

华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金
2019 年年度报告
2019 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年四月十一日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 7 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。

本报告期自 2019 年 7 月 26 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65

8.6	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	65
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
8.8	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	66
8.9	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	66
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末上市基金前十名持有人	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4	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	68
§10	开放式基金份额变动	68
§11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	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	69
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8	其他重大事件	71
12	影响投资者决策的其他重要信息	72
§13	备查文件目录	73
13.1	备查文件目录	73
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安中证民企成长 ETF
场内简称	民企成长
基金主代码	512790
交易代码	512790
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 7 月 26 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,984,642.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 9 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证民企成长指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型

	基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

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	海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	邓来承
	联系电话	021-38969999	021-23212375
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	dlc11913@htsec.com
客户服务电话		4008850099	95553
传真		021-68863414	021-63410637
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	上海市黄浦区广东路689号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	上海市黄浦区广东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		朱学华	周杰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼
--------	-------------------------	-------------------------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,130,950.65
本期利润	7,631,594.94
加权平均基金份额本期利润	0.0699
本期加权平均净值利润率	6.92%
本期基金份额净值增长率	6.36%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末
期末可供分配利润	762,316.65
期末可供分配基金份额利润	0.0636
期末基金资产净值	12,746,958.65
期末基金份额净值	1.0636
3.1.3 累计期末指标	2019 年末
基金份额累计净值增长率	6.36%

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.本基金于 2019 年 7 月 26 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

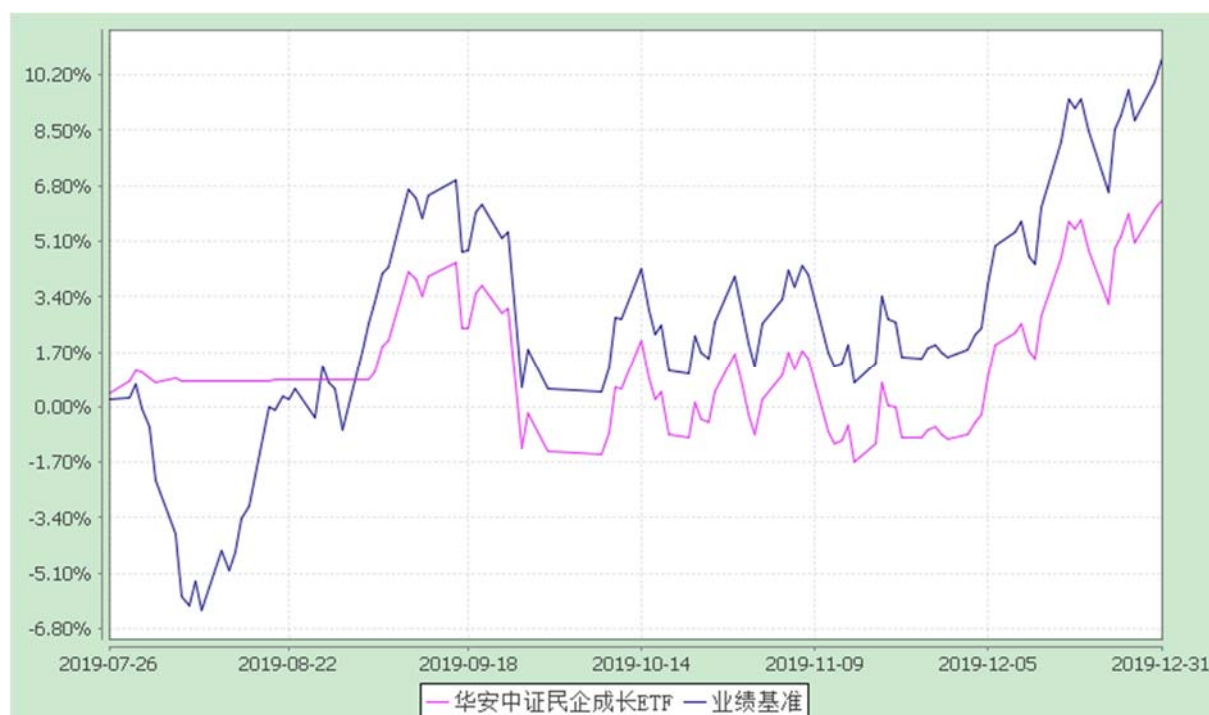
阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	7.86%	0.87%	10.15%	0.95%	-2.29%	-0.08%
自基金合同生 效起至今	6.36%	0.81%	10.74%	1.08%	-4.38%	-0.27%

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

华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额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
(2019年7月26日至2019年12月31日)

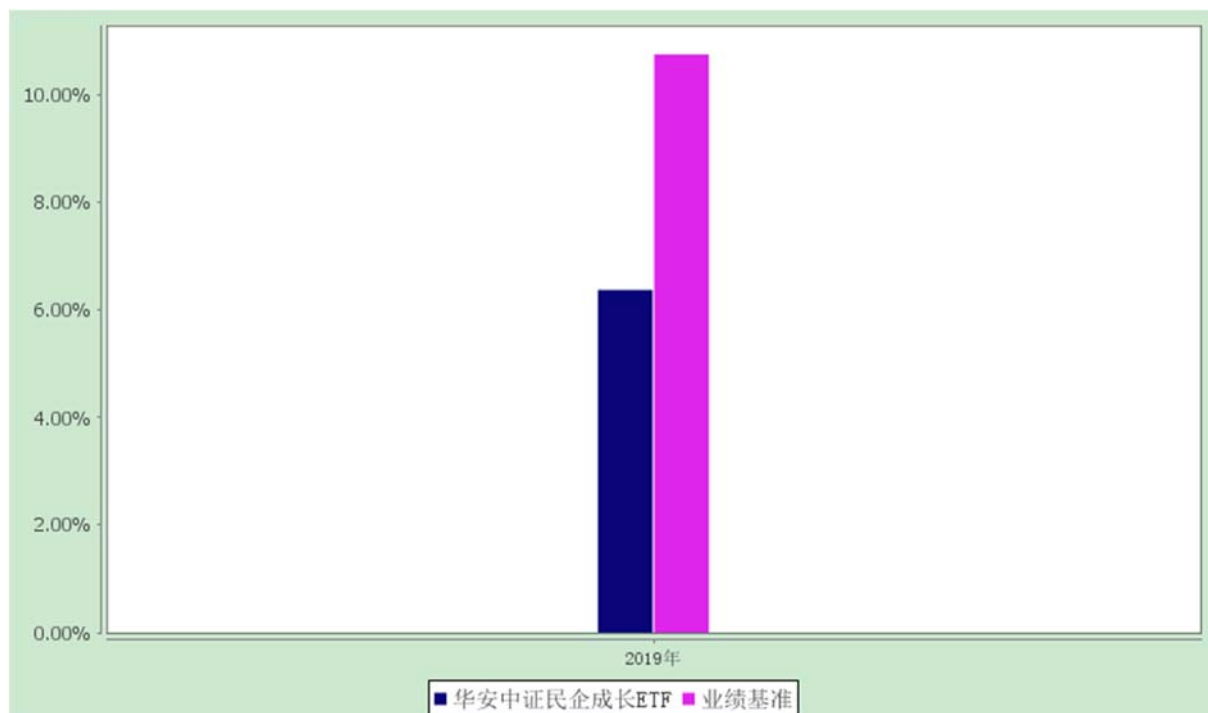


注：本基金于2019年7月26日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2019年7月26日）至本报告期末未发生利润分配。

§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、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12月31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129只开放式基金，管理资产规模达到3,516.57亿元人民币。

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		
苏卿云	指数与量化投资部助理总监、本基金的基金经理	2019-07-26	-	12 年	<p>硕士研究生，12 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 11 月，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任本基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月起，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安沪深 300 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起，同时担任本基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。</p>

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，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 1 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

民营经济是国民经济的重要组成部分，是推动社会发展的重要经济力量。民营经济贡献了 50% 以上的税收，60% 以上的国内生产总值，70% 以上的技术创新成果，80% 以上的城镇劳动就业，90% 以上的企业数量，成为创业就业的主要领域、技术创新的重要主体、国家税收的重要来源。2019 年，在国家政策的引导和支持下，民营企业融资问题得到缓解，上市公司质押率高的问题也得到部分解决，基本面有所好转。同时，在相对宽松的货币政策的影响下，成长性比较高的民营企业估值有所提升。

基金跟踪的指数是中证民企成长指数，该指数按照综合考虑民企的成长和估值等指标，从沪深两市选取了 300 家有代表性的民营上市公司组成，以反映 A 股市场具有竞争力的民营上市公司的整体表现。从行业上看，该指数主要集中于生物医药、计算机、电子、通信等高科技行业，以及电气设备、机械制造等先进制造业，代表了我国经济发展的未来方向。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0636 元，本报告期份额净值增长率为 6.36%，同

期业绩比较基准增长率为 10.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，积极的财政政策，如减税降费政策，和逆周期的货币宽松政策，有望改善民营企业的经营状况和盈利情。随着经济的企稳和市场的好转，民营上市公司的高质押率问题得到逐步的缓解，配合着国家的定向融资政策的实施，民营企业将迎来逐步好转的政策环境和金融环境，民营企业的活力将会继续得到发挥。因此，未来可关注行业发展前景好、竞争力强、成长性好的民企龙头公司。为了个股规避风险，通过投资中证民企成长指数是一个简单高效的投资方式。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法规要求，督促各项工作稳妥、有序开展。

(3) 强化内控建设，推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

§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，海通证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 23302 号

华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华安中证民企成长 ETF”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了华安中证民企成长 ETF 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安中证民企成长 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华安中证民企成长 ETF 的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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

制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安中证民企成长 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安中证民企成长 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安中证民企成长 ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华安中证民企成长 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安中证民企成长 ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

单峰 楼茜蓉

上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2020 年 4 月 7 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	2,270,759.53
结算备付金		27,249.92
存出保证金		461,943.03
交易性金融资产	7.4.7.2	11,630,732.85
其中：股票投资		11,593,632.85
基金投资		-
债券投资		37,100.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		29,225.74
应收利息	7.4.7.5	949.04
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		14,420,860.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		953,151.24
应付赎回款		-
应付管理人报酬		8,129.55
应付托管费		1,625.91
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	449,207.73
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	261,787.03
负债合计		1,673,901.46
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	11,984,642.00
未分配利润	7.4.7.10	762,316.65
所有者权益合计		12,746,958.65
负债和所有者权益总计		14,420,860.11

注：1.报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0636 元，基金份额总额 11,984,642.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		9,000,060.90
1.利息收入		579,006.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	439,221.12
债券利息收入		24.41
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		139,760.64
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,104,151.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,077,501.41
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	5,873.95
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	20,776.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	500,644.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	816,258.92
减：二、费用		1,368,465.96
1. 管理人报酬		232,652.29
2. 托管费		46,530.46

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	849,575.12
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.10
7. 其他费用	7.4.7.19	239,707.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,631,594.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,631,594.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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）	265,484,642.00	-	265,484,642.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,631,594.94	7,631,594.94
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）	-253,500,000.00	-6,869,278.29	-260,369,278.29
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-253,500,000.00	-6,869,278.29	-260,369,278.29
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）	11,984,642.00	762,316.65	12,746,958.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]512 号《关于准予华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 265,484,642.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0414 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 265,484,642.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]183 号核准，本基金 265,484,642.00 份基金份额于 2019 年 9 月 6 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为中证民企成长指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；投资范围为标的指数中证民企成长指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具

(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金财产的 80%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证民企成长指数收益率。

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 2020 年 4 月 7 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、

可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充

足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债

券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019 年 12 月 31 日
活期存款	2,270,759.53
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	2,270,759.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,092,988.56	11,593,632.85	500,644.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	37,100.00	37,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	37,100.00	37,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,130,088.56	11,630,732.85	500,644.29

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	724.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12.20
应收债券利息	4.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	207.90
合计	949.04

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	449,207.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	449,207.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	102,000.00
指数使用费	50,000.00
可退替代款	1,689.70
应付替代款	108,097.33
合计	261,787.03

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	265,484,642.00	265,484,642.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-253,500,000.00	-253,500,000.00
本期末	11,984,642.00	11,984,642.00

注：1. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

2. 本基金自 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 7 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 265,484,642.00 元，折合为 265,484,642.00 份基金份额，本基金设立募集期内无认购资金产生的利息收入。

3. 根据《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金于 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 9 月 5 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务及赎回业务自 2019 年 9 月 6 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	7,130,950.65	500,644.29	7,631,594.94
本期基金份额交易产生的变动数	-6,357,269.90	-512,008.39	-6,869,278.29
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-6,357,269.90	-512,008.39	-6,869,278.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	773,680.75	-11,364.10	762,316.65

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	432,767.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,519.74
其他	1,934.15
合计	439,221.12

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 7 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,216,163.58
股票投资收益——赎回差价收入	861,337.83
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	7,077,501.41

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	344,544,017.84
减：卖出股票成本总额	338,327,854.26
买卖股票差价收入	6,216,163.58

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	260,369,278.29
减：现金支付赎回款总额	183,284,390.29
减：赎回股票成本总额	76,223,550.17
赎回差价收入	861,337.83

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,873.95
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,873.95

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	76,394.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,500.00
减：应收利息总额	20.82
买卖债券差价收入	5,873.95

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	20,776.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,776.16

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1.交易性金融资产	500,644.29
——股票投资	500,644.29
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	500,644.29

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	816,258.92
合计	816,258.92

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	849,575.12
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	849,575.12

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	52,000.00
信息披露费	50,000.00
指数使用费	86,413.04
银行汇划费	894.95
上市费	50,000.00
其他费用	400.00
合计	239,707.99

注：根据《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及《中证指数使用许可协议》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支。指数许可使用费按前一日的基金资产净值

的 0.03% 的年费率计提，收取下限为每季 5 万元。逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 4 月 7 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	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、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2019年7月26日(基金合同生效日)至2019年12月31日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	629,013,768.83	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	76,394.77	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	180,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31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
海通证券	449,207.73	100.00%	449,207.73	100.00%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	232,652.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	46,530.46

注：支付基金托管人海通证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	2,000.00	0.02%
海通证券股份有限公司	5,187.00	0.04%

7.4.10.5 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7月26日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
海通证券	2,270,759.53	432,767.23

注：本基金的银行存款由基金托管人海通证券保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110063	鹰 19 转债	2019-12-13	2020-01-03	新债未上市	100.00	100.00	110.00	11,000.00	11,000.00	-
113553	金牌转债	2019-12-13	2020-01-07	新债未上市	100.00	100.00	20.00	2,000.00	2,000.00	-
123039	开润转债	2019-12-26	2020-01-23	新债未上市	100.00	100.00	4.00	400.00	400.00	-

128086	国轩转债	2019-12-17	2020-01-10	新债未上市	100.00	100.00	126.00	12,600.00	12,600.00	-
128087	孚日转债	2019-12-17	2020-01-16	新债未上市	100.00	100.00	52.00	5,200.00	5,200.00	-
128089	麦米转债	2019-12-26	2020-01-20	新债未上市	100.00	100.00	29.00	2,900.00	2,900.00	-
128090	汽模转2	2019-12-27	2020-01-23	新债未上市	100.00	100.00	30.00	3,000.00	3,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002115	三维通信	2019-12-19	重大事项	8.89	2020-01-03	9.08	4,900.00	41,373.62	43,561.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法

规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具,通过特定的风险量化指标、模型,形成常规的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净值的 0.29%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.63%。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、清算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,270,759.53	-	-	-	2,270,759.53
结算备付金	27,249.92	-	-	-	27,249.92
存出保证金	461,943.03	-	-	-	461,943.03
交易性金融资产	-	-	37,100.00	11,593,632.85	11,630,732.85
应收证券清算款	-	-	-	29,225.74	29,225.74
应收利息	-	-	-	949.04	949.04
资产总计	2,759,952.48	-	37,100.00	11,623,807.63	14,420,860.11
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	-	-	-	953,151.24	953,151.24
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,129.55	8,129.55
应付托管费	-	-	-	1,625.91	1,625.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	449,207.73	449,207.73
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	261,787.03	261,787.03
负债总计	-	-	-	1,673,901.46	1,673,901.46
利率敏感度缺口	2,759,952.48	-	37,100.00	9,949,906.17	12,746,958.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.29%,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。根据标的指数,结合研究报告,基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不得低于非现金基金财产的 80%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	11,593,632.85	90.95
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	11,593,632.85	90.95

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上述基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 390,000.00
	业绩比较基准减少 5%	减少约 390,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2019 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间, 本基金申购基金份额的对价总额为 0.00 元。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 11,550,071.85 元, 属于第二层次的余额为 80,661.00 元, 无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除公允价值和基金申购款外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	11,593,632.85	80.39
	其中:股票	11,593,632.85	80.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,100.00	0.26
	其中:债券	37,100.00	0.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,298,009.45	15.94

8	其他各项资产	492,117.81	3.41
9	合计	14,420,860.11	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	143,629.00	1.13
C	制造业	8,113,155.85	63.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,340.00	1.03
E	建筑业	255,157.00	2.00
F	批发和零售业	589,427.00	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	21,924.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	909,893.00	7.14
J	金融业	68,160.00	0.53
K	房地产业	776,132.00	6.09
L	租赁和商务服务业	142,218.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	133,110.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	122,507.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	53,112.00	0.42
R	文化、体育和娱乐业	22,140.00	0.17
S	综合	111,616.00	0.88
	合计	11,593,520.85	90.95

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601012	隆基股份	19,100	474,253.00	3.72
2	600340	华夏幸福	8,500	243,950.00	1.91
3	002384	东山精密	7,900	182,885.00	1.43
4	600438	通威股份	13,800	181,194.00	1.42
5	002050	三花智控	9,900	171,567.00	1.35
6	002271	东方雨虹	6,200	163,122.00	1.28
7	300014	亿纬锂能	3,200	160,512.00	1.26
8	300383	光环新网	7,800	156,546.00	1.23
9	000963	华东医药	6,400	156,032.00	1.22
10	300207	欣旺达	7,900	154,208.00	1.21
11	300122	智飞生物	3,100	153,946.00	1.21
12	600487	亨通光电	9,400	152,844.00	1.20
13	002422	科伦药业	6,300	147,987.00	1.16
14	002340	格林美	29,600	144,152.00	1.13
15	000961	中南建设	13,200	139,260.00	1.09
16	600066	宇通客车	9,400	133,950.00	1.05
17	600208	新潮中宝	30,900	116,802.00	0.92
18	000656	金科股份	15,100	115,968.00	0.91
19	300271	华宇软件	4,500	114,300.00	0.90
20	600673	东阳光	10,900	111,616.00	0.88
21	600885	宏发股份	3,200	110,240.00	0.86
22	002078	太阳纸业	11,100	109,224.00	0.86
23	600535	天士力	6,400	98,688.00	0.77
24	300296	利亚德	12,800	98,176.00	0.77
25	600256	广汇能源	29,400	97,314.00	0.76
26	002373	千方科技	5,300	95,612.00	0.75
27	600699	均胜电子	5,300	94,870.00	0.74
28	600143	金发科技	13,000	94,640.00	0.74
29	002174	游族网络	3,700	86,099.00	0.68
30	000997	新大陆	5,200	82,576.00	0.65
31	000723	美锦能源	8,700	82,041.00	0.64
32	002223	鱼跃医疗	4,000	81,280.00	0.64

33	300058	蓝色光标	14,300	80,795.00	0.63
34	600466	蓝光发展	10,900	80,333.00	0.63
35	002074	国轩高科	5,500	80,025.00	0.63
36	300166	东方国信	6,000	78,000.00	0.61
37	002563	森马服饰	7,800	76,986.00	0.60
38	600297	广汇汽车	23,600	76,936.00	0.60
39	601216	君正集团	24,300	76,059.00	0.60
40	300274	阳光电源	7,200	75,816.00	0.59
41	002191	劲嘉股份	6,500	74,165.00	0.58
42	600380	健康元	7,000	72,450.00	0.57
43	600398	海澜之家	9,300	71,424.00	0.56
44	600811	东方集团	21,100	70,896.00	0.56
45	600873	梅花生物	15,500	68,975.00	0.54
46	600643	爱建集团	7,100	68,160.00	0.53
47	002036	联创电子	3,800	64,638.00	0.51
48	002557	洽洽食品	1,900	64,543.00	0.51
49	002675	东诚药业	4,000	64,440.00	0.51
50	002221	东华能源	8,300	64,408.00	0.51
51	601636	旗滨集团	11,600	63,684.00	0.50
52	600167	联美控股	4,700	61,852.00	0.49
53	300339	润和软件	4,400	61,028.00	0.48
54	601058	赛轮轮胎	13,600	60,792.00	0.48
55	002648	卫星石化	3,700	60,495.00	0.47
56	300118	东方日升	4,300	59,555.00	0.47
57	002402	和而泰	4,500	58,185.00	0.46
58	002317	众生药业	4,500	57,150.00	0.45
59	002372	伟星新材	4,300	56,631.00	0.44
60	002583	海能达	6,500	54,665.00	0.43
61	300457	赢合科技	1,600	54,320.00	0.43
62	300476	胜宏科技	3,300	53,823.00	0.42
63	300244	迪安诊断	2,400	53,112.00	0.42
64	002242	九阳股份	2,100	52,836.00	0.41
65	600388	龙净环保	5,400	52,650.00	0.41
66	600490	鹏欣资源	11,000	51,150.00	0.40
67	002099	海翔药业	7,100	50,552.00	0.40
68	603816	顾家家居	1,100	50,303.00	0.39
69	000672	上峰水泥	2,700	49,383.00	0.39
70	300567	精测电子	900	49,356.00	0.39
71	300463	迈克生物	1,800	48,546.00	0.38
72	002925	盈趣科技	1,100	48,345.00	0.38
73	600491	龙元建设	6,500	47,515.00	0.37
74	600803	新奥股份	4,200	44,688.00	0.35
75	002115	三维通信	4,900	43,561.00	0.34
76	002831	裕同科技	1,600	42,480.00	0.33

77	000732	泰禾集团	6,900	42,435.00	0.33
78	600771	广誉远	2,500	42,400.00	0.33
79	002727	一心堂	1,800	41,868.00	0.33
80	002020	京新药业	3,800	40,812.00	0.32
81	002276	万马股份	4,900	40,719.00	0.32
82	002262	恩华药业	3,400	39,542.00	0.31
83	002531	天顺风能	6,200	39,184.00	0.31
84	002203	海亮股份	3,800	38,950.00	0.31
85	300232	洲明科技	3,900	38,649.00	0.30
86	002603	以岭药业	3,100	38,533.00	0.30
87	000603	盛达资源	2,500	37,475.00	0.29
88	002851	麦格米特	1,800	37,296.00	0.29
89	300203	聚光科技	2,215	37,012.65	0.29
90	603368	柳药股份	1,100	37,004.00	0.29
91	002161	远望谷	3,900	36,972.00	0.29
92	000902	新洋丰	4,600	36,340.00	0.29
93	002705	新宝股份	2,200	36,278.00	0.28
94	300284	苏交科	4,400	35,948.00	0.28
95	002649	博彦科技	3,600	35,712.00	0.28
96	002626	金达威	1,800	35,100.00	0.28
97	002434	万里扬	3,700	35,076.00	0.28
98	600993	马应龙	2,000	34,980.00	0.27
99	002171	楚江新材	4,700	34,827.00	0.27
100	000810	创维数字	2,900	34,771.00	0.27
101	002145	中核钛白	7,800	34,086.00	0.27
102	300185	通裕重工	18,800	33,652.00	0.26
103	300568	星源材质	1,100	33,231.00	0.26
104	300596	利安隆	900	33,039.00	0.26
105	002706	良信电器	3,900	32,760.00	0.26
106	002375	亚厦股份	5,600	32,480.00	0.25
107	603737	三棵树	400	32,260.00	0.25
108	000910	大亚圣象	2,300	32,177.00	0.25
109	002318	久立特材	3,400	31,892.00	0.25
110	002251	步步高	3,500	31,850.00	0.25
111	002139	拓邦股份	5,700	31,692.00	0.25
112	600285	羚锐制药	3,200	31,680.00	0.25
113	300459	金科文化	9,900	31,581.00	0.25
114	300664	鹏鹞环保	2,400	31,104.00	0.24
115	601828	美凯龙	2,700	30,591.00	0.24
116	002083	孚日股份	4,900	30,478.00	0.24
117	002382	蓝帆医疗	2,500	30,350.00	0.24
118	300137	先河环保	3,900	29,952.00	0.23
119	600496	精工钢构	10,300	29,767.00	0.23
120	002303	美盈森	5,600	29,736.00	0.23

121	300401	花园生物	2,380	29,631.00	0.23
122	002182	云海金属	3,200	29,600.00	0.23
123	002867	周大生	1,500	28,560.00	0.22
124	603606	东方电缆	2,600	28,548.00	0.22
125	601311	骆驼股份	3,000	28,140.00	0.22
126	002045	国光电器	2,300	28,037.00	0.22
127	002043	兔宝宝	3,800	27,930.00	0.22
128	603393	新天然气	1,000	27,790.00	0.22
129	300043	星辉娱乐	5,400	27,702.00	0.22
130	601137	博威合金	2,400	27,024.00	0.21
131	300031	宝通科技	1,800	27,000.00	0.21
132	300298	三诺生物	1,800	26,982.00	0.21
133	002822	中装建设	2,700	26,703.00	0.21
134	600477	杭萧钢构	9,400	26,508.00	0.21
135	001696	宗申动力	4,500	26,190.00	0.21
136	603113	金能科技	2,400	25,896.00	0.20
137	603588	高能环境	2,700	25,650.00	0.20
138	002215	诺普信	3,800	25,308.00	0.20
139	002605	姚记科技	1,300	25,285.00	0.20
140	300035	中科电气	3,200	25,184.00	0.20
141	603686	龙马环卫	2,300	25,116.00	0.20
142	002737	葵花药业	1,700	25,092.00	0.20
143	002274	华昌化工	3,900	25,077.00	0.20
144	002545	东方铁塔	3,300	24,915.00	0.20
145	002510	天汽模	5,300	24,751.00	0.19
146	601886	江河集团	3,400	24,684.00	0.19
147	002298	中电兴发	3,200	24,192.00	0.19
148	002226	江南化工	4,300	23,564.00	0.18
149	002398	垒知集团	3,900	23,556.00	0.18
150	002768	国恩股份	1,000	23,290.00	0.18
151	002206	海利得	6,200	23,250.00	0.18
152	002392	北京利尔	5,900	22,715.00	0.18
153	002526	山东矿机	10,000	22,600.00	0.18
154	300016	北陆药业	2,500	22,475.00	0.18
155	000620	新华联	5,500	22,275.00	0.17
156	600351	亚宝药业	3,800	22,154.00	0.17
157	600136	当代明诚	1,800	22,140.00	0.17
158	603197	保隆科技	700	22,071.00	0.17
159	300132	青松股份	2,000	22,060.00	0.17
160	002928	华夏航空	1,800	21,924.00	0.17
161	300570	太辰光	800	21,784.00	0.17
162	300481	濮阳惠成	1,200	21,516.00	0.17
163	600090	同济堂	5,100	21,318.00	0.17
164	603609	禾丰牧业	1,800	21,294.00	0.17

165	300448	浩云科技	2,800	21,280.00	0.17
166	002664	长鹰信质	1,300	21,242.00	0.17
167	300465	高伟达	2,100	21,189.00	0.17
168	603313	梦百合	1,000	21,110.00	0.17
169	603360	百傲化学	600	20,982.00	0.16
170	300190	维尔利	3,000	20,610.00	0.16
171	300057	万顺新材	3,400	20,536.00	0.16
172	300559	佳发教育	700	20,510.00	0.16
173	002055	得润电子	1,900	20,406.00	0.16
174	600220	江苏阳光	8,900	20,292.00	0.16
175	002539	云图控股	4,100	20,131.00	0.16
176	300422	博世科	1,900	19,874.00	0.16
177	002756	永兴材料	1,100	19,745.00	0.15
178	300506	名家汇	2,300	19,711.00	0.15
179	300415	伊之密	2,000	19,620.00	0.15
180	600439	瑞贝卡	5,400	19,386.00	0.15
181	300607	拓斯达	400	19,120.00	0.15
182	002090	金智科技	1,800	19,098.00	0.15
183	603458	勘设股份	1,000	19,090.00	0.15
184	002614	奥佳华	1,800	19,044.00	0.15
185	603688	石英股份	1,000	18,800.00	0.15
186	002029	七匹狼	3,200	18,720.00	0.15
187	603300	华铁应急	2,400	18,672.00	0.15
188	002738	中矿资源	1,100	18,546.00	0.15
189	300255	常山药业	3,400	18,496.00	0.15
190	000525	红太阳	1,900	18,468.00	0.14
191	002726	龙大肉食	2,600	18,200.00	0.14
192	300420	五洋停车	3,300	18,117.00	0.14
193	002840	华统股份	1,100	17,930.00	0.14
194	300388	国祯环保	1,700	17,901.00	0.14
195	002412	汉森制药	2,000	17,540.00	0.14
196	000639	西王食品	3,800	17,214.00	0.14
197	300067	安诺其	4,000	17,200.00	0.13
198	002361	神剑股份	3,900	17,043.00	0.13
199	300213	佳讯飞鸿	2,600	17,004.00	0.13
200	300497	富祥股份	900	16,983.00	0.13
200	002433	太安堂	3,700	16,983.00	0.13
202	000407	胜利股份	4,700	16,732.00	0.13
203	002579	中京电子	1,200	16,704.00	0.13
204	601599	鹿港文化	5,000	16,600.00	0.13
205	002616	长青集团	2,000	16,360.00	0.13
206	002879	长缆科技	1,000	16,220.00	0.13
207	603387	基蛋生物	700	16,135.00	0.13
208	300384	三联虹普	900	16,110.00	0.13

209	002381	双箭股份	1,900	16,093.00	0.13
210	300393	中来股份	1,100	15,939.00	0.13
211	002688	金河生物	2,500	15,725.00	0.12
212	002472	双环传动	2,800	15,680.00	0.12
213	002406	远东传动	2,600	15,626.00	0.12
214	300248	新开普	1,900	15,599.00	0.12
215	002810	山东赫达	800	15,520.00	0.12
216	002632	道明光学	2,100	15,519.00	0.12
217	603936	博敏电子	900	15,471.00	0.12
218	300304	云意电气	3,500	15,400.00	0.12
219	300472	新元科技	1,120	15,299.20	0.12
220	002775	文科园林	2,600	15,210.00	0.12
221	603716	塞力斯	900	15,201.00	0.12
222	600173	卧龙地产	2,900	15,109.00	0.12
223	002661	克明面业	1,300	14,807.00	0.12
224	002328	新朋股份	3,700	14,726.00	0.12
225	300332	天壕环境	3,600	14,652.00	0.11
226	603919	金徽酒	800	14,168.00	0.11
227	002929	润建股份	500	13,850.00	0.11
228	002734	利民股份	1,000	13,840.00	0.11
229	300637	扬帆新材	1,100	13,761.00	0.11
230	300206	理邦仪器	1,900	13,718.00	0.11
231	300396	迪瑞医疗	800	13,544.00	0.11
232	603180	金牌厨柜	200	13,356.00	0.10
233	002776	柏堡龙	1,700	13,090.00	0.10
234	603035	常熟汽饰	1,000	13,000.00	0.10
235	603987	康德莱	1,600	12,992.00	0.10
236	000700	模塑科技	3,300	12,969.00	0.10
237	603997	继峰股份	1,600	12,928.00	0.10
238	603030	全筑股份	2,200	12,694.00	0.10
239	300112	万讯自控	1,300	12,324.00	0.10
240	603117	万林物流	3,200	12,160.00	0.10
241	300179	四方达	2,000	12,000.00	0.09
242	603839	安正时尚	900	11,790.00	0.09
243	600295	鄂尔多斯	1,300	11,726.00	0.09
244	603890	春秋电子	1,100	11,616.00	0.09
245	300677	英科医疗	700	11,613.00	0.09
246	002908	德生科技	900	11,556.00	0.09
247	002532	新界泵业	1,900	11,457.00	0.09
248	002895	川恒股份	900	11,142.00	0.09
249	002722	金轮股份	700	10,955.00	0.09
250	002900	哈三联	900	10,746.00	0.08
251	300108	吉药控股	2,700	10,638.00	0.08
252	300577	开润股份	300	10,560.00	0.08

253	002457	青龙管业	1,300	10,543.00	0.08
254	600738	兰州民百	2,100	10,374.00	0.08
255	601619	嘉泽新能	2,700	10,314.00	0.08
256	300587	天铁股份	600	9,516.00	0.07
257	603258	电魂网络	400	9,392.00	0.07
258	002645	华宏科技	1,100	9,328.00	0.07
259	300543	朗科智能	400	9,276.00	0.07
260	300272	开能健康	1,900	9,272.00	0.07
261	300403	汉宇集团	1,800	9,216.00	0.07
262	603557	起步股份	1,100	9,097.00	0.07
263	603045	福达合金	600	9,000.00	0.07
264	300164	通源石油	1,700	8,840.00	0.07
265	300430	诚益通	1,100	8,723.00	0.07
266	002837	英维克	500	8,580.00	0.07
267	300586	美联新材	400	8,500.00	0.07
268	300385	雪浪环境	700	8,477.00	0.07
269	603843	正平股份	1,800	8,424.00	0.07
270	300575	中旗股份	300	8,295.00	0.07
271	002789	建艺集团	500	8,275.00	0.06
272	603081	大丰实业	500	8,155.00	0.06
273	600735	新华锦	1,200	7,968.00	0.06
274	002833	弘亚数控	200	7,954.00	0.06
275	300490	华自科技	700	7,756.00	0.06
276	300687	赛意信息	500	7,750.00	0.06
277	603278	大业股份	800	7,704.00	0.06
278	002549	凯美特气	1,200	7,368.00	0.06
279	603309	维力医疗	500	7,330.00	0.06
280	603966	法兰泰克	700	7,224.00	0.06
281	002193	如意集团	900	7,074.00	0.06
282	002923	润都股份	400	6,964.00	0.05
283	603909	合诚股份	500	6,770.00	0.05
284	002757	南兴股份	400	6,724.00	0.05
285	002863	今飞凯达	1,200	6,696.00	0.05
286	603058	永吉股份	900	6,678.00	0.05
287	603800	道森股份	500	6,585.00	0.05
288	002877	智能自控	700	5,999.00	0.05
289	603988	中电电机	600	5,796.00	0.05
290	300708	聚灿光电	400	5,384.00	0.04
291	603006	黎明股份	400	4,400.00	0.03
292	002933	新兴装备	100	3,900.00	0.03
293	002846	英联股份	200	3,760.00	0.03
294	300749	顶固集创	300	3,750.00	0.03
295	603016	新宏泰	200	3,380.00	0.03
296	002811	亚泰国际	200	3,186.00	0.02

297	300584	海辰药业	100	2,816.00	0.02
298	603266	天龙股份	200	2,302.00	0.02

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	14,437,564.53	113.26
2	002475	立讯精密	11,199,667.94	87.86
3	601012	隆基股份	10,440,973.92	81.91
4	600340	华夏幸福	6,718,997.00	52.71
5	000100	TCL 集团	4,975,419.00	39.03
6	600438	通威股份	4,106,084.00	32.21
7	300136	信维通信	3,754,989.00	29.46
8	000963	华东医药	3,608,487.55	28.31
9	002422	科伦药业	3,566,119.19	27.98
10	601155	新城控股	3,159,093.00	24.78
11	000413	东旭光电	3,033,562.00	23.80
12	300014	亿纬锂能	3,016,459.64	23.66
13	002384	东山精密	2,971,738.00	23.31
14	600487	亨通光电	2,806,611.00	22.02
15	002271	东方雨虹	2,757,173.00	21.63
16	000975	银泰黄金	2,704,460.00	21.22
17	002555	三七互娱	2,521,373.46	19.78
18	300383	光环新网	2,483,050.00	19.48
19	002050	三花智控	2,430,911.00	19.07
20	002340	格林美	2,266,591.00	17.78
21	300450	先导智能	2,229,556.48	17.49
22	600535	天士力	2,164,911.82	16.98
23	000656	金科股份	2,102,945.00	16.50
24	002273	水晶光电	2,068,467.88	16.23
25	300285	国瓷材料	2,028,307.30	15.91
26	000623	吉林敖东	2,016,237.00	15.82
27	002138	顺络电子	1,994,215.00	15.64
28	002223	鱼跃医疗	1,980,475.00	15.54
29	600256	广汇能源	1,963,926.00	15.41

30	000961	中南建设	1,957,614.00	15.36
31	000997	新大陆	1,897,097.03	14.88
32	002373	千方科技	1,859,370.00	14.59
33	000723	美锦能源	1,830,801.60	14.36
34	300274	阳光电源	1,824,427.48	14.31
35	300296	利亚德	1,755,359.00	13.77
36	600572	康恩贝	1,730,945.00	13.58
37	600673	东阳光	1,701,071.00	13.34
38	600699	均胜电子	1,683,232.80	13.20
39	300271	华宇软件	1,605,284.00	12.59
40	600143	金发科技	1,584,576.00	12.43
41	300207	欣旺达	1,559,395.00	12.23
42	603517	绝味食品	1,459,837.00	11.45
43	601216	君正集团	1,453,683.36	11.40
44	600811	东方集团	1,446,219.00	11.35
45	600885	宏发股份	1,440,883.00	11.30
46	300170	汉得信息	1,427,483.00	11.20
47	002074	国轩高科	1,421,443.00	11.15
48	300166	东方国信	1,413,235.00	11.09
49	002402	和而泰	1,409,839.45	11.06
50	002191	劲嘉股份	1,404,574.00	11.02
51	600873	梅花生物	1,397,816.00	10.97
52	300058	蓝色光标	1,391,357.00	10.92
53	002372	伟星新材	1,384,993.00	10.87
54	600567	山鹰纸业	1,383,198.00	10.85
55	603883	老百姓	1,313,019.00	10.30
56	002221	东华能源	1,312,420.00	10.30
57	600466	蓝光发展	1,310,494.00	10.28
58	600273	嘉化能源	1,309,486.00	10.27
59	600643	爱建集团	1,308,521.00	10.27
60	002563	森马服饰	1,305,485.00	10.24
61	300098	高新兴	1,298,727.00	10.19
62	002085	万丰奥威	1,258,421.00	9.87
63	002294	信立泰	1,233,560.40	9.68
64	600282	南钢股份	1,227,095.00	9.63
65	300339	润和软件	1,208,072.00	9.48
66	300244	迪安诊断	1,194,416.00	9.37
67	002020	京新药业	1,178,193.00	9.24
68	600388	龙净环保	1,168,722.67	9.17
69	300118	东方日升	1,166,923.00	9.15
70	002237	恒邦股份	1,144,224.00	8.98
71	002174	游族网络	1,139,310.85	8.94
72	601058	赛轮轮胎	1,138,928.60	8.93
73	600711	盛屯矿业	1,127,934.00	8.85

74	600803	新奥股份	1,126,373.00	8.84
75	002099	海翔药业	1,055,281.00	8.28
76	300476	胜宏科技	1,042,688.00	8.18
77	002035	华帝股份	1,031,919.82	8.10
78	300038	数知科技	1,031,549.00	8.09
79	002004	华邦健康	1,029,612.00	8.08
80	000902	新洋丰	1,000,926.00	7.85
81	002317	众生药业	994,419.00	7.80
82	002648	卫星石化	979,536.00	7.68
83	002436	兴森科技	971,556.65	7.62
84	002242	九阳股份	958,856.00	7.52
85	002203	海亮股份	952,628.00	7.47
86	002675	东诚药业	951,253.00	7.46
87	000732	泰禾集团	930,148.00	7.30
88	000603	盛达资源	927,395.00	7.28
89	600771	广誉远	927,149.00	7.27
90	002262	恩华药业	924,313.00	7.25
91	002727	一心堂	911,279.00	7.15
92	603368	柳药股份	899,563.00	7.06
93	600277	亿利洁能	883,755.00	6.93
94	601011	宝泰隆	883,426.00	6.93
95	002557	洽洽食品	883,090.00	6.93
96	002244	滨江集团	843,675.00	6.62
97	300284	苏交科	842,738.60	6.61
98	300463	迈克生物	839,707.00	6.59
99	601636	旗滨集团	837,230.34	6.57
100	603816	顾家家居	806,712.00	6.33
101	300482	万孚生物	799,237.40	6.27
102	600491	龙元建设	795,932.00	6.24
103	002867	周大生	782,226.00	6.14
104	002831	裕同科技	777,320.80	6.10
105	300203	聚光科技	777,058.00	6.10
106	300607	拓斯达	775,518.00	6.08
107	002126	银轮股份	773,593.45	6.07
108	000672	上峰水泥	730,110.63	5.73
109	600993	马应龙	706,581.00	5.54
110	300401	花园生物	695,845.00	5.46
111	300185	通裕重工	694,915.00	5.45
112	600337	美克家居	678,827.00	5.33
113	002182	云海金属	676,732.00	5.31
114	002139	拓邦股份	672,889.00	5.28
115	600363	联创光电	671,339.00	5.27
116	002649	博彦科技	668,910.18	5.25
117	300232	洲明科技	654,728.00	5.14

118	000818	航锦科技	645,647.00	5.07
119	300297	蓝盾股份	639,557.00	5.02
120	603606	东方电缆	635,092.15	4.98
121	603012	创力集团	616,688.00	4.84
122	300222	科大智能	612,686.00	4.81
123	601828	美凯龙	607,856.00	4.77
124	600285	羚锐制药	606,555.00	4.76
125	002717	岭南股份	601,262.00	4.72
126	603360	百傲化学	600,487.00	4.71
127	300047	天源迪科	599,687.00	4.70
128	603113	金能科技	588,028.00	4.61
129	603686	龙马环卫	585,913.00	4.60
130	300190	维尔利	582,206.00	4.57
131	002737	葵花药业	575,010.94	4.51
132	002171	楚江新材	573,563.96	4.50
133	300137	先河环保	572,436.00	4.49
134	002664	长鹰信质	571,385.00	4.48
135	601311	骆驼股份	570,675.00	4.48
136	300584	海辰药业	569,373.00	4.47
137	300570	太辰光	567,796.00	4.45
138	002745	木林森	564,361.00	4.43
139	002318	久立特材	564,314.00	4.43
140	002833	弘亚数控	562,638.00	4.41
141	002303	美盈森	559,146.00	4.39
142	001696	宗申动力	555,020.00	4.35
143	002119	康强电子	551,161.00	4.32
144	300303	聚飞光电	546,255.00	4.29
145	002083	孚日股份	546,143.00	4.28
146	300043	星辉娱乐	545,978.78	4.28
147	600477	杭萧钢构	545,323.00	4.28
148	300546	雄帝科技	544,828.50	4.27
149	000766	通化金马	544,767.00	4.27
150	600496	精工钢构	542,526.00	4.26
151	601886	江河集团	540,896.00	4.24
152	002626	金达威	536,064.00	4.21
153	002706	良信电器	535,411.00	4.20
154	002298	中电兴发	531,853.36	4.17
155	300349	金卡智能	531,251.00	4.17
156	603766	隆鑫通用	530,015.00	4.16
157	002301	齐心集团	523,299.50	4.11
158	000620	新华联	508,088.00	3.99
159	002933	新兴装备	508,019.00	3.99
160	603609	禾丰牧业	507,835.00	3.98
161	000810	创维数字	501,010.00	3.93

162	300016	北陆药业	499,040.00	3.91
163	002115	三维通信	487,734.40	3.83
164	002425	凯撒文化	485,059.00	3.81
165	002206	海利得	481,064.00	3.77
166	603936	博敏电子	478,357.00	3.75
167	002226	江南化工	474,398.00	3.72
168	002526	山东矿机	471,885.00	3.70
169	002215	诺普信	471,181.00	3.70
170	600136	当代明诚	462,561.00	3.63
171	300506	名家汇	461,334.00	3.62
172	600076	康欣新材	459,499.00	3.60
173	002661	克明面业	457,454.00	3.59
174	002545	东方铁塔	456,686.00	3.58
175	002614	奥佳华	449,251.00	3.52
176	002605	姚记科技	446,004.00	3.50
177	300298	三诺生物	438,754.00	3.44
178	600351	亚宝药业	435,432.00	3.42
179	002768	国恩股份	432,885.00	3.40
180	002334	英威腾	427,450.00	3.35
181	002029	七匹狼	425,422.00	3.34
182	002392	北京利尔	425,356.00	3.34
183	300420	五洋停车	421,787.00	3.31
184	603393	新天然气	419,375.20	3.29
185	000525	红太阳	417,823.00	3.28
186	600220	江苏阳光	416,953.00	3.27
187	002510	天汽模	416,653.00	3.27
188	300583	赛托生物	411,316.00	3.23
189	603699	纽威股份	407,829.00	3.20
190	601113	ST 华鼎	402,052.00	3.15
191	000639	西王食品	387,439.60	3.04
192	300138	晨光生物	387,351.00	3.04
193	300459	金科文化	386,225.72	3.03
194	300438	鹏辉能源	382,948.00	3.00
195	300213	佳讯飞鸿	382,385.50	3.00
196	002530	金财互联	380,199.00	2.98
197	000821	京山轻机	378,947.12	2.97
198	002540	亚太科技	377,558.00	2.96
199	002228	合兴包装	377,048.88	2.96
200	600053	九鼎投资	375,990.00	2.95
201	300057	万顺新材	372,948.44	2.93
202	300422	博世科	372,609.00	2.92
203	300132	青松股份	371,230.00	2.91
204	000510	新金路	370,324.00	2.91
205	002734	利民股份	369,272.00	2.90

206	300664	鹏鹞环保	364,132.00	2.86
207	603197	保隆科技	361,357.00	2.83
208	002837	英维克	359,269.00	2.82
209	002455	百川股份	354,825.00	2.78
210	300575	中旗股份	353,576.00	2.77
211	603458	勘设股份	347,753.60	2.73
212	002822	中装建设	344,737.00	2.70
213	000407	胜利股份	342,697.58	2.69
214	002245	澳洋顺昌	342,115.00	2.68
215	002539	云图控股	341,574.00	2.68
216	300388	国祯环保	340,646.00	2.67
217	601789	宁波建工	338,182.00	2.65
218	002923	润都股份	331,644.00	2.60
219	300465	高伟达	328,310.00	2.58
220	000889	中嘉博创	327,077.00	2.57
221	601015	陕西黑猫	320,950.00	2.52
222	300632	光莆股份	320,031.68	2.51
223	002840	华统股份	319,121.50	2.50
224	300497	富祥股份	318,066.00	2.50
225	002757	南兴股份	317,949.00	2.49
226	300067	安诺其	316,251.00	2.48
227	002738	中矿资源	310,449.00	2.44
228	002793	东音股份	307,116.00	2.41
229	300396	迪瑞医疗	304,065.00	2.39
230	002789	建艺集团	302,184.00	2.37
231	600295	鄂尔多斯	300,488.00	2.36
232	300481	濮阳惠成	300,437.00	2.36
233	300230	永利股份	298,566.00	2.34
234	300217	东方电热	298,090.00	2.34
235	300556	丝路视觉	297,955.00	2.34
236	300513	恒实科技	294,825.00	2.31
237	002788	鹭燕医药	293,217.00	2.30
238	603313	梦百合	291,350.40	2.29
239	300443	金雷股份	290,365.00	2.28
240	002472	双环传动	289,445.00	2.27
241	002381	双箭股份	289,257.00	2.27
242	300522	世名科技	285,945.00	2.24
243	300511	雪榕生物	283,552.00	2.22
244	603987	康德莱	282,771.60	2.22
245	002756	永兴材料	274,880.20	2.16
246	002772	众兴菌业	272,617.00	2.14
247	603919	金徽酒	272,128.00	2.13
248	603688	石英股份	271,088.00	2.13
249	300660	江苏雷利	270,917.80	2.13

250	300439	美康生物	269,986.00	2.12
251	002541	鸿路钢构	268,645.00	2.11
252	002802	洪汇新材	267,386.00	2.10
253	300687	赛意信息	266,781.00	2.09
254	300304	云意电气	264,609.00	2.08
255	002722	金轮股份	262,302.00	2.06
256	600173	卧龙地产	259,543.00	2.04
257	002658	雪迪龙	258,993.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002555	三七互娱	58,341,544.90	457.69
2	002083	孚日股份	38,703,762.12	303.63
3	002908	德生科技	30,567,478.00	239.80
4	300164	通源石油	18,924,978.00	148.47
5	000333	美的集团	14,399,041.98	112.96
6	002475	立讯精密	12,325,372.03	96.69
7	000100	TCL 集团	5,357,413.00	42.03
8	300136	信维通信	4,289,910.00	33.65
9	000963	华东医药	3,356,690.00	26.33
10	002422	科伦药业	3,309,203.00	25.96
11	000413	东旭光电	3,029,946.00	23.77
12	002384	东山精密	2,937,655.00	23.05
13	300014	亿纬锂能	2,779,179.00	21.80
14	002271	东方雨虹	2,648,918.00	20.78
15	002050	三花智控	2,474,325.20	19.41
16	300383	光环新网	2,446,769.00	19.19
17	300450	先导智能	2,394,110.43	18.78
18	000975	银泰黄金	2,386,071.00	18.72
19	002273	水晶光电	2,257,921.36	17.71
20	002340	格林美	2,112,360.00	16.57
21	002138	顺络电子	2,096,930.00	16.45
22	300285	国瓷材料	2,092,343.00	16.41
23	000623	吉林敖东	2,054,496.29	16.12
24	000656	金科股份	2,003,096.47	15.71
25	000961	中南建设	1,973,965.00	15.49
26	002223	鱼跃医疗	1,922,623.00	15.08

27	002373	千方科技	1,876,616.75	14.72
28	000997	新大陆	1,832,815.00	14.38
29	000723	美锦能源	1,776,427.00	13.94
30	300296	利亚德	1,742,928.00	13.67
31	300274	阳光电源	1,651,050.00	12.95
32	300271	华宇软件	1,597,355.00	12.53
33	300207	欣旺达	1,497,262.00	11.75
34	300058	蓝色光标	1,420,260.00	11.14
35	300166	东方国信	1,405,082.00	11.02
36	300170	汉得信息	1,397,848.00	10.97
37	002074	国轩高科	1,381,586.50	10.84
38	002372	伟星新材	1,341,791.00	10.53
39	002191	劲嘉股份	1,336,037.00	10.48
40	300098	高新兴	1,300,824.00	10.20
41	002085	万丰奥威	1,285,960.62	10.09
42	002221	东华能源	1,278,989.00	10.03
43	002402	和而泰	1,253,033.00	9.83
44	002563	森马服饰	1,210,204.00	9.49
45	300244	迪安诊断	1,205,146.43	9.45
46	002294	信立泰	1,204,200.00	9.45
47	300339	润和软件	1,200,473.56	9.42
48	002174	游族网络	1,131,007.00	8.87
49	300118	东方日升	1,104,398.00	8.66
50	002020	京新药业	1,089,415.00	8.55
51	002004	华邦健康	1,062,545.00	8.34
52	002237	恒邦股份	1,060,994.00	8.32
53	300038	数知科技	1,060,427.00	8.32
54	300476	胜宏科技	1,044,203.00	8.19
55	002035	华帝股份	1,029,230.00	8.07
56	002099	海翔药业	1,011,134.00	7.93
57	600803	新奥股份	1,009,445.00	7.92
58	002436	兴森科技	982,630.00	7.71
59	002648	卫星石化	959,420.00	7.53
60	002317	众生药业	919,553.00	7.21
61	002675	东诚药业	916,085.00	7.19
62	000902	新洋丰	907,976.00	7.12
63	002242	九阳股份	903,743.00	7.09
64	002557	洽洽食品	903,136.00	7.09
65	002203	海亮股份	891,770.00	7.00
66	000732	泰禾集团	875,203.00	6.87
67	300463	迈克生物	874,071.00	6.86
68	002244	滨江集团	873,693.00	6.85
69	002262	恩华药业	872,761.00	6.85
70	300482	万孚生物	860,578.80	6.75

71	002727	一心堂	856,070.00	6.72
72	002126	银轮股份	789,966.00	6.20
73	300284	苏交科	785,556.00	6.16
74	000603	盛达资源	783,039.00	6.14
75	300607	拓斯达	779,279.00	6.11
76	002831	裕同科技	764,102.00	5.99
77	300203	聚光科技	739,937.30	5.80
78	002867	周大生	731,368.00	5.74
79	000672	上峰水泥	720,012.00	5.65
80	000818	航锦科技	695,637.00	5.46
81	300401	花园生物	669,231.60	5.25
82	300297	蓝盾股份	667,503.00	5.24
83	002649	博彦科技	658,458.00	5.17
84	300232	洲明科技	649,202.84	5.09
85	300185	通裕重工	647,023.00	5.08
86	002139	拓邦股份	644,681.00	5.06
87	002182	云海金属	638,079.00	5.01
88	300047	天源迪科	621,126.00	4.87
89	300222	科大智能	611,567.00	4.80
90	002717	岭南股份	609,923.00	4.78
91	002745	木林森	589,105.00	4.62
92	002171	楚江新材	565,963.00	4.44
93	300570	太辰光	561,333.00	4.40
94	300546	雄帝科技	560,798.00	4.40
95	300303	聚飞光电	559,139.00	4.39
96	002737	葵花药业	556,834.96	4.37
97	300137	先河环保	555,575.00	4.36
98	002318	久立特材	553,307.00	4.34
99	300349	金卡智能	550,866.00	4.32
100	002664	长鹰信质	550,395.00	4.32
101	300190	维尔利	548,875.00	4.31
102	002833	弘亚数控	548,713.00	4.30
103	300584	海辰药业	547,603.00	4.30
104	002706	良信电器	546,586.00	4.29
105	002119	康强电子	543,558.00	4.26
106	002303	美盈森	534,292.00	4.19
107	300043	星辉娱乐	533,319.00	4.18
108	000766	通化金马	532,375.00	4.18
109	002301	齐心集团	532,238.00	4.18
110	002626	金达威	531,700.00	4.17
111	001696	宗申动力	530,277.00	4.16
112	002298	中电兴发	530,060.00	4.16
113	000810	创维数字	519,986.00	4.08
114	002933	新兴装备	491,333.00	3.85

115	300016	北陆药业	480,530.00	3.77
116	000620	新华联	472,989.00	3.71
117	300298	三诺生物	472,120.00	3.70
118	002115	三维通信	469,256.00	3.68
119	002226	江南化工	468,764.00	3.68
120	002425	凯撒文化	464,251.00	3.64
121	300506	名家汇	462,945.10	3.63
122	002215	诺普信	455,266.00	3.57
123	002206	海利得	454,642.00	3.57
124	002545	东方铁塔	454,452.00	3.57
125	002526	山东矿机	448,061.00	3.52
126	002605	姚记科技	439,972.00	3.45
127	002661	克明面业	436,495.00	3.42
128	002614	奥佳华	431,070.00	3.38
129	002334	英威腾	427,311.00	3.35
130	002768	国恩股份	416,225.00	3.27
131	300583	赛托生物	415,838.00	3.26
132	300438	鹏辉能源	414,743.00	3.25
133	002530	金财互联	414,588.00	3.25
134	002392	北京利尔	410,388.00	3.22
135	002029	七匹狼	407,549.00	3.20
136	002510	天汽模	403,533.00	3.17
137	000525	红太阳	392,560.00	3.08
138	300459	金科文化	390,744.00	3.07
139	300420	五洋停车	390,303.00	3.06
140	000821	京山轻机	383,119.00	3.01
141	002228	合兴包装	381,765.00	2.99
142	300138	晨光生物	381,756.00	2.99
143	002540	亚太科技	377,408.00	2.96
144	300057	万顺新材	374,843.00	2.94
145	000510	新金路	369,438.00	2.90
146	300213	佳讯飞鸿	367,611.00	2.88
147	300575	中旗股份	367,520.00	2.88
148	000639	西王食品	363,938.00	2.86
149	300422	博世科	362,994.10	2.85
150	300132	青松股份	360,617.00	2.83
151	002734	利民股份	350,460.00	2.75
152	002245	澳洋顺昌	348,262.00	2.73
153	300465	高伟达	347,943.00	2.73
154	002837	英维克	347,164.00	2.72
155	000889	中嘉博创	345,882.00	2.71
156	002455	百川股份	342,324.00	2.69
157	300388	国祯环保	340,995.00	2.68
158	300632	光莆股份	337,340.20	2.65

159	002822	中装建设	336,813.00	2.64
160	002539	云图控股	334,041.00	2.62
161	000407	胜利股份	328,817.00	2.58
162	002923	润都股份	327,817.00	2.57
163	002793	东音股份	324,922.00	2.55
164	601155	新城控股	318,623.00	2.50
165	300664	鹏鹞环保	315,837.00	2.48
166	300497	富祥股份	312,760.00	2.45
167	300067	安诺其	306,675.00	2.41
168	300230	永利股份	306,145.00	2.40
169	002757	南兴股份	304,151.00	2.39
170	300556	丝路视觉	300,002.00	2.35
171	002840	华统股份	298,303.00	2.34
172	300396	迪瑞医疗	297,472.00	2.33
173	300481	濮阳惠成	294,687.00	2.31
174	300513	恒实科技	294,518.00	2.31
175	002738	中矿资源	293,565.00	2.30
176	002789	建艺集团	293,558.00	2.30
177	300687	赛意信息	292,159.00	2.29
178	300217	东方电热	290,489.00	2.28
179	300522	世名科技	289,819.00	2.27
180	002788	鹭燕医药	289,023.00	2.27
181	300443	金雷股份	287,567.00	2.26
182	002541	鸿路钢构	283,034.04	2.22
183	002472	双环传动	280,304.00	2.20
184	002381	双箭股份	279,260.00	2.19
185	300660	江苏雷利	272,423.00	2.14
186	300511	雪榕生物	271,179.00	2.13
187	300439	美康生物	268,702.00	2.11
188	002772	众兴菌业	266,669.00	2.09
189	002756	永兴材料	265,439.00	2.08
190	002802	洪汇新材	264,992.00	2.08
191	300304	云意电气	261,190.00	2.05
192	002658	雪迪龙	258,366.00	2.03
193	002722	金轮股份	254,972.00	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	284,469,750.99
卖出股票的收入（成交）总额	344,544,017.84

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。

8.5 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）	37,100.00	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,100.00	0.29

8.6 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	128086	国轩转债	126	12,600.00	0.10
2	110063	鹰 19 转债	110	11,000.00	0.09
3	128087	孚日转债	52	5,200.00	0.04
4	128090	汽模转 2	30	3,000.00	0.02
5	128089	麦米转债	29	2,900.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	461,943.03
2	应收证券清算款	29,225.74

3	应收股利	-
4	应收利息	949.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	492,117.81

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
537	22,317.77	1,067,387.00	8.91%	10,917,255.00	91.09%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	李竹	4,376,160.00	36.51%
2	文登市森鹿制革有限公司	1,000,000.00	8.34%
3	蒋清海	716,700.00	5.98%
4	苗伟平	500,000.00	4.17%
5	钱中明	396,200.00	3.31%
6	李芝华	300,000.00	2.50%
7	邓海岩	259,506.00	2.17%
8	张红芹	250,000.00	2.09%
9	王秀琴	242,760.00	2.03%
10	逢燕	200,000.00	1.67%

9.3 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	0.00	0.00%

9.4 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、基金投资和研究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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 7 月 26 日)基金份额总额	265,484,642.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	253,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,984,642.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 52,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 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 31 日，上海局根据 2018 年 11 月份来公司的现场检查情况，对我司出具了《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（证监决[2019]11 号文）。公司高度重视，立即逐一落实各项整改要求，进一步提升公司内部控制和风险管理能力，2019 年 2 月 20 日，上海局对我司整改工作进行现场验收，对公司整改情况表示认可。

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
海通证券	4	629,013,768.83	100.00%	449,207.73	100.00%	-

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月完成租用托管在海通证券的海通证券上海21016，22662,深圳390027，390130交易单元。

11.7.2 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

海通证券	76,394.77	100.00%	180,000,000.00	100.00%	-	-
------	-----------	---------	----------------	---------	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
2	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
3	关于华安基金撤销沈阳分公司的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-10
4	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-26
5	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	《证券时报》和公司网站	2019-04-26
6	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金新增国泰君安证券为发售代理机构的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-20
7	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金新增中投证券为发售代理机构的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-27
8	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金新增招商证券为发售代理机构的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-03
9	关于调整华安中证民企成长 ETF 网下股票认购请单的提示性公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-05
10	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金延长募集期的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-11
11	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
12	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
13	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金上网发售的提示性公告	《证券时报》和公司网站	2019-07-17
14	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	《证券时报》和公司网站	2019-07-27
15	关于华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-03
16	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-03

17	华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-03
18	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-30
19	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-30
20	华安基金关于旗下基金参加微众银行优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-10-25
21	华安基金关于参加烟台银行优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-20
22	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-25
23	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30
24	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20190906-20191027	0.00	52,239,000.00	52,239,000.00	0.00	0.00%
	2	20191209-20191231	4,710,160.00	0.00	334,000.00	4,376,160.00	36.51%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年四月十一日