

**华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2020 年中期报告**  
**2020 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

## 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 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.....	39
7.3.1 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.....	39
7.3.2 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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
7.7 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.....	48
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49

<b>8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4	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.....	51
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	51
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	52
10.1	基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4	基金投资策略的改变.....	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
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.....	53
10.8	其他重大事件.....	53
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	55
11.1	备查文件目录.....	55
11.2	存放地点.....	55
11.3	查阅方式.....	55

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安沪深 300ETF
场内简称	HS300
基金主代码	515390
交易代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	140,683,016.00 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	2020 年 1 月 10 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	沪深 300 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555

传真	021-68863414	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	-2,100,004.21
本期利润	1,164,881.41
加权平均基金份额本期利润	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.54%
本期基金份额净值增长率	1.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-1,696,780.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0121
期末基金资产净值	143,724,315.52
期末基金份额净值	1.0216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.16%

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：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）。

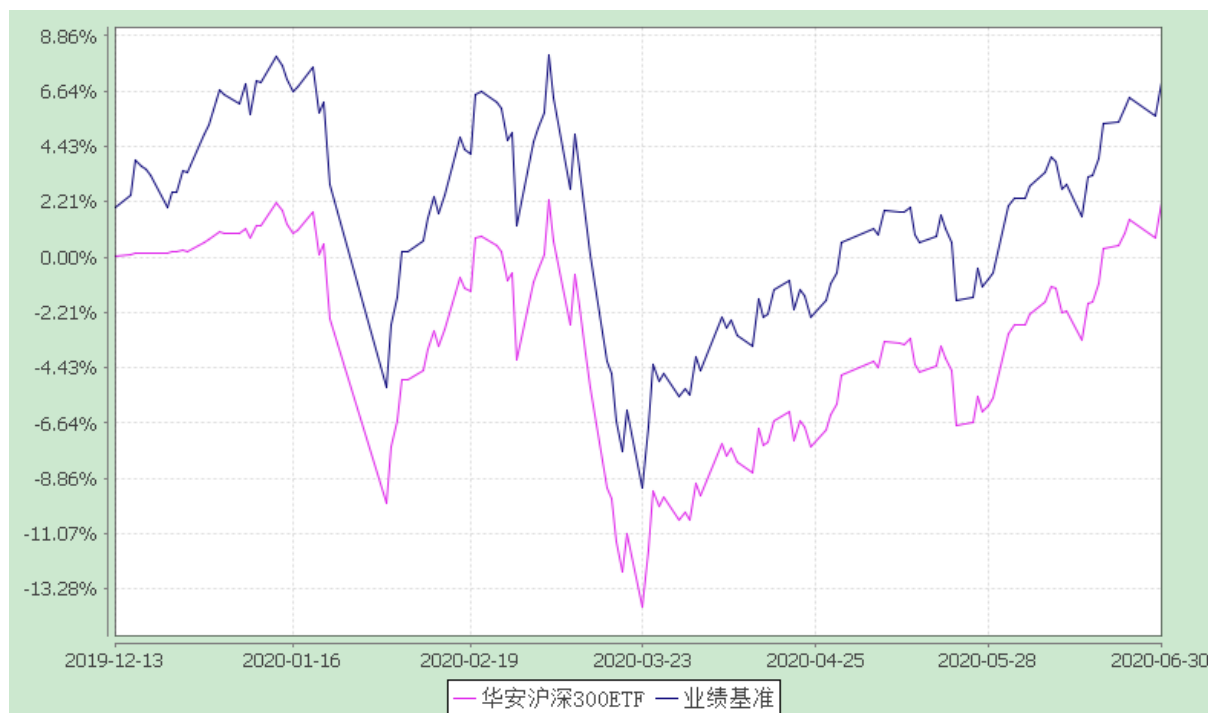
### 3.2 基金净值表现

#### 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	8.24%	0.90%	7.68%	0.90%	0.56%	0.00%
过去三个月	13.81%	0.90%	12.96%	0.90%	0.85%	0.00%
过去六个月	1.45%	1.48%	1.64%	1.52%	-0.19%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.16%	1.40%	7.01%	1.47%	-4.85%	-0.07%

#### 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

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 （2019 年 12 月 13 日至 2020 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、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 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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		
许之彦	本基金的基金	2019-12-1	-	16 年	理学博士，16 年证券、基金从业



	经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理	3		<p>经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 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。2010 年 11 月至 2012 年 12 月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。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 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 12 月起，同时担</p>
--	-----------------------	---	--	--

					任华安沪深 300 交易型开放式指数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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

#### 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，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

上半年，突如其来的疫情给全球宏观经济带来较大的打击，疫情前全球经济本来增长相对疲弱。国内疫情在 2 月底得到较好控制后，全球疫情加速蔓延，特别是美国、巴西、印度等国家。全球来看，目前还没有看到疫情得到明显控制，期待疫苗尽快上市以降低和控制疫情的影响。

全球央行在 3 月初开启了新一轮的降息和量化宽松，以更好救助中小企业，进一步刺激受到疫情影响的“停摆”的经济活动。国内也采取了比较积极的财政措施，降低疫情对中小企业的影响和对就业的冲击。全球宏观经济大概率上 2020 年出现 3-5% 的负增长，出现一定的技术性衰退。

国内疫情后，特别是两会后政策继续加力，加大六稳六保的推动力度。通过财政等措施保障就业和中小企业的生存。从宏观数据来看，包括零售数据、工业企业数据、发电量、PMI 等都出现较快的修复和上行。全年来看，国内很可能获得 2-3% 的正增长。

上半年，第一季度沪深 300 指数下跌约 10%，二季度有所修复，上半年略微上涨 1.64%。在此

期间，本基金采用了全复制策略，顺利平稳完成了相关投资运作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0216 元，本报告期份额净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准增长率为 1.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情的反复依然是下半年制约宏观经济增长最大的因素。我们预期，美联储、欧洲央行等还将进一步扩大量化宽松的货币和财政政策。国内宏观经济下半年将继续修复，三、四季度很可能逐步回到潜在经济增长率水平。我们继续保持大类资产配置的观点不变，在当前的宏观状态、利率环境、通胀预期和流动性背景下，应该继续加大权益类资产以及黄金的配置。国内 A 股，特别是以沪深 300 指数为代表的宽基蓝筹指数，其估值在全球几乎也是最低的。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。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 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：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,074,377.82	344,852,972.11
结算备付金		2,365,088.34	-

存出保证金		1,023,387.10	-
交易性金融资产	6.4.7.2	134,294,717.78	100,992,733.00
其中：股票投资		134,252,817.78	100,992,333.00
基金投资		-	-
债券投资		41,900.00	400.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,250,799.95	-
应收利息	6.4.7.5	1,574.91	48,481.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>147,009,945.90</b>	<b>445,894,186.83</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	39,060.00	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,970,878.07	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,792.13	32,809.93
应付托管费		6,597.39	10,936.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	578,282.52	76,050.35
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	671,020.27	10,326.09
<b>负债合计</b>		<b>3,285,630.38</b>	<b>130,123.01</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	140,683,016.00	442,683,016.00
未分配利润	6.4.7.10	3,041,299.52	3,081,047.82
<b>所有者权益合计</b>		<b>143,724,315.52</b>	<b>445,764,063.82</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>147,009,945.90</b>	<b>445,894,186.83</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0216 元，基金份额总额 140,683,016.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,366,880.63</b>
1.利息收入		99,785.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,759.68
债券利息收入		26.14
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,259,802.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,900,540.15
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	46,721.50
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,594,015.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,264,885.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	262,012.18
<b>减：二、费用</b>		<b>1,201,999.22</b>
1. 管理人报酬		160,400.44
2. 托管费		53,466.78
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	821,696.25
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		0.09
7. 其他费用	6.4.7.19	166,435.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,164,881.41</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,164,881.41</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	442,683,016.00	3,081,047.82	445,764,063.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,164,881.41	1,164,881.41
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）	-302,000,000.00	-1,204,629.71	-303,204,629.71
其中：1.基金申购款	180,000,000.00	-9,949,921.88	170,050,078.12
2.基金赎回款	-482,000,000.00	8,745,292.17	-473,254,707.83
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）	140,683,016.00	3,041,299.52	143,724,315.52

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

华安沪深 300 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]第 1823 号《关于准予华安沪深 300 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《华安沪深 300 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 442,683,016.00 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 0677 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于



2019 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 442,683,016.00 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]309 号文核准同意，本基金 442,683,016.00 份基金份额于 2020 年 1 月 10 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《华安沪深 300 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沪深 300 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分、可交换债)、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具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。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资产的 80%。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：沪深 300 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 8 月 25 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》、《华安中证细分医药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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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。

##### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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，基金管理人可进行收益分配。本基金以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为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

### 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[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	8,074,377.82
定期存款	-

其他存款	-
合计	8,074,377.82

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,192,901.87	134,252,817.78	6,059,915.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	41,900.00	41,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	41,900.00	41,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	128,234,801.87	134,294,717.78	6,059,915.91

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,581,020.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,581,020.00	-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	707.00

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	791.79
应收债券利息	3.82
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	-
应收出借证券利息	-
其他	72.30
合计	1,574.91

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	578,282.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	578,282.52

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	32,820.06
应付替代款	543,527.87
指数使用费	35,000.00
合计	671,020.27

注：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。

#### 6.4.7.9 实收基金



金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,683,016.00	442,683,016.00
本期申购	180,000,000.00	180,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-482,000,000.00	-482,000,000.00
本期末	140,683,016.00	140,683,016.00

注：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。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	325,077.53	2,755,970.29	3,081,047.82
本期利润	-2,100,004.21	3,264,885.62	1,164,881.41
本期基金份额交易产生的变动数	78,145.69	-1,282,775.40	-1,204,629.71
其中：基金申购款	-2,222,861.25	-7,727,060.63	-9,949,921.88
基金赎回款	2,301,006.94	6,444,285.23	8,745,292.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,696,780.99	4,738,080.51	3,041,299.52

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	16,879.85
其他	1,037.35
合计	99,759.68

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-4,664,168.21

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,900,540.15

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	187,400,042.84
减：卖出股票成本总额	185,636,414.78
买卖股票差价收入	1,763,628.06

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	473,254,707.83
减：现金支付赎回款总额	138,014,185.83
减：赎回股票成本总额	339,904,690.21
赎回差价收入	-4,664,168.21

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,944.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	157,200.00
减：应收利息总额	23.00
买卖债券差价收入	46,721.50

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,594,015.66
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,594,015.66

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	3,303,945.62
——股票投资	3,303,945.62
——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	-39,060.00
——权证投资	-
——股指期货	-39,060.00
4.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	3,264,885.62

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	262,012.18
合计	262,012.18

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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	821,696.25

银行间市场交易费用	-
合计	821,696.25

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	32,820.06
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	3,943.26
合计	166,435.66

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

##### 6.4.9.2 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、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	160,400.44
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

注：付基金管理人华安基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	53,466.78

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.05% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 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	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	79.00	0.00%	13,000,079.00	2.94%

#### 6.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	8,074,377.82	81,842.48

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转 2	2020-06-12	2020-07-13	认购新发证券	100.00	100.00	334.00	33,400.00	33,400.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	认购新发证券	100.00	100.00	85.00	8,500.00	8,500.00	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货及权证投资等。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。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

##### 6.4.13.1 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、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控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；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。

#### 6.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在



基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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。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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,074,377.82	-	-	-	8,074,377.82
结算备付金	2,365,088.34	-	-	-	2,365,088.34
存出保证金	1,023,387.10	-	-	-	1,023,387.10
交易性金融资产	41,900.00	-	-	134,252,817.78	134,294,717.78
应收证券清算款	-	-	-	1,250,799.95	1,250,799.95
应收利息	-	-	-	1,574.91	1,574.91
资产总计	11,504,753.26	-	-	135,505,192.64	147,009,945.90
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	39,060.00	39,060.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,970,878.07	1,970,878.07
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,792.13	19,792.13

应付托管费	-	-	-	6,597.39	6,597.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	578,282.52	578,282.52
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	671,020.27	671,020.27
负债总计	-	-	-	3,285,630.38	3,285,630.38
利率敏感度缺口	11,504,753.26	-	-	132,219,562.26	143,724,315.52
上年度末 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	344,852,972.11	-	-	-	344,852,972.11
交易性金融资产	400.00	-	-	100,992,333.00	100,992,733.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	48,481.72	48,481.72
资产总计	344,853,372.11	-	-	101,040,814.72	445,894,186.83
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,809.93	32,809.93
应付托管费	-	-	-	10,936.64	10,936.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	76,050.35	76,050.35
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	10,326.09	10,326.09
负债总计	-	-	-	130,123.01	130,123.01
利率敏感度缺口	344,853,372.11	-	-	100,910,691.71	445,764,063.82

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2019 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。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。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，及时对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	134,252,817.78	93.41	100,992,333.00	22.66
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	134,252,817.78	93.41	100,992,333.00	22.66

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	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：人民币万元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 694	增加约 124
	业绩比较基准减少 5%	减少约 694	减少约 124

### 6.4.14 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	134,252,817.78	91.32
	其中：股票	134,252,817.78	91.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,900.00	0.03
	其中：债券	41,900.00	0.03
	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	10,439,466.16	7.10
8	其他各项资产	2,275,761.96	1.55
9	合计	147,009,945.90	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	1,990,128.00	1.38
B	采矿业	3,234,353.00	2.25
C	制造业	64,599,336.33	44.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,725,904.00	1.90
E	建筑业	2,648,251.00	1.84
F	批发和零售业	1,383,211.00	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	3,776,600.50	2.63

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,505,650.80	3.83
J	金融业	37,821,585.57	26.32
K	房地产业	5,019,973.98	3.49
L	租赁和商务服务业	1,941,847.00	1.35
M	科学研究和技术服务业	937,020.00	0.65
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	169,275.00	0.12
Q	卫生和社会工作	1,630,367.60	1.13
R	文化、体育和娱乐业	869,314.00	0.60
S	综合	-	-
	合计	134,252,817.78	93.41

### 7.2.2 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。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	601318	中国平安	97,600	6,968,640.00	4.85
2	600519	贵州茅台	4,500	6,582,960.00	4.58
3	600036	招商银行	93,100	3,139,332.00	2.18
4	600276	恒瑞医药	33,580	3,099,434.00	2.16
5	000858	五粮液	17,600	3,011,712.00	2.10
6	000333	美的集团	43,977	2,629,384.83	1.83
7	000651	格力电器	43,100	2,438,167.00	1.70
8	002475	立讯精密	37,639	1,932,762.65	1.34
9	600030	中信证券	76,600	1,846,826.00	1.28
10	601166	兴业银行	112,400	1,773,672.00	1.23
11	600887	伊利股份	54,900	1,709,037.00	1.19
12	000002	万科A	61,657	1,611,713.98	1.12
13	601398	工商银行	316,300	1,575,174.00	1.10

14	600900	长江电力	79,400	1,503,836.00	1.05
15	601888	中国中免	9,000	1,386,270.00	0.96
16	601328	交通银行	247,600	1,270,188.00	0.88
17	000661	长春高新	2,800	1,218,840.00	0.85
18	300059	东方财富	57,966	1,170,913.20	0.81
19	600585	海螺水泥	21,800	1,153,438.00	0.80
20	000725	京东方 A	244,500	1,141,815.00	0.79
21	000001	平安银行	87,800	1,123,840.00	0.78
22	603288	海天味业	9,020	1,122,088.00	0.78
23	600000	浦发银行	105,900	1,120,422.00	0.78
24	002714	牧原股份	13,540	1,110,280.00	0.77
25	600016	民生银行	192,100	1,089,207.00	0.76
26	002415	海康威视	33,800	1,025,830.00	0.71
27	600031	三一重工	53,300	999,908.00	0.70
28	601688	华泰证券	53,100	998,280.00	0.69
29	000063	中兴通讯	24,500	983,185.00	0.68
30	601012	隆基股份	23,972	976,379.56	0.68
31	600048	保利地产	64,400	951,832.00	0.66
32	603259	药明康德	9,700	937,020.00	0.65
33	600837	海通证券	73,100	919,598.00	0.64
34	601668	中国建筑	189,000	901,530.00	0.63
35	300498	温氏股份	40,360	879,848.00	0.61
36	601288	农业银行	258,700	874,406.00	0.61
37	600570	恒生电子	7,650	823,905.00	0.57
38	300015	爱尔眼科	18,240	792,528.00	0.55
39	000100	TCL 科技	121,800	755,160.00	0.53
40	601229	上海银行	89,500	742,850.00	0.52
41	300142	沃森生物	13,900	727,804.00	0.51
42	600309	万华化学	14,300	714,857.00	0.50
43	002142	宁波银行	27,200	714,544.00	0.50
44	601211	国泰君安	40,800	704,208.00	0.49
45	603986	兆易创新	2,960	698,293.60	0.49
46	601601	中国太保	24,700	673,075.00	0.47
47	601988	中国银行	190,200	661,896.00	0.46
48	002352	顺丰控股	12,000	656,400.00	0.46
49	601169	北京银行	133,800	655,620.00	0.46
50	600588	用友网络	14,780	651,798.00	0.45
51	600009	上海机场	8,900	641,423.00	0.45
52	601766	中国中车	109,400	609,358.00	0.42
53	600690	海尔智家	34,200	605,340.00	0.42
54	000568	泸州老窖	6,642	605,219.04	0.42
55	002241	歌尔股份	20,600	604,816.00	0.42
56	000338	潍柴动力	43,500	596,820.00	0.42
57	002594	比亚迪	8,300	595,940.00	0.41



58	300122	智飞生物	5,800	580,870.00	0.40
59	002410	广联达	8,300	578,510.00	0.40
60	002304	洋河股份	5,500	578,270.00	0.40
61	000876	新希望	19,000	566,200.00	0.39
62	600999	招商证券	25,700	564,115.00	0.39
63	600703	三安光电	22,300	557,500.00	0.39
64	601899	紫金矿业	124,100	546,040.00	0.38
65	002555	三七互娱	11,500	538,200.00	0.37
66	600104	上汽集团	31,500	535,185.00	0.37
67	002230	科大讯飞	13,900	520,277.00	0.36
68	002027	分众传媒	92,900	517,453.00	0.36
69	601818	光大银行	143,700	514,446.00	0.36
70	600745	闻泰科技	4,000	503,800.00	0.35
71	002007	华兰生物	9,860	494,084.60	0.34
72	300601	康泰生物	3,000	486,480.00	0.34
73	300347	泰格医药	4,750	483,930.00	0.34
74	001979	招商蛇口	28,800	473,472.00	0.33
75	600028	中国石化	120,900	472,719.00	0.33
76	600919	江苏银行	83,100	471,177.00	0.33
77	600436	片仔癀	2,700	459,675.00	0.32
78	600547	山东黄金	11,800	432,116.00	0.30
79	000538	云南白药	4,600	431,526.00	0.30
80	601088	中国神华	29,900	429,364.00	0.30
81	600406	国电南瑞	21,000	425,250.00	0.30
82	000895	双汇发展	9,200	424,028.00	0.30
83	300413	芒果超媒	6,400	417,280.00	0.29
84	601628	中国人寿	15,200	413,592.00	0.29
85	300003	乐普医疗	11,300	412,676.00	0.29
86	000166	申万宏源	81,500	411,575.00	0.29
87	000938	紫光股份	9,500	408,310.00	0.28
88	300014	亿纬锂能	8,500	406,725.00	0.28
89	600050	中国联通	83,800	405,592.00	0.28
90	600438	通威股份	23,300	404,954.00	0.28
91	002271	东方雨虹	9,900	402,237.00	0.28
92	601009	南京银行	54,400	398,752.00	0.28
93	002129	中环股份	17,600	395,296.00	0.28
94	601939	建设银行	60,800	383,648.00	0.27
95	000776	广发证券	26,800	378,416.00	0.26
96	601006	大秦铁路	53,700	378,048.00	0.26
97	002371	北方华创	2,200	376,002.00	0.26
98	603019	中科曙光	9,680	371,712.00	0.26
99	300136	信维通信	7,000	371,140.00	0.26
100	601390	中国中铁	73,700	369,974.00	0.26
101	002460	赣锋锂业	6,900	369,633.00	0.26

102	600196	复星医药	10,900	368,965.00	0.26
103	300124	汇川技术	9,700	368,503.00	0.26
104	601857	中国石油	87,900	368,301.00	0.26
105	000977	浪潮信息	9,400	368,292.00	0.26
106	600019	宝钢股份	80,600	367,536.00	0.26
107	603501	韦尔股份	1,800	363,510.00	0.25
108	002050	三花智控	16,520	361,788.00	0.25
109	603160	汇顶科技	1,600	356,640.00	0.25
110	002044	美年健康	24,560	353,909.60	0.25
111	601186	中国铁建	41,700	349,446.00	0.24
112	002602	世纪华通	22,780	348,761.80	0.24
113	002311	海大集团	7,200	342,648.00	0.24
114	002001	新 和 成	11,700	340,470.00	0.24
115	600015	华夏银行	55,500	339,660.00	0.24
116	601336	新华保险	7,600	336,528.00	0.23
117	600809	山西汾酒	2,314	335,530.00	0.23
118	002624	完美世界	5,800	334,312.00	0.23
119	300433	蓝思科技	11,900	333,676.00	0.23
120	601989	中国重工	82,900	331,600.00	0.23
121	601933	永辉超市	34,700	325,486.00	0.23
122	002236	大华股份	16,600	318,886.00	0.22
123	002456	欧菲光	17,100	314,469.00	0.22
124	600958	东方证券	32,200	305,578.00	0.21
125	600352	浙江龙盛	23,600	301,844.00	0.21
126	600183	生益科技	10,300	301,481.00	0.21
127	000157	中联重科	46,800	300,924.00	0.21
128	600741	华域汽车	14,300	297,297.00	0.21
129	002024	苏宁易购	33,600	294,672.00	0.21
130	601377	兴业证券	42,500	291,125.00	0.20
131	601788	光大证券	17,700	284,262.00	0.20
132	600383	金地集团	20,500	280,850.00	0.20
133	002008	大族激光	7,800	280,410.00	0.20
134	601138	工业富联	18,100	274,215.00	0.19
135	002463	沪电股份	10,900	272,282.00	0.19
136	600346	恒力石化	19,200	268,800.00	0.19
137	300408	三环集团	9,700	268,690.00	0.19
138	000860	顺鑫农业	4,700	267,806.00	0.19
139	601877	正泰电器	10,000	263,500.00	0.18
140	600660	福耀玻璃	12,600	262,962.00	0.18
141	601225	陕西煤业	36,200	261,002.00	0.18
142	601901	方正证券	36,800	260,544.00	0.18
143	603658	安图生物	1,600	259,904.00	0.18
144	601155	新城控股	8,300	259,292.00	0.18
145	002841	视源股份	2,600	258,752.00	0.18

146	002120	韵达股份	10,510	256,969.50	0.18
147	600522	中天科技	22,400	256,480.00	0.18
148	002736	国信证券	22,500	254,250.00	0.18
149	300033	同花顺	1,900	252,852.00	0.18
150	600109	国金证券	22,100	252,161.00	0.18
151	000425	徐工机械	42,500	251,175.00	0.17
152	600340	华夏幸福	10,900	249,174.00	0.17
153	002202	金风科技	24,800	247,256.00	0.17
154	300144	宋城演艺	14,260	246,698.00	0.17
155	603799	华友钴业	6,200	240,932.00	0.17
156	601669	中国电建	68,600	237,356.00	0.17
157	000783	长江证券	35,000	235,900.00	0.16
158	601108	财通证券	22,900	234,725.00	0.16
159	002916	深南电路	1,400	234,528.00	0.16
160	603993	洛阳钼业	63,600	233,412.00	0.16
161	601800	中国交建	31,700	232,678.00	0.16
162	601985	中国核电	56,600	231,494.00	0.16
163	601555	东吴证券	28,140	229,622.40	0.16
164	600089	特变电工	33,600	227,472.00	0.16
165	603369	今世缘	5,700	226,803.00	0.16
166	000069	华侨城 A	37,200	225,432.00	0.16
167	000768	中航飞机	12,600	223,524.00	0.16
168	600867	通化东宝	12,800	223,104.00	0.16
169	600010	包钢股份	206,000	222,480.00	0.15
170	000066	中国长城	16,200	213,840.00	0.15
171	002493	荣盛石化	17,100	210,330.00	0.15
172	600029	南方航空	40,000	206,800.00	0.14
173	002179	中航光电	5,035	206,485.35	0.14
174	600606	绿地控股	33,000	203,940.00	0.14
175	600487	亨通光电	12,400	203,484.00	0.14
176	000963	华东医药	8,000	202,400.00	0.14
177	002157	正邦科技	11,400	199,272.00	0.14
178	002422	科伦药业	9,400	197,400.00	0.14
179	600795	国电电力	106,700	197,395.00	0.14
180	600061	国投资本	15,500	197,315.00	0.14
181	600893	航发动力	8,300	194,884.00	0.14
182	000625	长安汽车	17,700	194,700.00	0.14
183	600886	国投电力	24,700	194,142.00	0.14
184	600705	中航资本	48,800	193,248.00	0.13
185	600926	杭州银行	21,500	191,780.00	0.13
186	601607	上海医药	10,400	191,152.00	0.13
187	002466	天齐锂业	8,200	188,190.00	0.13
188	603833	欧派家居	1,600	185,440.00	0.13
189	600498	烽火通信	6,400	185,024.00	0.13

190	601100	恒立液压	2,300	184,460.00	0.13
191	600111	北方稀土	19,600	182,672.00	0.13
192	601066	中信建投	4,600	181,148.00	0.13
193	601162	天风证券	29,840	180,830.40	0.13
194	000596	古井贡酒	1,200	180,288.00	0.13
195	603899	晨光文具	3,300	180,180.00	0.13
196	600637	东方明珠	18,500	178,525.00	0.12
197	601111	中国国航	27,000	178,470.00	0.12
198	002601	龙蟒佰利	9,500	175,750.00	0.12
199	601360	三六零	9,500	173,945.00	0.12
200	600176	中国巨石	18,900	172,935.00	0.12
201	600115	东方航空	40,600	171,332.00	0.12
202	002607	中公教育	6,100	169,275.00	0.12
203	600011	华能国际	39,800	167,956.00	0.12
204	600233	圆通速递	11,500	167,440.00	0.12
205	600118	中国卫星	5,400	166,482.00	0.12
206	601727	上海电气	33,000	166,320.00	0.12
207	601816	京沪高铁	26,600	165,718.00	0.12
208	600332	白云山	5,100	164,883.00	0.11
209	000786	北新建材	7,700	164,241.00	0.11
210	600271	航天信息	10,100	164,024.00	0.11
211	300628	亿联网络	2,400	163,824.00	0.11
212	601600	中国铝业	58,800	162,288.00	0.11
213	601618	中国中冶	64,200	161,142.00	0.11
214	000656	金科股份	19,500	159,120.00	0.11
215	003816	中国广核	53,400	158,064.00	0.11
216	600221	海航控股	103,800	155,700.00	0.11
217	002252	上海莱士	18,400	155,664.00	0.11
218	601838	成都银行	19,500	155,220.00	0.11
219	000728	国元证券	18,300	153,720.00	0.11
220	600489	中金黄金	16,800	153,552.00	0.11
221	000703	恒逸石化	16,650	152,014.50	0.11
222	601919	中远海控	43,300	150,251.00	0.10
223	600177	雅戈尔	25,200	150,192.00	0.10
224	000961	中南建设	16,800	149,520.00	0.10
225	600068	葛洲坝	25,100	149,345.00	0.10
226	600066	宇通客车	12,100	147,620.00	0.10
227	600004	白云机场	9,600	146,304.00	0.10
228	601997	贵阳银行	20,300	145,348.00	0.10
229	600390	五矿资本	20,300	143,318.00	0.10
230	601998	中信银行	27,700	142,655.00	0.10
231	601198	东兴证券	12,523	136,500.70	0.09
232	600085	同仁堂	5,000	135,600.00	0.09
233	601881	中国银河	11,700	134,199.00	0.09

234	002508	老板电器	4,300	133,773.00	0.09
235	600219	南山铝业	64,900	131,747.00	0.09
236	002673	西部证券	16,100	131,376.00	0.09
237	600018	上港集团	31,200	131,040.00	0.09
238	600362	江西铜业	9,700	130,562.00	0.09
239	002146	荣盛发展	16,000	129,600.00	0.09
240	600516	方大炭素	20,540	128,991.20	0.09
241	601231	环旭电子	5,900	128,856.00	0.09
242	601018	宁波港	35,800	127,806.00	0.09
243	600998	九州通	6,800	126,616.00	0.09
244	600655	豫园股份	14,200	125,812.00	0.09
245	600760	中航沈飞	3,800	124,716.00	0.09
246	600170	上海建工	40,400	124,028.00	0.09
247	601319	中国人保	19,100	123,004.00	0.09
248	601117	中国化学	22,400	122,752.00	0.09
249	601878	浙商证券	12,100	119,911.00	0.08
250	600297	广汇汽车	36,700	117,073.00	0.08
251	601021	春秋航空	3,300	116,292.00	0.08
252	600369	西南证券	25,300	116,127.00	0.08
253	002739	万达电影	7,600	116,052.00	0.08
254	600848	上海临港	5,400	115,938.00	0.08
255	600208	新湖中宝	38,800	115,624.00	0.08
256	002773	康弘药业	2,300	114,080.00	0.08
257	002032	苏泊尔	1,600	113,600.00	0.08
258	002153	石基信息	2,900	113,187.00	0.08
259	002958	青农商行	25,300	112,079.00	0.08
260	601658	邮储银行	24,400	111,508.00	0.08
261	600674	川投能源	11,900	110,313.00	0.08
262	002938	鹏鼎控股	2,200	110,132.00	0.08
263	600038	中直股份	2,600	106,782.00	0.07
264	002939	长城证券	8,600	105,952.00	0.07
265	600027	华电国际	29,400	100,548.00	0.07
266	603156	养元饮品	4,560	98,040.00	0.07
267	002558	巨人网络	5,500	95,700.00	0.07
268	000671	阳光城	14,900	94,466.00	0.07
269	000627	天茂集团	18,047	94,024.87	0.07
270	601992	金隅集团	30,400	93,024.00	0.06
271	600482	中国动力	5,900	92,630.00	0.06
272	600583	海油工程	20,200	91,910.00	0.06
273	002468	申通快递	5,500	90,255.00	0.06
274	600977	中国电影	6,800	89,284.00	0.06
275	601633	长城汽车	11,000	84,920.00	0.06
276	601216	君正集团	30,900	78,486.00	0.05
277	601916	浙商银行	19,900	78,406.00	0.05

278	000709	河钢股份	38,300	78,132.00	0.05
279	601238	广汽集团	8,500	76,500.00	0.05
280	601577	长沙银行	9,500	75,430.00	0.05
281	600188	兖州煤业	8,100	70,956.00	0.05
282	600398	海澜之家	12,100	70,422.00	0.05
283	000723	美锦能源	11,200	70,112.00	0.05
284	601236	红塔证券	3,600	69,840.00	0.05
285	601808	中海油服	5,300	69,642.00	0.05
286	601698	中国卫通	3,600	64,836.00	0.05
287	600928	西安银行	12,100	63,646.00	0.04
288	601898	中煤能源	16,500	62,700.00	0.04
289	600372	中航电子	4,700	62,604.00	0.04
290	600025	华能水电	16,400	62,156.00	0.04
291	600989	宝丰能源	7,300	61,466.00	0.04
292	603260	合盛硅业	2,200	60,148.00	0.04
293	000708	中信特钢	3,200	54,688.00	0.04
294	601077	渝农商行	10,400	49,088.00	0.03
295	600968	海油发展	18,300	42,639.00	0.03
296	601828	美凯龙	3,600	38,124.00	0.03
297	601298	青岛港	6,400	36,352.00	0.03
298	601212	白银有色	13,600	34,680.00	0.02
299	002945	华林证券	2,400	33,144.00	0.02
300	600299	安迪苏	2,600	31,772.00	0.02

### 7.3.2 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。

## 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	601318	中国平安	25,799,508.00	5.79
2	600519	贵州茅台	18,097,210.51	4.06
3	000651	格力电器	11,591,574.32	2.60
4	000333	美的集团	10,280,061.90	2.31
5	000858	五粮液	10,065,354.00	2.26
6	600036	招商银行	9,788,287.00	2.20
7	601166	兴业银行	7,749,296.00	1.74
8	000002	万科 A	6,545,512.20	1.47
9	600276	恒瑞医药	6,311,813.00	1.42

10	000001	平安银行	5,604,473.40	1.26
11	600887	伊利股份	5,486,008.26	1.23
12	002475	立讯精密	5,179,295.54	1.16
13	600030	中信证券	4,968,841.00	1.11
14	300498	温氏股份	4,624,985.00	1.04
15	002415	海康威视	4,420,972.00	0.99
16	600900	长江电力	4,401,043.00	0.99
17	601328	交通银行	4,355,134.00	0.98
18	601398	工商银行	4,266,603.00	0.96
19	603986	兆易创新	4,152,293.00	0.93
20	000725	京东方 A	4,148,796.00	0.93

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	000651	格力电器	10,677,352.63	2.40
2	000858	五粮液	9,922,022.00	2.23
3	000333	美的集团	9,701,850.89	2.18
4	000002	万科 A	5,768,847.00	1.29
5	002475	立讯精密	5,430,016.00	1.22
6	000001	平安银行	5,083,245.00	1.14
7	002415	海康威视	4,189,898.80	0.94
8	300498	温氏股份	4,147,993.23	0.93
9	000725	京东方 A	3,831,171.00	0.86
10	300059	东方财富	3,378,172.30	0.76
11	000063	中兴通讯	3,271,932.00	0.73
12	002714	牧原股份	3,010,410.68	0.68
13	300033	同花顺	2,847,368.02	0.64
14	002142	宁波银行	2,643,876.00	0.59
15	002304	洋河股份	2,560,291.00	0.57
16	000100	TCL 科技	2,543,976.00	0.57
17	000338	潍柴动力	2,429,398.89	0.54
18	001979	招商蛇口	2,173,031.00	0.49
19	000568	泸州老窖	2,128,495.00	0.48
20	300015	爱尔眼科	2,122,477.00	0.48

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	441,297,330.63
卖出股票的收入（成交）总额	187,400,042.84

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。

### 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）	41,900.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,900.00	0.03

### 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	128112	歌尔转 2	334	33,400.00	0.02
2	128114	正邦转债	85	8,500.00	0.01

### 7.7 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。



**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投资。

**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**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2009	IF2009	7.00	8,541,960.00	-39,060.00	-
公允价值变动总额合计					-39,060.00
股指期货投资本期收益					-
股指期货投资本期公允价值变动					-39,060.00

**7.10.2 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。

**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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**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	1,023,387.10
2	应收证券清算款	1,250,799.95
3	应收股利	-
4	应收利息	1,574.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,275,761.96

#### 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

##### 7.12.5.1 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中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票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
2,029	69,336.13	27,956,332.00	19.87%	112,726,684.00	80.13%

**8.2 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	招商证券股份有限公司	8,780,331.00	6.24%
2	中信证券股份有限公司	8,097,772.00	5.76%
3	联讯证券股份有限公司	4,214,404.00	3.00%
4	方正证券股份有限公司	3,738,498.00	2.66%
5	刘素清	2,000,000.00	1.42%
6	华泰证券股份有限公司	1,574,800.00	1.12%
7	朱彦	1,200,000.00	0.85%
8	王晓瑜	1,030,920.00	0.73%
9	付长珠	1,000,000.00	0.71%
10	梁宏丽	1,000,000.00	0.71%

**8.3 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%

**8.4 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。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2019 年 12 月 13 日）基金份额总额	442,683,016.00
本报告期期初基金份额总额	442,683,016.00
本报告期基金总申购份额	180,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	482,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	140,683,016.00

## 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

本基金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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 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	
中信证券	2	364,330,324.99	57.96%	336,616.75	58.21%	-
方正证券	2	223,562,525.86	35.56%	203,733.56	35.23%	-
东吴证券	1	40,729,306.62	6.48%	37,932.21	6.56%	-

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：

无。

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
中信证券	203,944.50	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	关于华安沪深 300 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	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07

		和公司网站	
2	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-07
3	关于华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金结算模式调整并修改基金合同、托管协议及招募说明书的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-15
4	华安基金管理有限公司关于旗下 6 只基金结算模式调整的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-15
5	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
6	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
7	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
8	华安基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-12
9	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
10	华安基金管理有限公司关于调整旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数使用费收费方案的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-17
11	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
12	华安基金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	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
13	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-11
14	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增一级交易商的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
15	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	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
16	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交	《上海证券报》、中国证	2020-06-29

	易费率优惠活动的公告	监会基金电子披露网站 和公司网站	
--	------------	---------------------	--

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安沪深 300 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沪深 300 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；

### 11.2 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>。

### 11.3 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  
二〇二〇年八月二十八日