

华安 MSCI 中国 A 股国际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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
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	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
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	54
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	56
12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF
场内简称	MSCI 中国
基金主代码	512860
交易代码	512860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 27 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,626,372.00 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	2018 年 10 月 26 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	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%。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际指数收益率（经汇率调整）
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	贺倩
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816

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	北京市东城区建国门内大街69 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	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	3,402,617.31
本期利润	2,144,903.56
加权平均基金份额本期利润	0.0909
本期加权平均净值利润率	7.06%
本期基金份额净值增长率	5.93%
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	7,152,612.70
期末可供分配基金份额利润	0.3840
期末基金资产净值	25,778,984.70
期末基金份额净值	1.3840
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	38.40%

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。

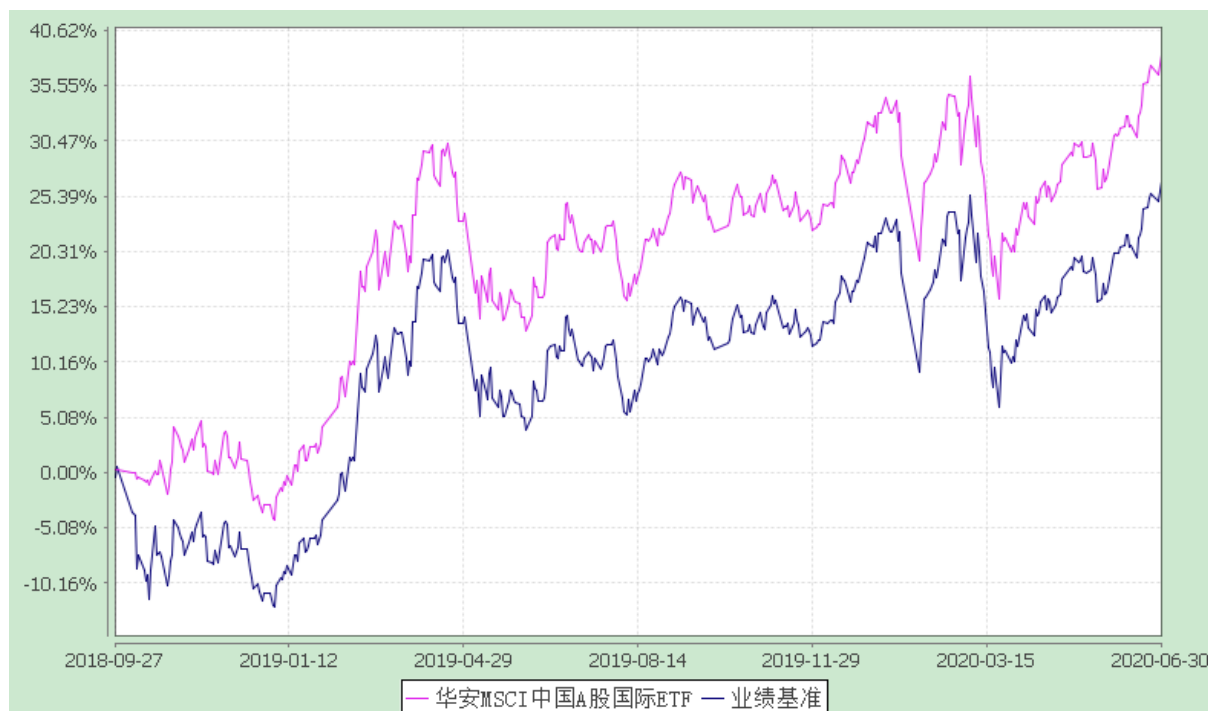
3.2 基金净值表现

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	8.48%	0.83%	8.29%	0.87%	0.19%	-0.04%
过去三个月	14.59%	0.89%	14.50%	0.92%	0.09%	-0.03%
过去六个月	5.93%	1.46%	5.89%	1.53%	0.04%	-0.07%
过去一年	14.03%	1.18%	13.94%	1.22%	0.09%	-0.04%
自基金合同生效起至今	38.40%	1.26%	26.72%	1.38%	11.68%	-0.12%

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 MSCI 中国 A 股国际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
 （2018 年 9 月 27 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		
苏卿云	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2018-09-27	-	12 年	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

				<p>金的基金经理。2018 年 10 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联接基金的基金经理。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，同时担任华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。

4.1.3 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

2020 年上半年，国内疫情得到控制之后，生产活动逐步恢复，目前基本完全复工。在全面复工复产的影响下，国内宏观经济数据持续改善。以 PMI（采购经理人指数）为例，在 2 月份触底之后，过去四个月，综合 PMI 一直处于荣枯线的上方，并有持续上升的趋势。根据国家统计局最新发布的数据，6 月的综合 PMI 值 54.2，是近 4 个月的最高，显示出经济复苏的强劲。为了应对疫情，央行采取了适度宽松的货币政策，包括开展公开市场逆回购操作、引导 MLF 利率及 LPR 同步下行等。财政政策更加积极有为，中国政府加大逆周期宏观政策调节力度，2020 年政府发债规模将超过 8.5 万亿元。在全球美元泛滥的情况下，中国核心资产受到全球关注。根据 Wind 数据，2020 年年初以来至 7 月底，北上资金净买入中国 A 股超过 1300 亿元。

本基金跟踪的指数是 MSCI 中国 A 股国际指数（MSCI China A International Index）。该指数代表中国 A 股的大盘股和中盘股的整体表现，包括已经纳入的和即将要纳入的 A 股。从指数的风险收益特征来看，该指数与沪深 300 指数相关度比较高。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而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 2020 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.3840 元，本报告期份额净值增长率为 5.93%，同期业绩比较基准增长率为 5.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济继续平稳向好，我国经济的复苏和平稳发展为资本市场打下了坚实的基础。继科创板成功推出之后，创业板即将施行注册制改革，支持更多具有科技实力、符合新经济发展方向的企业到资本市场融资上市，支持实体经济的发展，优化资源配置。以公募基金、银行理财、保险等为代表的居民和机构资产配置权益市场的趋势仍在延续。由于美元的全球性泛滥，未来数年全球可能深陷“优质资产荒”的时代，以 MSCI 中国国际指数为代表的中国核心资产属于全球稀缺的优质资产，将会继续受到关注。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

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 MSCI 中国 A 股国际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	1,265,102.89	1,451,967.78
结算备付金		22,487.38	20,129.25
存出保证金		3,248.82	1,169.58
交易性金融资产	6.4.7.2	24,639,491.00	34,895,825.33
其中：股票投资		24,634,591.00	34,889,825.33
基金投资		-	-
债券投资		4,900.00	6,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	228.77	315.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		25,930,558.86	36,369,407.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
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		11,436.89	14,807.93
应付托管费		2,287.38	2,961.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,389.61	12,405.27
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	124,460.28	246,632.00
负债合计		151,574.16	276,806.77
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	18,626,372.00	27,626,372.00
未分配利润	6.4.7.10	7,152,612.70	8,466,228.45
所有者权益合计		25,778,984.70	36,092,600.45
负债和所有者权益总计		25,930,558.86	36,369,407.22

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3840 元，基金份额总额 18,626,372.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股国际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	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		2,384,830.36	20,870,213.36
1.利息收入		5,026.57	6,729.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,023.75	6,689.25
债券利息收入		2.82	40.56
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）		3,595,623.81	9,484,930.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,344,305.17	9,020,524.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,354.05	32,800.44
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	245,964.59	431,606.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,257,713.75	11,227,772.59
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	41,893.73	150,780.13
减：二、费用		239,926.80	462,621.11
1. 管理人报酬		75,662.66	158,098.92
2. 托管费		15,132.59	31,619.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	24,102.33	80,601.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	125,029.22	192,300.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,144,903.56	20,407,592.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,144,903.56	20,407,592.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股国际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）	27,626,372.00	8,466,228.45	36,092,600.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,144,903.56	2,144,903.56
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）	-9,000,000.00	-3,458,519.31	-12,458,519.31

其中：1.基金申购款	3,000,000.00	565,097.98	3,565,097.98
2.基金赎回款	-12,000,000.00	-4,023,617.29	-16,023,617.29
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）	18,626,372.00	7,152,612.70	25,778,984.70
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	117,626,372.00	-3,469,279.40	114,157,092.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,407,592.25	20,407,592.25
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）	-84,000,000.00	-9,750,812.09	-93,750,812.09
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	676,522.24	3,676,522.24
2.基金赎回款	-87,000,000.00	-10,427,334.33	-97,427,334.33
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）	33,626,372.00	7,187,500.76	40,813,872.76

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 MSCI 中国 A 股国际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[2018]第 278 号《关于准予华安 MSCI 中国 A 股国际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 MSCI 中国 A 股国际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

人民币 321,626,372.00 元，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(2018)第 0289 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 321,626,372.00 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]133 号文审核同意，本基金 321,626,372.00 份基金份额于 2018 年 10 月 26 日在上交所挂牌交易。本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资于标的指数成份股、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、创业板及其他经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)。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际指数收益率(经汇率调整)。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金”)。华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 MSCI 中国 A 股国际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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费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	1,265,102.89
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,265,102.89

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	19,964,744.09	24,634,591.00	4,669,846.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,900.00	4,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,900.00	4,900.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	19,969,644.09	24,639,491.00	4,669,846.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

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	217.96
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	9.09
应收债券利息	0.46
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	1.26
合计	228.77

6.4.7.6 其他资产

无余额。

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	13,389.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,389.61

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	24,863.02
预提审计费	29,835.26
指数使用费	69,762.00
合计	124,460.28

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	27,626,372.00	27,626,372.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	18,626,372.00	18,626,372.00

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	7,026,172.11	1,440,056.34	8,466,228.45
本期利润	3,402,617.31	-1,257,713.75	2,144,903.56
本期基金份额交易产生的变动数	-2,915,197.22	-543,322.09	-3,458,519.31
其中：基金申购款	981,080.21	-415,982.23	565,097.98
基金赎回款	-3,896,277.43	-127,339.86	-4,023,617.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,513,592.20	-360,979.50	7,152,612.70

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	4,907.82
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	98.26
其他	17.67
合计	5,023.75

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	1,919,484.41
股票投资收益——赎回差价收入	1,424,820.76
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	3,344,305.17

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	9,414,215.64
减：卖出股票成本总额	7,494,731.23
买卖股票差价收入	1,919,484.41

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	16,023,617.29
减：现金支付赎回款总额	5,540,620.29
减：赎回股票成本总额	9,058,176.24
赎回差价收入	1,424,820.76

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	23,757.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,400.00
减：应收利息总额	3.00
买卖债券差价收入	5,354.05

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	245,964.59
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	245,964.59

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	-1,257,713.75
——股票投资	-1,257,713.75
——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	-1,257,713.75

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	41,893.73
合计	41,893.73

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	24,102.33
银行间市场交易费用	-
合计	24,102.33

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	29,835.26
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
指数使用费	69,762.00
银行汇划费	568.94
合计	125,029.22

注：根据《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人与摩根士丹利资本国际公司签署的指数使用许可协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.05%，收取下限为每季 5,000 美元(采用前一年末最后一个交易日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价换算为人民币)，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

6.4.8.2 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
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人
华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 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	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	75,662.66	158,098.92
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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：

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

6.4.9.2.2 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	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,132.59	31,619.80

注：支付基金托管人中国农业银行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：

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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 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
中国农业银行股份有限公司—华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	7,273,300.00	39.05%	10,451,300.00	37.83%

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,265,102.89	4,907.82	1,151,787.54	5,320.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 5,600 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 93,363.66 元，估值总额为人民币 96,656.00 元，占基金资产净值的比例为 0.37%（于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 11,800 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 197,249.53 元，估值总额为人民币 216,530.00 元，占基金资产净值的比例为 0.53%）。

6.4.10 利润分配情况

无。

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

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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	35.00	3,500.00	3,500.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	认购新发	100.00	100.00	14.00	1,400.00	1,400.00	-

				证券						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 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。

6.4.12.1 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督察长负责。

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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 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%。

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 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	1,265,102.89	-	-	-	1,265,102.89
结算备付金	22,487.38	-	-	-	22,487.38
存出保证金	3,248.82	-	-	-	3,248.82
交易性金融资产	4,900.00	-	-	24,634,591.00	24,639,491.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	228.77	228.77
资产总计	1,295,739.09	-	-	24,634,819.77	25,930,558.86
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	-	-	-	11,436.89	11,436.89
应付托管费	-	-	-	2,287.38	2,287.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,389.61	13,389.61
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	124,460.28	124,460.28
负债总计	-	-	-	151,574.16	151,574.16
利率敏感度缺口	1,295,739.09	-	-	24,483,245.61	25,778,984.70
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	1,451,967.78	-	-	-	1,451,967.78
结算备付金	20,129.25	-	-	-	20,129.25
存出保证金	1,169.58	-	-	-	1,169.58
交易性金融资产	-	-	6,000.00	34,889,825.33	34,895,825.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	315.28	315.28
资产总计	1,473,266.61	-	6,000.00	34,890,140.61	36,369,407.22
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	-	-	-	14,807.93	14,807.93
应付托管费	-	-	-	2,961.57	2,961.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	12,405.27	12,405.27
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,632.00	246,632.00
负债总计	-	-	-	276,806.77	276,806.77
利率敏感度缺口	1,473,266.61	-	6,000.00	34,613,333.84	36,092,600.45

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 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）。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 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	24,634,591.00	95.56	34,889,825.33	96.67
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	24,634,591.00	95.56	34,889,825.33	96.67

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 123	增加约 177
业绩比较基准减少 5%	减少约 123	减少约 177	

6.4.13 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	24,634,591.00	95.00
	其中：股票	24,634,591.00	95.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,900.00	0.02
	其中：债券	4,900.00	0.02
	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	1,287,590.27	4.97
8	其他各项资产	3,477.59	0.01
9	合计	25,930,558.86	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	407,546.00	1.58
B	采矿业	616,006.30	2.39
C	制造业	12,685,011.96	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	624,206.20	2.42
E	建筑业	486,019.00	1.89
F	批发和零售业	415,220.50	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	679,823.00	2.64
H	住宿和餐饮业	27,409.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,395,192.49	5.41
J	金融业	5,269,068.80	20.44
K	房地产业	874,012.40	3.39
L	租赁和商务服务业	377,152.00	1.46
M	科学研究和技术服务业	205,461.00	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	19,488.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	33,300.00	0.13
Q	卫生和社会工作	294,470.35	1.14
R	文化、体育和娱乐业	210,002.00	0.81
S	综合	15,202.00	0.06
	合计	24,634,591.00	95.56

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

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	600519	贵州茅台	900	1,316,592.00	5.11
2	601318	中国平安	8,100	578,340.00	2.24
3	600036	招商银行	15,400	519,288.00	2.01
4	000858	五粮液	2,900	496,248.00	1.93
5	600276	恒瑞医药	3,956	365,138.80	1.42
6	600900	长江电力	16,400	310,616.00	1.20
7	300750	宁德时代	1,600	278,976.00	1.08
8	002475	立讯精密	5,206	267,328.10	1.04
9	603288	海天味业	2,060	256,264.00	0.99
10	601166	兴业银行	15,500	244,590.00	0.95
11	300760	迈瑞医疗	800	244,560.00	0.95
12	600000	浦发银行	21,900	231,702.00	0.90
13	601888	中国中免	1,500	231,045.00	0.90
14	002714	牧原股份	2,749	225,418.00	0.87
15	002415	海康威视	7,000	212,450.00	0.82
16	601398	工商银行	40,300	200,694.00	0.78
17	000002	万科A	7,300	190,822.00	0.74
18	601288	农业银行	55,600	187,928.00	0.73
19	000001	平安银行	14,500	185,600.00	0.72
20	600030	中信证券	7,300	176,003.00	0.68
21	600585	海螺水泥	3,000	158,730.00	0.62
22	601328	交通银行	29,300	150,309.00	0.58
23	600016	民生银行	26,500	150,255.00	0.58
24	601668	中国建筑	31,300	149,301.00	0.58
25	603259	药明康德	1,520	146,832.00	0.57
26	600887	伊利股份	4,600	143,198.00	0.56
27	600048	保利地产	8,900	131,542.00	0.51
28	300015	爱尔眼科	3,023	131,349.35	0.51
29	000661	长春高新	300	130,590.00	0.51
30	601601	中国太保	4,700	128,075.00	0.50
31	000651	格力电器	2,200	124,454.00	0.48
32	300059	东方财富	6,000	121,200.00	0.47
33	002352	顺丰控股	2,200	120,340.00	0.47
34	300122	智飞生物	1,200	120,180.00	0.47
35	002142	宁波银行	4,500	118,215.00	0.46
36	600031	三一重工	6,300	118,188.00	0.46
37	000725	京东方A	25,300	118,151.00	0.46
38	000063	中兴通讯	2,900	116,377.00	0.45
39	002304	洋河股份	1,100	115,654.00	0.45
40	600309	万华化学	2,300	114,977.00	0.45
41	601012	隆基股份	2,810	114,451.30	0.44

42	600588	用友网络	2,454	108,221.40	0.42
43	601818	光大银行	29,700	106,326.00	0.41
44	601688	华泰证券	5,500	103,400.00	0.40
45	300498	温氏股份	4,720	102,896.00	0.40
46	600809	山西汾酒	700	101,500.00	0.39
47	601766	中国中车	18,200	101,374.00	0.39
48	002594	比亚迪	1,400	100,520.00	0.39
49	000568	泸州老窖	1,100	100,232.00	0.39
50	600104	上汽集团	5,800	98,542.00	0.38
51	601211	国泰君安	5,600	96,656.00	0.37
52	000895	双汇发展	2,089	96,282.01	0.37
53	600999	招商证券	4,300	94,385.00	0.37
54	000538	云南白药	1,000	93,810.00	0.36
55	600050	中国联通	19,300	93,412.00	0.36
56	000876	新希望	3,097	92,290.60	0.36
57	601988	中国银行	26,200	91,176.00	0.35
58	601229	上海银行	10,630	88,229.00	0.34
59	600745	闻泰科技	700	88,165.00	0.34
60	300413	芒果超媒	1,330	86,716.00	0.34
61	600436	片仔癀	500	85,125.00	0.33
62	000166	申万宏源	16,800	84,840.00	0.33
63	600690	海尔智家	4,700	83,190.00	0.32
64	601066	中信建投	2,100	82,698.00	0.32
65	300601	康泰生物	500	81,080.00	0.31
66	603501	韦尔股份	400	80,780.00	0.31
67	600570	恒生电子	749	80,667.30	0.31
68	001979	招商蛇口	4,900	80,556.00	0.31
69	603986	兆易创新	340	80,209.40	0.31
70	601006	大秦铁路	11,100	78,144.00	0.30
71	601169	北京银行	15,800	77,420.00	0.30
72	601390	中国中铁	15,200	76,304.00	0.30
73	600837	海通证券	6,000	75,480.00	0.29
74	600703	三安光电	3,000	75,000.00	0.29
75	002555	三七互娱	1,600	74,880.00	0.29
76	600028	中国石化	19,000	74,290.00	0.29
77	300782	卓胜微	180	73,038.60	0.28
78	601186	中国铁建	8,600	72,068.00	0.28
79	600547	山东黄金	1,940	71,042.80	0.28
80	600406	国电南瑞	3,500	70,875.00	0.27
81	601336	新华保险	1,600	70,848.00	0.27
82	002241	歌尔股份	2,400	70,464.00	0.27
83	002007	华兰生物	1,385	69,402.35	0.27
84	002371	北方华创	400	68,364.00	0.27
85	601989	中国重工	17,000	68,000.00	0.26

86	300014	亿纬锂能	1,421	67,994.85	0.26
87	601933	永辉超市	7,200	67,536.00	0.26
88	601857	中国石油	16,100	67,459.00	0.26
89	603160	汇顶科技	300	66,870.00	0.26
90	601138	工业富联	4,400	66,660.00	0.26
91	601899	紫金矿业	14,700	64,680.00	0.25
92	000938	紫光股份	1,480	63,610.40	0.25
93	600019	宝钢股份	13,900	63,384.00	0.25
94	000100	TCL 科技	10,100	62,620.00	0.24
95	000776	广发证券	4,400	62,128.00	0.24
96	000338	潍柴动力	4,500	61,740.00	0.24
97	002027	分众传媒	11,000	61,270.00	0.24
98	300347	泰格医药	600	61,128.00	0.24
99	600346	恒力石化	4,360	61,040.00	0.24
100	002024	苏宁易购	6,950	60,951.50	0.24
101	002230	科大讯飞	1,600	59,888.00	0.23
102	002050	三花智控	2,690	58,911.00	0.23
103	300433	蓝思科技	2,100	58,884.00	0.23
104	601088	中国神华	4,100	58,876.00	0.23
105	600015	华夏银行	9,600	58,752.00	0.23
106	300142	沃森生物	1,100	57,596.00	0.22
107	601628	中国人寿	2,100	57,141.00	0.22
108	002311	海大集团	1,200	57,108.00	0.22
109	601100	恒立液压	700	56,140.00	0.22
110	002410	广联达	800	55,760.00	0.22
111	002916	深南电路	332	55,616.64	0.22
112	601009	南京银行	7,500	54,975.00	0.21
113	603444	吉比特	100	54,901.00	0.21
114	002624	完美世界	946	54,527.44	0.21
115	601155	新城控股	1,730	54,045.20	0.21
116	300033	同花顺	400	53,232.00	0.21
117	600196	复星医药	1,500	50,775.00	0.20
118	600009	上海机场	700	50,449.00	0.20
119	600438	通威股份	2,900	50,402.00	0.20
120	600340	华夏幸福	2,200	50,292.00	0.20
121	002841	视源股份	500	49,760.00	0.19
122	600183	生益科技	1,700	49,759.00	0.19
123	300124	汇川技术	1,300	49,387.00	0.19
124	600919	江苏银行	8,600	48,762.00	0.19
125	002271	东方雨虹	1,200	48,756.00	0.19
126	002821	凯莱英	200	48,600.00	0.19
127	603993	洛阳钼业	13,200	48,444.00	0.19
128	002493	荣盛石化	3,900	47,970.00	0.19
129	000596	古井贡酒	319	47,926.56	0.19

130	600741	华域汽车	2,300	47,817.00	0.19
131	300003	乐普医疗	1,300	47,476.00	0.18
132	002602	世纪华通	3,100	47,461.00	0.18
133	002129	中环股份	2,100	47,166.00	0.18
134	300676	华大基因	300	46,773.00	0.18
135	600383	金地集团	3,400	46,580.00	0.18
136	601788	光大证券	2,900	46,574.00	0.18
137	002001	新 和 成	1,600	46,560.00	0.18
138	002600	领益智造	4,300	45,709.00	0.18
139	601939	建设银行	7,200	45,432.00	0.18
140	601225	陕西煤业	6,200	44,702.00	0.17
141	002120	韵达股份	1,780	43,521.00	0.17
142	601901	方正证券	6,100	43,188.00	0.17
143	002460	赣锋锂业	800	42,856.00	0.17
144	002812	恩捷股份	650	42,770.00	0.17
145	600958	东方证券	4,500	42,705.00	0.17
146	002236	大华股份	2,200	42,262.00	0.16
147	601877	正泰电器	1,600	42,160.00	0.16
148	300558	贝达药业	300	41,994.00	0.16
149	002044	美年健康	2,900	41,789.00	0.16
150	300454	深信服	200	41,192.00	0.16
151	300628	亿联网络	600	40,956.00	0.16
152	000977	浪潮信息	1,032	40,433.76	0.16
153	600886	国投电力	5,100	40,086.00	0.16
154	603939	益丰药房	440	40,040.00	0.16
155	600893	航发动力	1,700	39,916.00	0.15
156	601669	中国电建	11,500	39,790.00	0.15
157	600926	杭州银行	4,450	39,694.00	0.15
158	601985	中国核电	9,700	39,673.00	0.15
159	600600	青岛啤酒	500	38,250.00	0.15
160	300529	健帆生物	550	38,225.00	0.15
161	603899	晨光文具	700	38,220.00	0.15
162	002127	南极电商	1,800	38,106.00	0.15
163	601816	京沪高铁	6,100	38,003.00	0.15
164	600606	绿地控股	6,100	37,698.00	0.15
165	600521	华海药业	1,110	37,662.30	0.15
166	600584	长电科技	1,200	37,524.00	0.15
167	000768	中航飞机	2,100	37,254.00	0.14
168	300253	卫宁健康	1,620	37,162.80	0.14
169	300136	信维通信	700	37,114.00	0.14
170	000069	华侨城 A	6,100	36,966.00	0.14
171	600010	包钢股份	34,100	36,828.00	0.14
172	002456	欧菲光	2,000	36,780.00	0.14
173	601881	中国银河	3,200	36,704.00	0.14

174	002049	紫光国微	500	36,375.00	0.14
175	002414	高德红外	1,230	36,014.40	0.14
176	300408	三环集团	1,300	36,010.00	0.14
177	603605	珀莱雅	200	36,004.00	0.14
178	002384	东山精密	1,200	35,940.00	0.14
179	603369	今世缘	900	35,811.00	0.14
180	603019	中科曙光	932	35,788.80	0.14
181	601990	南京证券	2,500	35,675.00	0.14
182	600029	南方航空	6,900	35,673.00	0.14
183	600845	宝信软件	600	35,448.00	0.14
184	603517	绝味食品	500	35,370.00	0.14
185	600161	天坛生物	780	35,357.40	0.14
186	600872	中炬高新	600	35,118.00	0.14
187	002736	国信证券	3,100	35,030.00	0.14
188	000425	徐工机械	5,800	34,278.00	0.13
189	601377	兴业证券	5,000	34,250.00	0.13
190	000860	顺鑫农业	600	34,188.00	0.13
191	002179	中航光电	820	33,628.20	0.13
192	300144	宋城演艺	1,940	33,562.00	0.13
193	600332	白云山	1,036	33,493.88	0.13
194	601618	中国中冶	13,300	33,383.00	0.13
195	600763	通策医疗	200	33,354.00	0.13
196	002607	中公教育	1,200	33,300.00	0.13
197	002157	正邦科技	1,900	33,212.00	0.13
198	600061	国投资本	2,600	33,098.00	0.13
199	601111	中国国航	5,000	33,050.00	0.13
200	000656	金科股份	4,000	32,640.00	0.13
201	603658	安图生物	200	32,488.00	0.13
202	002463	沪电股份	1,300	32,474.00	0.13
203	300450	先导智能	700	32,347.00	0.13
204	000625	长安汽车	2,900	31,900.00	0.12
205	000963	华东医药	1,260	31,878.00	0.12
206	600536	中国软件	400	31,680.00	0.12
207	300308	中际旭创	500	31,500.00	0.12
208	600660	福耀玻璃	1,500	31,305.00	0.12
209	002252	上海莱士	3,700	31,302.00	0.12
210	300595	欧普康视	450	31,203.00	0.12
211	300482	万孚生物	300	31,200.00	0.12
212	601360	三六零	1,700	31,127.00	0.12
213	603659	璞泰来	300	30,906.00	0.12
214	000157	中联重科	4,800	30,864.00	0.12
215	601727	上海电气	6,100	30,744.00	0.12
216	603799	华友钴业	790	30,699.40	0.12
217	600352	浙江龙盛	2,400	30,696.00	0.12

218	600674	川投能源	3,300	30,591.00	0.12
219	002032	苏泊尔	430	30,530.00	0.12
220	300661	圣邦股份	100	30,505.00	0.12
221	601162	天风证券	5,000	30,300.00	0.12
222	600298	安琪酵母	600	29,688.00	0.12
223	600115	东方航空	7,000	29,540.00	0.11
224	600760	中航沈飞	900	29,538.00	0.11
225	002439	启明星辰	700	29,449.00	0.11
226	600132	重庆啤酒	400	29,200.00	0.11
227	601872	招商轮船	5,000	29,150.00	0.11
228	000066	中国长城	2,200	29,040.00	0.11
229	600018	上港集团	6,900	28,980.00	0.11
230	002065	东华软件	2,300	28,796.00	0.11
231	300383	光环新网	1,100	28,677.00	0.11
232	601319	中国人保	4,400	28,336.00	0.11
233	002385	大北农	3,100	28,241.00	0.11
234	002603	以岭药业	902	28,133.38	0.11
235	600118	中国卫星	900	27,747.00	0.11
236	000786	北新建材	1,300	27,729.00	0.11
237	601108	财通证券	2,700	27,675.00	0.11
238	000783	长江证券	4,100	27,634.00	0.11
239	002153	石基信息	700	27,321.00	0.11
240	600079	人福医药	1,000	27,220.00	0.11
241	600795	国电电力	14,700	27,195.00	0.11
242	600085	同仁堂	1,000	27,120.00	0.11
243	002185	华天科技	2,000	27,060.00	0.10
244	601600	中国铝业	9,800	27,048.00	0.10
245	603882	金域医学	300	26,850.00	0.10
246	600705	中航资本	6,700	26,532.00	0.10
247	002373	千方科技	1,100	26,389.00	0.10
248	600522	中天科技	2,300	26,335.00	0.10
249	002180	纳思达	800	26,328.00	0.10
250	002690	美亚光电	500	26,300.00	0.10
251	600109	国金证券	2,300	26,243.00	0.10
252	600867	通化东宝	1,500	26,145.00	0.10
253	002299	圣农发展	900	26,100.00	0.10
254	600998	九州通	1,400	26,068.00	0.10
255	002202	金风科技	2,612	26,041.64	0.10
256	600498	烽火通信	900	26,019.00	0.10
257	002146	荣盛发展	3,200	25,920.00	0.10
258	603707	健友股份	400	25,828.00	0.10
259	601607	上海医药	1,400	25,732.00	0.10
260	002466	天齐锂业	1,120	25,704.00	0.10
261	601800	中国交建	3,500	25,690.00	0.10

262	603858	步长制药	890	25,676.50	0.10
263	002223	鱼跃医疗	700	25,480.00	0.10
264	601799	星宇股份	200	25,400.00	0.10
265	002773	康弘药业	510	25,296.00	0.10
266	600111	北方稀土	2,700	25,164.00	0.10
267	000703	恒逸石化	2,750	25,107.50	0.10
268	300699	光威复材	400	25,092.00	0.10
269	600143	金发科技	1,900	25,023.00	0.10
270	601919	中远海控	7,200	24,984.00	0.10
271	600779	水井坊	400	24,968.00	0.10
272	000961	中南建设	2,800	24,920.00	0.10
273	300357	我武生物	400	24,900.00	0.10
274	300316	晶盛机电	1,000	24,740.00	0.10
275	600637	东方明珠	2,557	24,675.05	0.10
276	601021	春秋航空	700	24,668.00	0.10
277	001914	招商积余	800	24,584.00	0.10
278	000513	丽珠集团	510	24,485.10	0.09
279	600895	张江高科	1,200	24,444.00	0.09
280	002739	万达电影	1,600	24,432.00	0.09
281	600511	国药股份	600	24,402.00	0.09
282	603338	浙江鼎力	320	24,246.40	0.09
283	600885	宏发股份	600	24,072.00	0.09
284	002601	龙麟佰利	1,300	24,050.00	0.09
285	601231	环旭电子	1,100	24,024.00	0.09
286	000021	深科技	1,100	24,013.00	0.09
287	600390	五矿资本	3,400	24,004.00	0.09
288	300251	光线传媒	2,200	24,002.00	0.09
289	600315	上海家化	500	23,950.00	0.09
290	002212	南洋股份	900	23,922.00	0.09
291	002405	四维图新	1,450	23,910.50	0.09
292	600023	浙能电力	6,800	23,868.00	0.09
293	600176	中国巨石	2,600	23,790.00	0.09
294	600489	中金黄金	2,600	23,764.00	0.09
295	601555	东吴证券	2,910	23,745.60	0.09
296	600801	华新水泥	1,000	23,710.00	0.09
297	300146	汤臣倍健	1,200	23,628.00	0.09
298	603345	安井食品	200	23,600.00	0.09
299	000975	银泰黄金	1,500	23,520.00	0.09
300	300285	国瓷材料	700	23,457.00	0.09
301	600380	健康元	1,440	23,385.60	0.09
302	300496	中科创达	300	23,310.00	0.09
303	002152	广电运通	1,800	23,292.00	0.09
304	600011	华能国际	5,500	23,210.00	0.09
305	601018	宁波港	6,500	23,205.00	0.09

306	603833	欧派家居	200	23,180.00	0.09
307	002422	科伦药业	1,100	23,100.00	0.09
308	000050	深天马 A	1,500	23,040.00	0.09
309	603712	七一二	600	23,028.00	0.09
310	600487	亨通光电	1,400	22,974.00	0.09
311	601198	东兴证券	2,100	22,890.00	0.09
312	600004	白云机场	1,500	22,860.00	0.09
313	600699	均胜电子	960	22,857.60	0.09
314	601658	邮储银行	5,000	22,850.00	0.09
315	600271	航天信息	1,400	22,736.00	0.09
316	300207	欣旺达	1,200	22,680.00	0.09
317	600150	中国船舶	1,300	22,672.00	0.09
318	002558	巨人网络	1,300	22,620.00	0.09
319	002156	通富微电	900	22,545.00	0.09
320	300418	昆仑万维	900	22,464.00	0.09
321	300212	易华录	400	22,400.00	0.09
322	002242	九阳股份	600	22,362.00	0.09
323	601689	拓普集团	800	22,320.00	0.09
324	002511	中顺洁柔	1,000	22,300.00	0.09
325	600177	雅戈尔	3,740	22,290.40	0.09
326	600201	生物股份	800	22,272.00	0.09
327	601998	中信银行	4,300	22,145.00	0.09
328	002294	信立泰	746	22,126.36	0.09
329	002465	海格通信	1,700	21,998.00	0.09
330	600642	申能股份	3,700	21,867.00	0.08
331	002508	老板电器	700	21,777.00	0.08
332	002353	杰瑞股份	700	21,700.00	0.08
333	002557	洽洽食品	400	21,676.00	0.08
334	002507	涪陵榨菜	600	21,606.00	0.08
335	601838	成都银行	2,700	21,492.00	0.08
336	002074	国轩高科	800	21,472.00	0.08
337	002013	中航机电	2,700	21,330.00	0.08
338	600655	豫园股份	2,400	21,264.00	0.08
339	002926	华西证券	2,000	21,260.00	0.08
340	002500	山西证券	3,250	21,255.00	0.08
341	600426	华鲁恒升	1,200	21,216.00	0.08
341	002673	西部证券	2,600	21,216.00	0.08
343	000999	华润三九	720	21,016.80	0.08
344	000728	国元证券	2,500	21,000.00	0.08
345	000739	普洛药业	900	20,961.00	0.08
346	600598	北大荒	1,300	20,930.00	0.08
347	600739	辽宁成大	1,100	20,823.00	0.08
348	601878	浙商证券	2,100	20,811.00	0.08
349	600066	宇通客车	1,700	20,740.00	0.08

350	002019	亿帆医药	900	20,673.00	0.08
351	600482	中国动力	1,300	20,410.00	0.08
352	603589	口子窖	400	20,360.00	0.08
353	603866	桃李面包	400	20,356.00	0.08
354	601117	中国化学	3,700	20,276.00	0.08
355	600170	上海建工	6,600	20,262.00	0.08
356	600068	葛洲坝	3,400	20,230.00	0.08
357	600362	江西铜业	1,500	20,190.00	0.08
358	300088	长信科技	1,800	20,160.00	0.08
359	002399	海普瑞	800	20,032.00	0.08
360	603883	老百姓	200	20,008.00	0.08
361	002075	沙钢股份	1,600	20,000.00	0.08
362	600415	小商品城	4,100	19,967.00	0.08
363	300168	万达信息	900	19,863.00	0.08
364	002939	长城证券	1,600	19,712.00	0.08
365	300070	碧水源	2,400	19,488.00	0.08
366	600297	广汇汽车	6,100	19,459.00	0.08
367	000723	美锦能源	3,100	19,406.00	0.08
368	002131	利欧股份	5,000	19,300.00	0.07
369	600369	西南证券	4,200	19,278.00	0.07
370	000627	天茂集团	3,700	19,277.00	0.07
371	600089	特变电工	2,825	19,125.25	0.07
372	600208	新湖中宝	6,400	19,072.00	0.07
373	000671	阳光城	3,000	19,020.00	0.07
374	601992	金隅集团	6,200	18,972.00	0.07
375	600667	太极实业	1,600	18,912.00	0.07
376	600875	东方电气	2,100	18,585.00	0.07
377	600909	华安证券	2,700	18,441.00	0.07
378	601179	中国西电	3,800	18,392.00	0.07
379	600221	海航控股	12,200	18,300.00	0.07
380	002030	达安基因	670	18,277.60	0.07
381	002174	游族网络	700	18,256.00	0.07
382	601966	玲珑轮胎	900	18,180.00	0.07
383	002958	青农商行	4,100	18,163.00	0.07
384	002078	太阳纸业	1,900	18,088.00	0.07
385	600219	南山铝业	8,900	18,067.00	0.07
386	002468	申通快递	1,100	18,051.00	0.07
387	002797	第一创业	2,600	17,992.00	0.07
388	000423	东阿阿胶	500	17,905.00	0.07
389	002340	格林美	3,600	17,892.00	0.07
390	601233	桐昆股份	1,400	17,864.00	0.07
391	600535	天士力	1,100	17,842.00	0.07
392	600516	方大炭素	2,821	17,715.88	0.07
393	000750	国海证券	4,070	17,663.80	0.07

394	601997	贵阳银行	2,440	17,470.40	0.07
395	002683	宏大爆破	500	17,450.00	0.07
396	600027	华电国际	5,100	17,442.00	0.07
397	002925	盈趣科技	300	17,382.00	0.07
398	000932	华菱钢铁	4,580	17,266.60	0.07
399	603156	养元饮品	800	17,200.00	0.07
400	000988	华工科技	700	17,101.00	0.07
401	600153	建发股份	2,100	17,010.00	0.07
402	300271	华宇软件	600	16,926.00	0.07
403	002572	索菲亚	700	16,919.00	0.07
404	600026	中远海能	2,600	16,796.00	0.07
405	000688	国城矿业	900	16,677.00	0.06
406	600754	锦江酒店	600	16,650.00	0.06
406	000998	隆平高科	1,000	16,650.00	0.06
408	600486	扬农化工	200	16,500.00	0.06
409	002281	光迅科技	500	16,430.00	0.06
410	600038	中直股份	400	16,428.00	0.06
411	000547	航天发展	1,200	16,404.00	0.06
411	300024	机器人	1,200	16,404.00	0.06
413	601099	太平洋	5,100	16,167.00	0.06
414	000709	河钢股份	7,900	16,116.00	0.06
415	000401	冀东水泥	1,000	16,040.00	0.06
416	600100	同方股份	2,200	16,038.00	0.06
417	601216	君正集团	6,300	16,002.00	0.06
418	600704	物产中大	3,800	15,998.00	0.06
419	603000	人民网	800	15,864.00	0.06
420	600167	联美控股	1,100	15,774.00	0.06
421	600188	兖州煤业	1,800	15,768.00	0.06
422	600977	中国电影	1,200	15,756.00	0.06
423	002081	金螳螂	2,000	15,720.00	0.06
424	600688	上海石化	4,500	15,660.00	0.06
425	600155	华创阳安	1,300	15,587.00	0.06
426	601118	海南橡胶	3,200	15,552.00	0.06
427	300017	网宿科技	1,800	15,282.00	0.06
428	600566	济川药业	600	15,276.00	0.06
429	600673	东阳光	2,200	15,202.00	0.06
430	000630	铜陵有色	7,800	15,054.00	0.06
431	601128	常熟银行	2,000	15,020.00	0.06
432	600583	海油工程	3,300	15,015.00	0.06
433	600528	中铁工业	1,700	14,994.00	0.06
434	600021	上海电力	2,000	14,800.00	0.06
435	000686	东北证券	1,740	14,703.00	0.06
436	600460	士兰微	1,000	14,680.00	0.06
437	600372	中航电子	1,100	14,652.00	0.06

438	000402	金融街	2,200	14,608.00	0.06
439	600160	巨化股份	2,100	14,469.00	0.06
440	000729	燕京啤酒	2,100	14,385.00	0.06
441	601106	中国一重	5,100	14,331.00	0.06
442	002387	维信诺	1,000	14,280.00	0.06
443	000825	太钢不锈	4,300	14,276.00	0.06
444	000540	中天金融	4,400	14,168.00	0.05
445	000623	吉林敖东	900	14,157.00	0.05
446	600733	北汽蓝谷	2,200	14,146.00	0.05
447	002396	星网锐捷	400	14,132.00	0.05
448	600959	江苏有线	3,700	13,912.00	0.05
449	000027	深圳能源	2,980	13,827.20	0.05
450	600256	广汇能源	5,100	13,770.00	0.05
451	601098	中南传媒	1,300	13,754.00	0.05
452	000415	渤海租赁	4,600	13,708.00	0.05
453	000028	国药一致	300	13,503.00	0.05
454	600497	驰宏锌锗	3,800	13,072.00	0.05
455	000629	攀钢钒钛	6,500	13,065.00	0.05
456	002010	传化智联	2,400	13,056.00	0.05
457	002372	伟星新材	1,120	13,025.60	0.05
458	600820	隧道股份	2,300	12,995.00	0.05
459	600008	首创股份	4,300	12,943.00	0.05
460	600879	航天电子	2,000	12,880.00	0.05
461	002268	卫士通	600	12,804.00	0.05
461	600398	海澜之家	2,200	12,804.00	0.05
463	000997	新大陆	800	12,784.00	0.05
464	600967	内蒙一机	1,200	12,468.00	0.05
465	600675	中华企业	3,060	12,454.20	0.05
466	600737	中粮糖业	1,600	12,448.00	0.05
467	000046	泛海控股	3,300	12,441.00	0.05
468	000581	威孚高科	600	12,408.00	0.05
469	601958	金钼股份	2,000	12,360.00	0.05
470	002110	三钢闽光	1,850	12,321.00	0.05
471	601699	潞安环能	2,200	12,254.00	0.05
472	300026	红日药业	2,200	12,144.00	0.05
473	002195	二三四五	4,300	12,083.00	0.05
474	002217	合力泰	2,300	12,075.00	0.05
475	002563	森马服饰	1,700	11,985.00	0.05
476	600466	蓝光发展	2,200	11,858.00	0.05
477	300012	华测检测	600	11,856.00	0.05
478	600549	厦门钨业	1,000	11,840.00	0.05
479	600373	中文传媒	1,000	11,780.00	0.05
480	600968	海油发展	5,000	11,650.00	0.05
481	600446	金证股份	600	11,640.00	0.05

482	000883	湖北能源	3,300	11,616.00	0.05
483	600808	马钢股份	4,500	11,610.00	0.05
484	300296	利亚德	1,900	11,533.00	0.04
485	000089	深圳机场	1,500	11,490.00	0.04
486	600056	中国医药	800	11,320.00	0.04
487	000983	西山煤电	2,990	11,212.50	0.04
488	600376	首开股份	1,900	11,134.00	0.04
489	601866	中远海发	6,000	11,040.00	0.04
490	600572	康恩贝	2,000	11,000.00	0.04
491	601718	际华集团	3,300	10,956.00	0.04
492	000738	航发控制	800	10,920.00	0.04
492	603885	吉祥航空	1,200	10,920.00	0.04
494	600258	首旅酒店	700	10,759.00	0.04
495	000031	大悦城	2,100	10,689.00	0.04
496	000413	东旭光电	4,000	10,680.00	0.04
497	601598	中国外运	3,300	10,659.00	0.04
498	600863	内蒙华电	4,300	10,578.00	0.04
499	600776	东方通信	700	10,563.00	0.04
500	002221	东华能源	1,200	10,548.00	0.04
501	002085	万丰奥威	1,600	10,368.00	0.04
502	600718	东软集团	900	10,350.00	0.04
503	000598	兴蓉环境	2,200	10,120.00	0.04
504	002506	协鑫集成	3,800	9,918.00	0.04
505	000898	鞍钢股份	3,920	9,604.00	0.04
506	600260	凯乐科技	700	9,464.00	0.04
507	300598	诚迈科技	30	5,682.00	0.02

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	603986	兆易创新	226,277.00	0.63
2	300760	迈瑞医疗	176,227.00	0.49
3	603993	洛阳钼业	131,035.00	0.36
4	000063	中兴通讯	91,974.00	0.25
5	603899	晨光文具	84,581.00	0.23
6	601816	京沪高铁	83,520.00	0.23
7	002821	凯莱英	79,074.00	0.22
8	002714	牧原股份	72,993.00	0.20
9	300782	卓胜微	68,971.19	0.19

10	603939	益丰药房	68,925.00	0.19
11	002352	顺丰控股	67,892.00	0.19
12	000661	长春高新	66,850.00	0.19
13	000001	平安银行	58,909.00	0.16
14	000858	五粮液	54,415.00	0.15
15	300454	深信服	53,980.00	0.15
16	002841	视源股份	53,792.00	0.15
17	603160	汇顶科技	52,867.00	0.15
18	300661	圣邦股份	50,204.00	0.14
19	600745	闻泰科技	48,790.00	0.14
20	603605	珀莱雅	48,650.00	0.13

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	000858	五粮液	317,364.00	0.88
2	000333	美的集团	217,770.86	0.60
3	300750	宁德时代	191,735.00	0.53
4	603986	兆易创新	187,568.00	0.52
5	002415	海康威视	179,853.00	0.50
6	002475	立讯精密	154,827.20	0.43
7	000002	万科 A	153,013.00	0.42
8	000001	平安银行	142,729.00	0.40
9	000063	中兴通讯	140,119.00	0.39
10	603993	洛阳钼业	122,138.00	0.34
11	002714	牧原股份	113,331.00	0.31
12	000651	格力电器	103,174.00	0.29
13	300760	迈瑞医疗	102,142.00	0.28
14	002821	凯莱英	97,934.00	0.27
15	603899	晨光文具	96,868.00	0.27
16	002304	洋河股份	95,054.00	0.26
17	001979	招商蛇口	93,702.00	0.26
18	300498	温氏股份	93,112.00	0.26
19	000661	长春高新	92,018.00	0.25
20	300454	深信服	91,158.00	0.25

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	5,215,838.89
卖出股票的收入（成交）总额	9,414,215.64

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）	4,900.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,900.00	0.02

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	35	3,500.00	0.01
2	128114	正邦转债	14	1,400.00	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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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	3,248.82
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	228.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,477.59

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

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
273	68,228.47	11,078,724.00	59.48%	7,547,648.00	40.52%

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	1,999,246.00	10.73%
2	中国国际金融股份有限公司	1,799,790.00	9.66%
3	陈应明	762,500.00	4.09%
4	刘晓予	649,147.00	3.49%
5	贺碧燕	534,400.00	2.87%
6	刘晓风	488,406.00	2.62%
7	邹吉芳	270,000.00	1.45%
8	刘晓春	233,328.00	1.25%
9	吴育芳	227,070.00	1.22%
10	虞朋荣	224,600.00	1.21%
11	中国农业银行股份有限公司—华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金	7,273,300.00	39.05%

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（2018 年 9 月 27 日）基金份额总额	321,626,372.00
本报告期期初基金份额总额	27,626,372.00

本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,626,372.00

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	
中信建投	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	7,851,104.20	53.72%	7,154.78	53.44%	-
招商证券	4	3,575,508.86	24.47%	3,329.94	24.87%	-
长江证券	1	3,187,700.53	21.81%	2,904.89	21.70%	-

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：

2020 年 2 月完成租用托管在农业银行的深交所东方证券 009393 交易单元

2020 年 4 月完成租用托管在农业银行的深交所中信建投证券 000302 交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	3,034.28	12.77%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	2,444.20	10.29%	-	-	-	-
长江证券	18,278.57	76.94%	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股国际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及招募说明书的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-15
2	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-15
3	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
4	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
5	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
6	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-12
7	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
8	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
9	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
10	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
11	关于华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式	《中国证券报》、中国证	2020-04-24

	指数证券投资基金新增一级交易商的公告	监会基金电子披露网站和公司网站	
12	华安基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-20
13	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
14	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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29

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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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
机构	1	20200114-20200224	5,048,845.00	27,623,850.00	30,872,905.00	1,799,790.00	9.66%
联接基金	1	20200101-20200630	10,451,300.00	1,050,000.00	4,228,000.00	7,273,300.00	39.05%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股国际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 MSCI 中国 A 股国际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；

12.2 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>。

12.3 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