

华安中小盘成长混合型证券投资基金
2019 年半年度报告摘要
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安中小盘成长混合	
基金主代码	040007	
交易代码	040007(前端)	041007(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 4 月 10 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,134,187,529.86 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	主要依靠基金管理人的研究优势，将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中，在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上，积极把握备选股票的投资机会，为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
业绩比较基准	40%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×中债-国债总指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆滢	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105798
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	168,081,322.97
本期利润	340,420,359.11
加权平均基金份额本期利润	0.2953
本期基金份额净值增长率	24.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.9281
期末基金资产净值	1,653,116,648.51
期末基金份额净值	1.4575

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：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	4.92%	1.11%	1.77%	1.06%	3.15%	0.05%
过去三个月	-5.65%	1.63%	-6.54%	1.37%	0.89%	0.26%
过去六个月	24.76%	1.60%	13.69%	1.34%	11.07%	0.26%
过去一年	3.45%	1.43%	-4.69%	1.32%	8.14%	0.11%
过去三年	-1.17%	1.14%	-23.08%	1.02%	21.91%	0.12%
自基金合同生效起至今	59.08%	1.67%	26.90%	1.52%	32.18%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来 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变动的比较

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007 年 4 月 10 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型。

4 管理人报告

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基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2019 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 123 只开放式基金，管理资产规模达到 3171.00 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李欣	本基金的基金 经理	2018-06-11	-	9 年	硕士研究生，9 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月起，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任本基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。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

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、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易

机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

(2) 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同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% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，上证综指、深证成指分别上涨 19.45%、26.77%，上证 50 指数、中小板指、创业板

指分别上涨 27.80%、20.75%、20.87%，行业分化较为显著，食品饮料、农林牧渔、非银行金融行业涨幅居前，建筑、石油石化、传媒等行业涨幅落后。市场对于以白酒为代表的消费白马股、以金融龙头股为代表的“核心资产”给予了较高的估值溢价。而对于科技类成长股，一方面贸易摩擦、技术风险带来了不确定性，但同时科创板开板预期、5G 等行业新应用给其带来了估值提升的机会，两方面的合力使得其股价在波动中上行。

在本报告内，国内宏观经济从去年下半年的下行压力中基本企稳，美国对我国在贸易、科技等领域的挑战跌宕起伏，虽然我国加以有效的应对和化解，但仍是报告期内市场波动较大的重要原因。报告期内，美国有关政府部门将华为等中国科技公司加入所谓的“实体清单”，对全球科技产业链的正常运行造成了很大干扰，也对电子、通信、计算机等科技行业上市公司的市场表现产生了很大影响。

然而，对于受到中美关系影响的科技产业而言，“危”、“机”相随，关键领域的自主可控迎来前所未有的发展机遇。硬件体系而言，精细化工材料、半导体和光电子的设计与制造、精密制造装备等领域都亟待加强；软件体系方面，操作系统、中间件、基础应用软件、专用设计软件等领域也存在国产替代的巨大空间。华为等下游整机厂商将加速认证和导入国内供应商，为相应的上市公司带来很好的发展机遇。

在这种“危”“机”并存的市场格局下，本基金主要自下而上选股，选取各个行业和细分领域中具有长期成长潜力、抗风险能力强的以中小盘为主的上市公司，进行深入研究和审慎配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4575 元，本报告期份额净值增长率为 24.76%，同期业绩比较基准增长率为 13.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球角度看，宏观经济处于“也无风雨也无晴”的局面，需求平稳而缺乏新的拉动引擎，货币宽松是西方主要经济体在多重博弈之下最终的选择，也是最容易作出的选择。过去数十年全球化进程带来了效率和福利的普遍提升，但其负面效应，如发达国家内部金融部门和制造业部门盈利能力差距逐渐扩大，对美国等国家内部阶层之间的撕裂效应迅速加大。美国当局主动挑起对华贸易摩擦就是其将内部压力向外转移的表现形式。

国内宏观经济层面，在“稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期”的政策目标下，在充满挑战的外贸形势下，本基金认为国内将以“积极的财政政策，稳健的货币政策”为主要的财经金融政策取向，与之前相比，更加重视对科技创新尤其是突破“卡脖子”技术的扶持。

本基金认为，科创板的设立对我国证券行业有着里程碑式的重大意义，是充分利用直接融资市场支持科技创新的重要举措。从科技产业的角度看，解决了以往一级市场股权融资面临的估值定价不透明、流动性和投资期限匹配等问题，将大大加快我国科技产业的发展步伐；从投资者角度考虑，拓宽了标的选择范围，对处于不同成长周期和利润释放期的公司都有机会进行投资。

行业走势方面，虽然美国挑起的贸易摩擦对我国出口外贸和全球产业链的平稳运行带来了巨大挑战，但也促使我们在一些关键领域加速自主可控和进口替代的进程，建立完整、坚强、有国际竞争力的全产业链体系。2019 年是 5G 元年，相关基础设施开始全面建设，终端产品放量时间稍晚，估计将于今年下半年和明年迎来快速普及期，应用场景和商业模式方面的创新探索也在加速进行。在 5G、人工智能、智能制造、生物制药、新材料、互联网等领域的科技创新带动下，我们看好相关领域的投资机会，并将基于“独立、深入、广泛”的研究，从中选取以中小盘为主的优质上市公司进行投资。

我们认为，上市公司的股价表现是其实体经济运行状况在资本市场的映射，做好投资的根本在于对实体经济的了解、把握，包括对行业和技术演进方向、竞争格局变化、产业链联动等方面的紧密跟踪。立足实业、了解实业、与实业从业者共同提高研判行业变化趋势的能力，是扎扎实实做好长期投资的基础。本基金将更加注重从对实业的研究、学习、观察、跟踪中发掘投资机会，把握行业发展带来的红利。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安中小盘成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华安中小盘成长混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安中小盘成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安中小盘成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安中小盘成长混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	349,439,164.32	354,414,887.43

结算备付金	2,404,686.08	5,807,488.22
存出保证金	986,076.08	1,062,585.81
交易性金融资产	1,341,802,641.04	1,032,367,157.59
其中：股票投资	1,324,488,951.42	987,835,633.75
基金投资	-	-
债券投资	17,313,689.62	44,531,523.84
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	394,307.25	843,852.20
应收股利	-	-
应收申购款	17,625.07	44,537.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,695,044,499.84	1,394,540,508.69
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
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	-	-
应付证券清算款	33,165,550.67	30,273,826.59
应付赎回款	861,382.22	193,107.35
应付管理人报酬	1,963,782.32	1,762,530.26
应付托管费	327,297.07	293,755.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,994,702.72	6,536,181.93
应交税费	52.12	37.15
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	615,084.21	896,042.40
负债合计	41,927,851.33	39,955,480.74
所有者权益：	-	-
实收基金	489,947,388.77	500,889,781.40
未分配利润	1,163,169,259.74	853,695,246.55
所有者权益合计	1,653,116,648.51	1,354,585,027.95
负债和所有者权益总计	1,695,044,499.84	1,394,540,508.69

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4575 元，基金份额总额 1,134,187,529.86

份。

6.2 利润表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	362,645,615.36	-130,995,275.84
1.利息收入	1,646,310.41	1,662,778.20
其中：存款利息收入	906,202.88	538,324.54
债券利息收入	740,107.53	1,124,453.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	188,627,610.40	-215,594,140.81
其中：股票投资收益	179,363,264.56	-241,252,839.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-185,190.00	399,900.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,449,535.84	25,258,798.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	172,339,036.14	82,914,915.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	32,658.41	21,171.34
减：二、费用	22,225,256.25	21,988,648.56
1. 管理人报酬	11,905,030.74	13,461,012.99
2. 托管费	1,984,171.81	2,243,502.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,202,637.56	6,066,309.36
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	25.64	-
7. 其他费用	133,390.50	217,824.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	340,420,359.11	-152,983,924.40
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	340,420,359.11	-152,983,924.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	500,889,781.40	853,695,246.55	1,354,585,027.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	340,420,359.11	340,420,359.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-10,942,392.63	-30,946,345.92	-41,888,738.55
其中：1.基金申购款	18,561,251.76	40,066,534.40	58,627,786.16
2.基金赎回款	-29,503,644.39	-71,012,880.32	-100,516,524.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	489,947,388.77	1,163,169,259.74	1,653,116,648.51
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	540,102,851.47	1,384,334,162.77	1,924,437,014.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-152,983,924.40	-152,983,924.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,694,891.07	-83,821,253.53	-116,516,144.60
其中：1.基金申购款	6,973,138.22	17,142,190.95	24,115,329.17
2.基金赎回款	-39,668,029.29	-100,963,444.48	-140,631,473.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	507,407,960.40	1,147,528,984.84	1,654,936,945.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱兴华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中小盘成长混合型证券投资基金(原名为华安中小盘成长股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字[2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》，原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 4 月 10 日起，原基金安瑞终止上市，更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,060,436,162.37 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.314909165，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购，共募集人民币 9,883,484,414.21 元，业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》

的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2019 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中小盘成长股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	611,515,538.00	11.25%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	557,272.89	11.16%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	11,905,030.74		13,461,012.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,186,465.02		2,514,900.31	

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	1,984,171.81		2,243,502.12

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国工商银行	349,439,164. 32	858,802.73	273,293,065. 39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下中签	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-
6.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128068	和而转债	2019-06-04	2019-07-01	认购新发证券	100.00	100.00	5,715.00	571,500.00	571,500.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

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	1,324,488,951.42	78.14
	其中：股票	1,324,488,951.42	78.14
2	固定收益投资	17,313,689.62	1.02
	其中：债券	17,313,689.62	1.02
	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	351,843,850.40	20.76
7	其他各项资产	1,398,008.40	0.08
8	合计	1,695,044,499.84	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	43,825,044.25	2.65
C	制造业	1,080,107,991.71	65.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,629,203.00	1.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,451,891.63	4.14
J	金融业	61,678,903.81	3.73
K	房地产业	29,649,252.68	1.79
L	租赁和商务服务业	36,707.74	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,086,850.00	1.28
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,324,488,951.42	80.12

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	2,223,260	55,114,615.40	3.33
2	000977	浪潮信息	2,267,802	54,109,755.72	3.27
3	000661	长春高新	150,273	50,792,274.00	3.07
4	603799	华友钴业	2,297,796	48,966,032.76	2.96
5	000063	中兴通讯	1,503,245	48,900,559.85	2.96
6	601138	工业富联	3,919,100	47,225,155.00	2.86
7	300613	富瀚微	501,623	44,804,966.36	2.71
8	600489	中金黄金	4,231,900	43,461,613.00	2.63
9	002202	金风科技	3,422,396	42,540,382.28	2.57
10	002236	大华股份	2,909,349	42,243,747.48	2.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	000063	中兴通讯	111,544,030.88	8.23
2	002236	大华股份	81,733,043.55	6.03
3	603799	华友钴业	79,118,372.57	5.84
4	603501	韦尔股份	77,336,900.70	5.71
5	300613	富瀚微	75,696,646.96	5.59
6	000977	浪潮信息	65,668,748.05	4.85
7	002475	立讯精密	58,309,955.19	4.30
8	600426	华鲁恒升	55,436,569.05	4.09
9	600486	扬农化工	55,417,753.69	4.09
10	002415	海康威视	52,667,173.11	3.89
11	002410	广联达	46,685,059.12	3.45
12	601138	工业富联	46,277,090.39	3.42
13	002138	顺络电子	45,059,618.90	3.33
14	002456	欧菲光	43,500,934.95	3.21
15	300454	深信服	43,329,973.66	3.20
16	300760	迈瑞医疗	42,441,648.18	3.13
17	603369	今世缘	41,159,980.80	3.04
18	002202	金风科技	40,203,640.79	2.97
19	002594	比亚迪	39,925,987.78	2.95
20	300322	硕贝德	38,498,231.63	2.84
21	600104	上汽集团	36,608,866.83	2.70
22	600741	华域汽车	36,605,272.34	2.70
23	002180	纳思达	35,936,854.25	2.65
24	600352	浙江龙盛	35,813,258.00	2.64
25	300497	富祥股份	35,723,843.46	2.64
26	002439	启明星辰	35,464,549.23	2.62
27	000917	电广传媒	35,060,384.00	2.59
28	600088	中视传媒	34,982,116.33	2.58
29	300014	亿纬锂能	34,832,870.92	2.57
30	601888	中国国旅	32,891,754.79	2.43
31	603068	博通集成	32,665,770.84	2.41
32	600308	华泰股份	31,278,043.80	2.31
33	002179	中航光电	31,266,714.53	2.31
34	002189	中光学	30,941,461.00	2.28
35	300136	信维通信	30,522,589.00	2.25
36	300681	英搏尔	30,474,815.65	2.25
37	601231	环旭电子	29,290,647.82	2.16
38	300223	北京君正	28,280,792.42	2.09
39	600690	海尔智家	28,099,852.64	2.07
40	300054	鼎龙股份	27,713,437.94	2.05
41	300316	晶盛机电	27,544,850.29	2.03
42	603019	中科曙光	27,283,458.00	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000063	中兴通讯	92,505,741.98	6.83
2	300760	迈瑞医疗	70,324,142.67	5.19
3	603501	韦尔股份	64,596,115.28	4.77
4	300203	聚光科技	58,006,248.04	4.28
5	600088	中视传媒	56,531,842.19	4.17
6	600900	长江电力	56,186,960.24	4.15
7	002415	海康威视	56,181,052.57	4.15
8	002236	大华股份	55,309,684.55	4.08
9	002456	欧菲光	54,967,502.36	4.06
10	600352	浙江龙盛	50,855,657.43	3.75
11	300136	信维通信	48,648,200.19	3.59
12	300014	亿纬锂能	46,057,145.10	3.40
13	603369	今世缘	42,788,397.00	3.16
14	300454	深信服	42,028,422.48	3.10
15	002371	北方华创	41,984,242.27	3.10
16	603019	中科曙光	40,663,865.00	3.00
17	002410	广联达	39,910,406.25	2.95
18	300223	北京君正	38,549,772.20	2.85
19	002202	金风科技	38,149,046.54	2.82
20	002938	鹏鼎控股	38,040,728.90	2.81
21	300232	洲明科技	37,082,649.70	2.74
22	002594	比亚迪	36,643,362.97	2.71
23	601952	苏垦农发	36,132,970.06	2.67
24	601231	环旭电子	36,055,311.23	2.66
25	600426	华鲁恒升	34,131,723.33	2.52
26	601888	中国国旅	33,676,639.77	2.49
27	300497	富祥股份	33,393,471.43	2.47
28	300059	东方财富	32,996,519.80	2.44
29	600563	法拉电子	32,119,600.95	2.37
30	000917	电广传媒	31,136,820.00	2.30
31	600536	中国软件	30,594,470.57	2.26
32	002439	启明星辰	29,654,256.62	2.19
33	002189	中光学	29,477,657.00	2.18
34	300316	晶盛机电	29,386,546.52	2.17
35	002180	纳思达	29,346,049.53	2.17

36	002402	和而泰	28,446,722.04	2.10
37	000977	浪潮信息	28,162,899.66	2.08
38	600690	海尔智家	27,840,851.00	2.06
39	000997	新大陆	27,584,619.92	2.04

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,711,784,592.30
卖出股票的收入（成交）总额	2,725,817,119.55

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末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	10,003,000.00	0.61
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	0.61
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）	7,310,689.62	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,313,689.62	1.05

7.6 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

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	180209	18 国开 09	100,000	10,003,000.00	0.61
2	123016	洲明转债	33,795	4,158,812.70	0.25
3	128061	启明转债	13,794	1,531,685.76	0.09
4	127005	长证转债	9,042	1,048,691.16	0.06
5	128068	和而转债	5,715	571,500.00	0.03

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	986,076.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	394,307.25
5	应收申购款	17,625.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,398,008.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123016	洲明转债	4,158,812.70	0.25
2	127005	长证转债	1,048,691.16	0.06

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
85,458	13,271.87	64,781,166.05	5.71%	1,069,406,363.81	94.29%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,008.23	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 4 月 10 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,159,518,574.01
本报告期基金总申购份额	42,967,444.67
减：本报告期基金总赎回份额	68,298,488.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,134,187,529.86

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2019 年 1 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2019 年 2 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
红塔证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	741,724,133.99	13.65%	678,484.61	13.58%	-
国泰君安	1	611,515,538.00	11.25%	557,272.89	11.16%	-
西藏东方财富	1	578,307,889.65	10.64%	527,012.78	10.55%	-
天风证券	1	492,424,877.01	9.06%	448,747.29	8.98%	-
东北证券	1	432,532,334.40	7.96%	402,815.30	8.06%	-
民生证券	1	427,098,407.57	7.86%	397,762.18	7.96%	-

中金公司	1	332,013,847.11	6.11%	309,205.02	6.19%	-
国金证券	2	325,478,369.08	5.99%	303,117.20	6.07%	-
川财证券	1	276,214,554.16	5.08%	251,715.14	5.04%	-
银河证券	1	263,868,636.56	4.86%	245,741.46	4.92%	-
长江证券	1	225,985,269.30	4.16%	205,940.48	4.12%	-
广发华福	1	198,710,857.59	3.66%	185,058.62	3.71%	-
招商证券	1	176,538,850.18	3.25%	160,880.56	3.22%	-
东吴证券	1	170,193,372.98	3.13%	155,097.31	3.11%	-
华泰证券	1	144,720,194.27	2.66%	131,883.90	2.64%	-
瑞银证券	1	37,274,126.80	0.69%	33,967.98	0.68%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动物体资源，为基金投资赢取机会；

- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

- (1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

- (2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

- (3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

- (4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2019 年 6 月民族证券 28320 工行上交所席位退租完成

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
红塔证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日