能源革新股票 C
下属分级基金的交易代码	003834	013188
报告期末下属分级基金的份额总额	6,046,334,586.14 份	90,493,561.89 份

## §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	
	(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	华夏能源革新股票 A	华夏能源革新股票 C
1.本期已实现收益	975,764,642.99	10,005,776.40
2.本期利润	535,784,593.30	2,449,204.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0897	0.0382
4.期末基金资产净值	23,490,182,789.62	350,748,922.99
5.期末基金份额净值	3.885	3.876

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本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

华夏能源革新股票A：

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
过去三个月	2.13%	1.72%	0.81%	1.72%	1.32%	0.00%
过去六个月	15.04%	2.19%	14.57%	2.08%	0.47%	0.11%
过去一年	43.73%	2.32%	49.73%	2.21%	-6.00%	0.11%
过去三年	377.27%	2.16%	241.99%	1.87%	135.28%	0.29%
自基金合同 生效起至今	288.50%	2.06%	180.04%	1.70%	108.46%	0.36%

华夏能源革新股票C：

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
过去三个月	1.97%	1.72%	0.81%	1.72%	1.16%	0.00%
2021 年 8 月 4 日起至今	-1.15%	1.93%	-0.73%	1.77%	-0.42%	0.16%

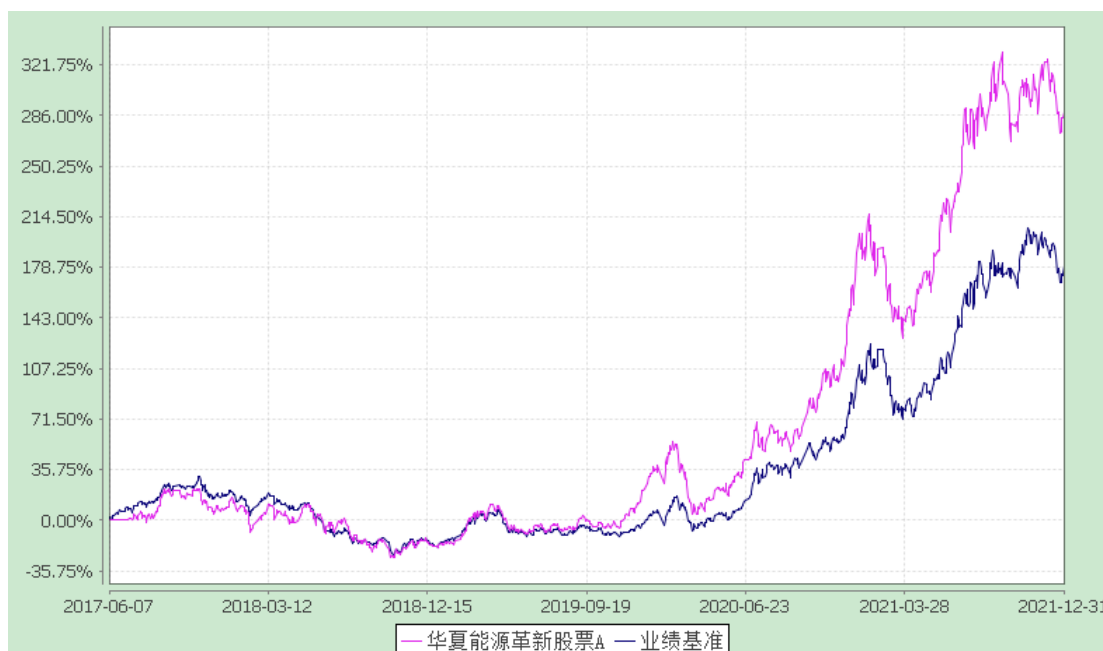
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏能源革新股票型证券投资基金

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 6 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日)

华夏能源革新股票A:



华夏能源革新股票C:



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期	证券从业	说明
----	----	------------	------	----

		限		年限	
		任职日期	离任日期		
郑泽鸿	本基金的基金经理	2017-06-07	-	9 年	硕士。2012 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。曾任投资研究部研究员、华夏高端制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 8 月 31 日至 2020 年 6 月 12 日期间）、华夏平稳增长混合型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 14 日至 2020 年 6 月 12 日期间）等。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 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，本公司严格执行了《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。

##### 4.3.2 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共有 18 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，市场整体呈现震荡走势。市场整体风格较为均衡，传统价值风格和成长风格均有所

表现。新能源方面，绿电板块和电网板块表现较好，新能源车、光伏和风电板块在相对高位呈现震荡走势。

过去三年，新能源整体表现很好，过去三年指数层面涨幅接近 250%+，这里面当然有基本面快速发展的因素，同时，新能源整体估值在过去三年也有了大幅提升。我们做任何投资判断，都要叠加周期的因素。比如，看三年，新能源是很好的行业，过去三年收益率很高，看未来三年，我个人也认为有较大收益率空间。但把投资周期缩短，比如看半年或者一年，因为静态估值在高位，参与者较多，完全有可能迎来波动或者短期跑不赢其他指数，就像 2021 年的白酒和医药行业。因此，在这个时间点，个人建议投资者应该降低短期新能源收益率的预期，把眼光放长，摆平心态，才能更好地应对波动。

报告期内，本基金保持了一贯的风格，新能源短期市场热度较高，某些环节的公司股价已经呈现短期泡沫化的倾向，组合在仓位上也做了一些调整，进行了一些分散化配置。站在长周期角度，基金经理认为，新能源长期空间依然很大，汽车电动化的过程刚刚开始，未来将进入加速电动化的阶段。光伏平价时代也将到来，在一次能源角度，光伏发电占比提升空间依然很大。虽然新能源短期股价呈现了一定泡沫化倾向，但站在中长期维度，行业仍具备较大的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，华夏能源革新股票 A 基金份额净值为 3.885 元，本报告期份额净值增长率为 2.13%；华夏能源革新股票 C 基金份额净值为 3.876 元，本报告期份额净值增长率为 1.97%，同期业绩比较基准增长率为 0.81%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	20,361,585,070.63	84.62
	其中：股票	20,361,585,070.63	84.62
2	固定收益投资	17,253,243.00	0.07
	其中：债券	17,253,243.00	0.07

	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	3,630,673,109.79	15.09
7	其他各项资产	53,034,985.24	0.22
8	合计	24,062,546,408.66	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,068,886,673.46	8.68
C	制造业	16,551,507,543.95	69.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	431,771,892.87	1.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	130,422,530.06	0.55
J	金融业	1,178,890,719.11	4.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,329.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	40,839.39	0.00
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	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	20,361,585,070.63	85.41

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603799	华友钴业	18,588,111	2,050,454,524.41	8.60
2	300750	宁德时代	2,953,364	1,736,578,032.00	7.28
3	300073	当升科技	19,977,054	1,735,406,680.98	7.28
4	002756	永兴材料	10,363,535	1,534,010,450.70	6.43
5	002240	盛新锂能	25,913,196	1,501,669,708.20	6.30
6	603659	璞泰来	6,606,487	1,061,067,877.07	4.45
7	603993	洛阳钼业	177,779,800	992,011,284.00	4.16
8	002460	赣锋锂业	6,493,489	927,594,903.65	3.89
9	601633	长城汽车	19,087,392	926,502,007.68	3.89
10	000625	长安汽车	55,872,444	848,702,424.36	3.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	17,253,243.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,253,243.00	0.07

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产
----	------	------	-------	---------	-------

					净值比例 (%)
1	113049	长汽转债	112,700	17,253,243.00	0.07
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

##### 5.9.2 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 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。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，盛新锂能集团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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,612,729.32
2	应收证券清算款	72,232.06
3	应收股利	-
4	应收利息	438,415.93
5	应收申购款	49,911,607.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,034,985.24

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113049	长汽转债	17,253,243.00	0.07

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华夏能源革新股票A	华夏能源革新股票C
本报告期期初基金份额总额	5,956,203,989.70	48,945,960.38
报告期期间基金总申购份额	1,818,293,605.79	96,082,983.78
减：报告期期间基金总赎回份额	1,728,163,009.35	54,535,382.27
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,046,334,586.14	90,493,561.89

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

#### 1、报告期内披露的主要事项

2021 年 10 月 13 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 10 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 10 月 20 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 10 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 10 月 23 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 11 月 10 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 11 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 12 月 4 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 12 月 8 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

2021 年 12 月 10 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告。

#### 2、其他相关信息

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、境内首批中日互通 ETF 基金管理人,首批商品期货 ETF 基金管理人,首批公募 MOM 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,国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司,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。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、商品指数等较为完整的产品线。

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《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强（A 类）排序第 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接（A 类）排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接（A 类）排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数（A 类）排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42、；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接（A 类）排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）（A 类）排序第 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合（LOF）（A 类）排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合（A 类）排序第 26/231、

华夏睿磐泰利混合(A类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金(A类)中华夏鼎航债券(A类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金(A类)中华夏短债债券(A类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A类)排序第 32/203；在普通债券型基金(二级)(A类)中华夏鼎泓债券(A类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金(A类)中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A类)排序第 80/427。

养老&FOF产品：在混合型 FOF（权益资产 0-30%）(A类)中华夏聚丰混合（FOF）(A类)排序第 1/16、华夏聚惠 FOF(A类)排序第 3/16；在养老目标日期 FOF（2040）(A类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/11。

在客户服务方面，4 季度，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）华夏基金直销上线交通银行卡快捷支付业务，交易额度进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线非活期通基金的预约赎回功能，增加客户操作便利性；（3）与排排网基金销售等销售机构开展代销合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“披荆斩棘的投资人”、“华夏亲子财商营”、“定投的良辰吉日”等活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏能源革新股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏能源革新股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者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

二〇二二年一月二十一日