

华安行业轮动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	华安行业轮动混合
基金主代码	040016
交易代码	040016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 5 月 11 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	135,454,308.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金注重把握行业轮动规律，力求通过行业优化配置，对强势行业的龙头企业和具有估值优势、成长潜力的股票进行重点投资，获取超额收益，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法优化行业配置，构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的多因子模型等数量工具进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆滢	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

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	基金管理人及基金托管人住所

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	44,832,612.42
本期利润	67,768,717.34
加权平均基金份额本期利润	0.4701
本期基金份额净值增长率	38.84%
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	0.6189
期末基金资产净值	219,285,276.98
期末基金份额净值	1.6189

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

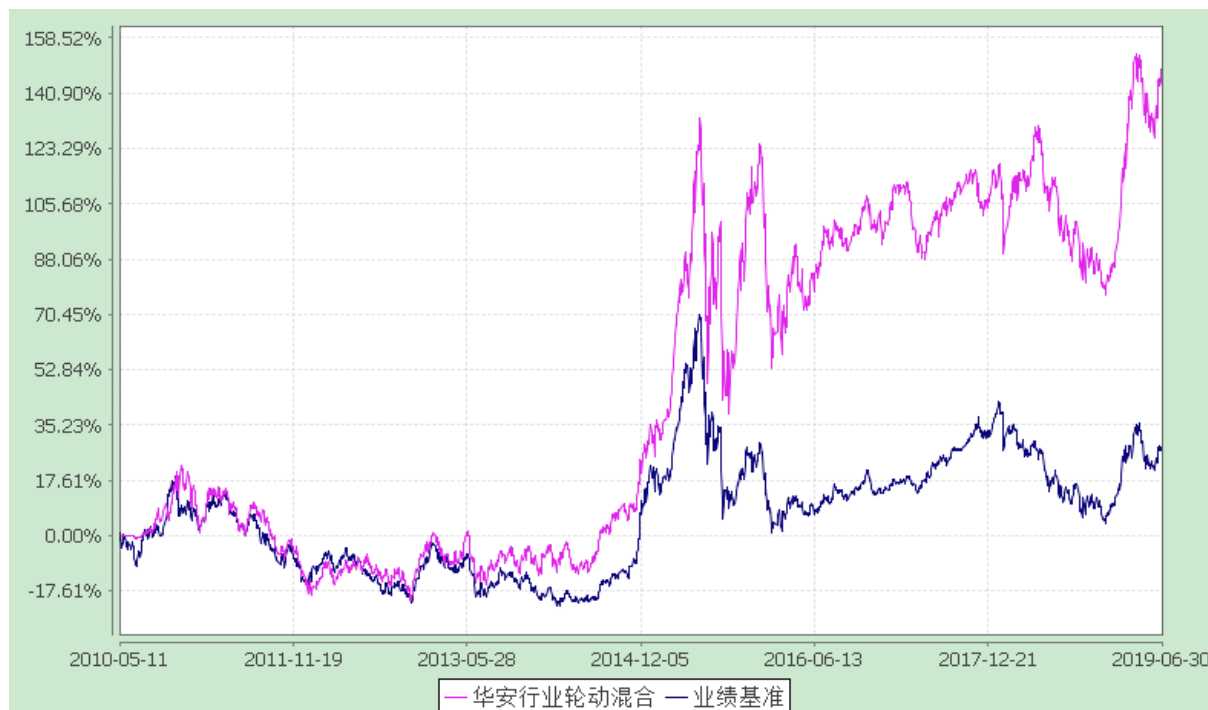
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
基金合同生效起至今	148.70%	1.52%	28.00%	1.19%	120.70%	0.33%
过去一个月	6.62%	1.25%	4.41%	0.92%	2.21%	0.33%
过去三个月	1.38%	1.48%	-1.07%	1.22%	2.45%	0.26%
过去六个月	38.84%	1.45%	21.58%	1.23%	17.26%	0.22%
过去一年	17.88%	1.37%	7.71%	1.22%	10.17%	0.15%
过去三年	33.56%	1.09%	17.01%	0.88%	16.55%	0.21%

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

(2010 年 5 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日)



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		
陈媛	本基金的基金经理	2018-06-11	-	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经验。上海交通大学应届毕业生加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 2 月起，担任华安生态优先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。2018 年 11 月起，同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。
饶晓鹏	本基金的基金经理	2018-11-12	-	11 年	硕士，11 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起同时担任华安安信消费服务混合型证券投资基金及华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任本基金的基金经理。

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（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

上半年上证指数上涨 19.45%，创业板指数上涨 20.87%。行业层面，食品饮料、非银行金融、农林牧渔、家电、计算机涨幅靠前，建筑、传媒、汽车、钢铁、纺织服装等涨幅靠后。风格上大市值蓝筹、各个细分行业龙头整体较强。上半年华安行业轮动在消费、成长行业均获得了一定的收益，通过行业结构的调整降低了市场下跌的影响。

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 1.6189 元，本报告期份额净值增长率为 38.84%，同期业绩比较基准增长率为 21.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，在国内外风险挑战增多的复杂局面下，管理层适时适度实施宏观政策逆周期调节，有力推动高质量发展，上半年经济运行延续了总体平稳、稳中有进的发展态势，主要宏观经济指标保持在合理区间。

展望下半年，国内经济增长放缓既有结构性因素、也有周期性因素，外部的风险因素仍为完全消除，下半年经济下行压力加大。去年底中央经济工作的部署在今年上半年看到了明显的托底效果，从管理层的政策工具看仍有空间，经济尾部风险较低。中长期看，中国经济处于经济转型升级的阶段，相应地，总量投资逻辑向优质龙头或结构升级逻辑转换。

未来一段时间，华安行业轮动将继续聚焦符合产业方向的细分行业龙头，积极拥抱高质量发展阶段的高速增长的公司。注重行业轮动机会，争取为投资者创造良好收益。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安行业轮动混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：华安行业轮动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	30,155,038.38	71,569,488.21
结算备付金	1,245,372.87	290,445.78
存出保证金	106,605.05	57,976.62
交易性金融资产	188,840,541.49	110,158,517.77
其中：股票投资	188,830,992.05	110,158,517.77
基金投资	-	-
债券投资	9,549.44	-
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	1,616,325.71	-
应收利息	6,487.52	12,630.72
应收股利	-	-
应收申购款	169,175.50	22,599.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	222,139,546.52	182,111,658.41
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	-	-
应付赎回款	1,201,071.62	70,862.17
应付管理人报酬	258,665.56	236,181.87
应付托管费	43,110.93	39,363.65
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,256,175.39	413,109.80
应交税费	0.07	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	95,245.97	358,239.75
负债合计	2,854,269.54	1,117,757.24
所有者权益：	-	-
实收基金	135,454,308.38	155,224,517.32
未分配利润	83,830,968.60	25,769,383.85

所有者权益合计	219,285,276.98	180,993,901.17
负债和所有者权益总计	222,139,546.52	182,111,658.41

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6189，基金份额总额 135,454,308.38 份。

6.2 利润表

会计主体：华安行业轮动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	71,736,871.20	15,476,696.74
1.利息收入	126,754.41	283,361.07
其中：存款利息收入	126,707.59	107,141.89
债券利息收入	46.82	176,219.18
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）	48,595,320.30	-8,357,405.78
其中：股票投资收益	46,857,657.43	-10,386,857.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,179.00	-
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	1,714,483.87	2,029,451.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	22,936,104.92	22,906,705.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	78,691.57	644,036.09
减：二、费用	3,968,153.86	3,966,601.56
1. 管理人报酬	1,547,625.94	1,635,852.24
2. 托管费	257,937.62	272,642.07
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,055,470.87	1,864,356.09
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	0.15	-
7. 其他费用	107,119.28	193,751.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	67,768,717.34	11,510,095.18
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	67,768,717.34	11,510,095.18
-------------------	---------------	---------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安行业轮动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）	155,224,517.32	25,769,383.85	180,993,901.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,768,717.34	67,768,717.34
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）	-19,770,208.94	-9,707,132.59	-29,477,341.53
其中：1.基金申购款	24,853,634.14	12,989,372.28	37,843,006.42
2.基金赎回款	-44,623,843.08	-22,696,504.87	-67,320,347.95
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）	135,454,308.38	83,830,968.60	219,285,276.98
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）	474,043,531.17	173,972,676.72	648,016,207.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,510,095.18	11,510,095.18
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）	-312,591,093.36	-125,211,916.87	-437,803,010.23
其中：1.基金申购款	64,799,494.62	27,842,327.78	92,641,822.40
2.基金赎回款	-377,390,587.98	-153,054,244.65	-530,444,832.63
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	161,452,437.81	60,270,855.03	221,723,292.84

金净值)			
------	--	--	--

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：朱学华，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

华安行业轮动混合型证券投资基金(原名为华安行业轮动股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 318 号《关于核准华安行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安行业轮动股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,805,458,825.83 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 111 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安行业轮动股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,805,692,890.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 234,064.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安行业轮动股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安行业轮动混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安行业轮动混合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、货币市场工具、资产支持证券、权证及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%；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 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%，现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安行业轮动混合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、中国基金业协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 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
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	448,607,133.36	32.91%	-	-

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	408,817.07	32.54%	408,817.07	32.54%
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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-

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	1,547,625.94	1,635,852.24

其中：支付销售机构的客户维护费	611,921.49	515,879.47
-----------------	------------	------------

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 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	257,937.62	272,642.07

注：支付基金托管人中国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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		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
中国银行	30,155,038.38	118,389.47	50,811,114.16	99,106.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

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	-

6.4.9.2 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

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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	188,830,992.05	85.01
	其中：股票	188,830,992.05	85.01
2	固定收益投资	9,549.44	0.00
	其中：债券	9,549.44	0.00
	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	31,400,411.25	14.14
7	其他各项资产	1,898,593.78	0.85
8	合计	222,139,546.52	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	111,825.00	0.05
C	制造业	114,599,689.05	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,339,027.00	1.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,684,209.00	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	4,054,453.00	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,364,783.77	1.53
J	金融业	37,006,778.04	16.88
K	房地产业	4,786,120.00	2.18

L	租赁和商务服务业	9,210,728.55	4.20
M	科学研究和技术服务业	6,476,426.00	2.95
N	水利、环境和公共设施管理业	534,576.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,639,270.04	0.75
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	188,830,992.05	86.11

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	000333	美的集团	282,450	14,647,857.00	6.68
2	600036	招商银行	375,900	13,524,882.00	6.17
3	002142	宁波银行	502,300	12,175,752.00	5.55
4	002475	立讯精密	464,800	11,522,392.00	5.25
5	000661	长春高新	33,232	11,232,416.00	5.12
6	300129	泰胜风能	2,461,734	10,314,665.46	4.70
7	600585	海螺水泥	242,000	10,043,000.00	4.58
8	000858	五粮液	81,908	9,661,048.60	4.41
9	603218	日月股份	474,460	9,204,524.00	4.20
10	601888	中国国旅	98,807	8,759,240.55	3.99

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	600036	招商银行	22,198,550.43	12.26
2	300383	光环新网	20,956,259.95	11.58
3	002475	立讯精密	19,104,267.69	10.56
4	000333	美的集团	15,811,128.10	8.74

5	603218	日月股份	15,755,785.89	8.71
6	600030	中信证券	15,010,066.62	8.29
7	002142	宁波银行	14,723,859.88	8.14
8	300129	泰胜风能	14,665,380.00	8.10
9	601888	中国国旅	13,428,176.10	7.42
10	603636	南威软件	12,925,136.72	7.14
11	600519	贵州茅台	11,394,067.00	6.30
12	600801	华新水泥	11,293,718.40	6.24
13	600406	国电南瑞	10,978,089.22	6.07
14	600025	华能水电	10,799,944.00	5.97
15	000977	浪潮信息	10,437,871.00	5.77
16	000858	五粮液	9,928,472.21	5.49
17	603666	亿嘉和	9,835,952.60	5.43
18	002821	凯莱英	9,800,276.02	5.41
19	601318	中国平安	9,706,267.00	5.36
20	600585	海螺水泥	9,603,496.32	5.31
21	300014	亿纬锂能	9,427,588.03	5.21
22	002008	大族激光	9,236,140.26	5.10
23	000001	平安银行	8,687,719.40	4.80
24	000672	上峰水泥	8,625,588.10	4.77
25	603259	药明康德	8,220,661.00	4.54
26	000739	普洛药业	8,085,080.64	4.47
27	600377	宁沪高速	7,838,339.65	4.33
28	603605	珀莱雅	7,600,129.62	4.20
29	000661	长春高新	7,358,671.24	4.07
30	002938	鹏鼎控股	7,226,293.46	3.99
31	600547	山东黄金	7,172,903.94	3.96
32	600845	宝信软件	6,903,803.00	3.81
33	601398	工商银行	6,601,226.00	3.65
34	601009	南京银行	6,415,012.00	3.54
35	601688	华泰证券	6,263,115.70	3.46
36	002709	天赐材料	6,256,424.00	3.46
37	000963	华东医药	6,221,999.00	3.44
38	000429	粤高速 A	6,105,551.00	3.37
39	601128	常熟银行	6,057,164.32	3.35
40	300525	博思软件	5,809,198.20	3.21
41	002422	科伦药业	5,717,944.05	3.16
42	300036	超图软件	5,694,944.76	3.15
43	600438	通威股份	5,645,743.17	3.12
44	603369	今世缘	5,517,946.54	3.05
45	002202	金风科技	5,131,265.48	2.84
46	601229	上海银行	4,973,634.00	2.75
47	600745	闻泰科技	4,895,752.00	2.70
48	000725	京东方 A	4,834,590.00	2.67

49	000796	凯撒旅游	4,812,015.00	2.66
50	300365	恒华科技	4,483,059.51	2.48
51	300481	濮阳惠成	4,402,122.00	2.43
52	300433	蓝思科技	4,388,937.02	2.42
53	601231	环旭电子	4,331,700.00	2.39
54	601336	新华保险	4,158,175.00	2.30
55	601900	南方传媒	4,157,876.38	2.30
56	002044	美年健康	4,038,786.60	2.23
57	002557	洽洽食品	4,020,892.40	2.22
58	002080	中材科技	4,019,982.52	2.22
59	601100	恒立液压	3,956,241.00	2.19
60	600489	中金黄金	3,912,594.65	2.16
61	600763	通策医疗	3,815,670.00	2.11
62	601949	中国出版	3,745,505.00	2.07
63	603305	旭升股份	3,741,365.40	2.07
64	600297	广汇汽车	3,674,642.00	2.03

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	300383	光环新网	20,544,340.44	11.35
2	600030	中信证券	15,478,479.54	8.55
3	601688	华泰证券	14,086,440.75	7.78
4	000977	浪潮信息	12,797,768.30	7.07
5	002475	立讯精密	12,531,334.28	6.92
6	603636	南威软件	12,474,903.99	6.89
7	603666	亿嘉和	12,120,973.24	6.70
8	600406	国电南瑞	12,072,134.00	6.67
9	002821	凯莱英	11,751,717.00	6.49
10	603708	家家悦	11,135,564.40	6.15
11	000672	上峰水泥	10,298,084.13	5.69
12	002008	大族激光	10,055,039.65	5.56
13	300014	亿纬锂能	9,833,264.63	5.43
14	601318	中国平安	9,725,874.00	5.37
15	600036	招商银行	9,717,416.54	5.37
16	603605	珀莱雅	9,695,267.43	5.36
17	600519	贵州茅台	8,370,295.78	4.62
18	601888	中国国旅	8,313,679.34	4.59
19	603338	浙江鼎力	8,066,370.66	4.46

20	002127	南极电商	8,053,460.14	4.45
21	603218	日月股份	7,936,479.06	4.38
22	600845	宝信软件	7,836,262.00	4.33
23	600377	宁沪高速	7,674,621.00	4.24
24	600025	华能水电	7,651,171.88	4.23
25	300525	博思软件	7,634,478.98	4.22
26	000001	平安银行	7,590,582.51	4.19
27	603369	今世缘	7,515,357.80	4.15
28	002202	金风科技	7,511,559.36	4.15
29	000963	华东医药	7,258,668.87	4.01
30	600547	山东黄金	7,226,000.17	3.99
31	002938	鹏鼎控股	7,010,033.96	3.87
32	000429	粤高速 A	6,519,325.35	3.60
33	000739	普洛药业	6,439,476.00	3.56
34	300357	我武生物	6,435,750.60	3.56
35	002709	天赐材料	6,378,447.39	3.52
36	300059	东方财富	6,336,921.77	3.50
37	601009	南京银行	6,077,927.03	3.36
38	600745	闻泰科技	6,046,549.21	3.34
39	600009	上海机场	5,944,676.31	3.28
40	300036	超图软件	5,881,425.23	3.25
41	600837	海通证券	5,549,458.53	3.07
42	300481	濮阳惠成	5,532,688.76	3.06
43	000796	凯撒旅游	5,456,204.64	3.01
44	600801	华新水泥	5,357,060.75	2.96
45	601128	常熟银行	5,327,015.00	2.94
46	601229	上海银行	5,031,929.80	2.78
47	300129	泰胜风能	5,010,114.17	2.77
48	000725	京东方 A	4,972,957.00	2.75
49	601231	环旭电子	4,956,221.00	2.74
50	002714	牧原股份	4,741,309.00	2.62
51	000858	五粮液	4,726,692.78	2.61
52	601900	南方传媒	4,528,439.20	2.50
53	002557	洽洽食品	4,463,244.00	2.47
54	002120	韵达股份	4,308,594.57	2.38
55	002157	正邦科技	4,287,540.00	2.37
56	600438	通威股份	4,268,184.00	2.36
57	600339	中油工程	4,247,105.81	2.35
58	000063	中兴通讯	4,207,683.60	2.32
59	300144	宋城演艺	3,974,063.98	2.20
60	601100	恒立液压	3,956,186.94	2.19
61	300365	恒华科技	3,955,544.50	2.19
62	600489	中金黄金	3,923,484.00	2.17
63	000726	鲁泰 A	3,888,130.79	2.15

64	603259	药明康德	3,806,094.74	2.10
65	300433	蓝思科技	3,751,012.00	2.07
66	002867	周大生	3,750,252.50	2.07
67	002044	美年健康	3,701,930.00	2.05

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	687,233,256.69
卖出股票的收入（成交）总额	678,353,595.32

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	-	-
	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）	9,549.44	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,549.44	0.00

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	128061	启明转债	86	9,549.44	0.00

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	106,605.05
2	应收证券清算款	1,616,325.71
3	应收股利	-
4	应收利息	6,487.52
5	应收申购款	169,175.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,898,593.78

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
9,476	14,294.46	433,373.97	0.32%	135,020,934.41	99.68%

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	301,816.23	0.22%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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（2010 年 5 月 11 日）基金份额总额	1,805,692,890.52
本报告期期初基金份额总额	155,224,517.32
本报告期基金总申购份额	24,853,634.14
减：本报告期基金总赎回份额	44,623,843.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	135,454,308.38

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：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	448,607,133.36	32.91%	408,817.07	32.54%	-
安信证券	1	247,995,155.74	18.19%	230,957.73	18.39%	-
长江证券	1	219,737,103.23	16.12%	200,246.41	15.94%	-
西南证券	1	210,160,642.16	15.42%	195,720.32	15.58%	-
国信证券	1	136,635,741.06	10.02%	127,248.74	10.13%	-
中泰证券	1	100,059,238.73	7.34%	93,185.12	7.42%	-

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，最大限度地调调整体资源，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 5 月完成租用托管在中国银行的招商证券上海 36598 交易单元

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	152,220.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日