

**华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基
金**

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 强调事项	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末上市基金前十名持有人	68
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
§10	开放式基金份额变动	68
§11	重大事件揭示	69
11.1	基金份额持有人大会决议	69
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	69
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.9	其他重大事件	71
12	影响投资者决策的其他重要信息	75
§13	备查文件目录	75
13.1	备查文件目录	75
13.2	存放地点	75
13.3	查阅方式	76

§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	15,626,372.00 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	<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%。</p>
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	朱学华	秦一楠
	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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

	上海分公司	
--	-------	--

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年 9 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,420,017.36	10,825,736.48	281,783.16
本期利润	7,576,715.12	23,112,680.98	-6,077,600.68
加权平均基金份额本期利润	0.3880	0.5471	-0.0349
本期加权平均净值利润率	27.56%	47.40%	-3.48%
本期基金份额净值增长率	29.93%	34.62%	-2.95%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	10,325,156.22	7,026,172.11	-3,469,279.40
期末可供分配基金份额利润	0.6608	0.2543	-0.0295
期末基金资产净值	26,525,525.31	36,092,600.45	114,157,092.60
期末基金份额净值	1.6975	1.3065	0.9705
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	69.75%	30.65%	-2.95%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.71%	0.95%	13.15%	1.01%	-1.44%	-0.06%
过去六个月	22.65%	1.27%	23.89%	1.35%	-1.24%	-0.08%
过去一年	29.93%	1.36%	31.18%	1.44%	-1.25%	-0.08%
自基金合同生效起至今	69.75%	1.26%	56.99%	1.37%	12.76%	-0.11%

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

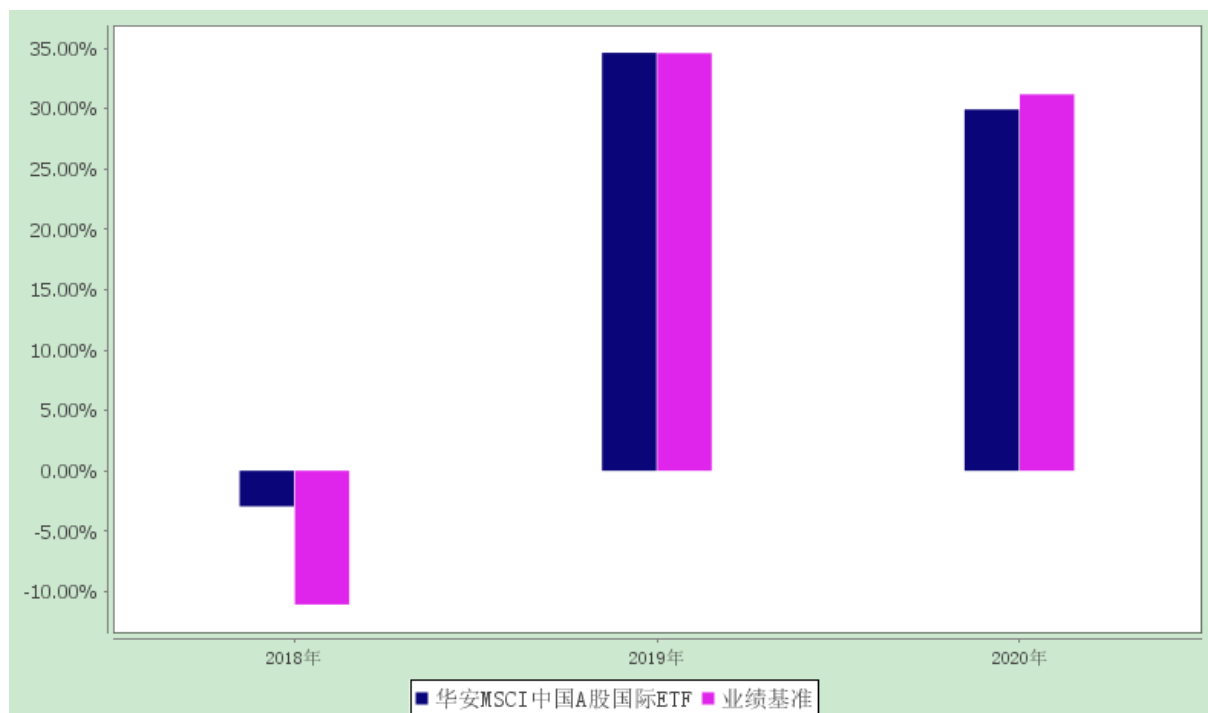
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 9 月 27 日至 2020 年 12 月 31 日)



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

华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 149 只开放式基金，管理资产规模达到 4,701.62 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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
苏卿云	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监	2018-09-27	-	13 年	<p>硕士研究生，13 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 月至 2020 年 6 月，同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理，2017 年 10 月起，同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安 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 月至 2020 年 10 月，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 月至 2020 年 6 月，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</p>

					债 7-10 年国开行债券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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日

的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年，全球资产市场经历了疫情爆发、美国大选、疫苗上市等重要阶段。2020 年全年，从大类资产类别来看，表现最好的是权益资产和黄金，其中权益市场表现突出。疫情爆发后，美国及欧洲等央行都采取了较为激进的货币政策和财政政策，导致资本市场流动性泛滥，从而推动资本市场主要指数不断创出新高。与海外市场相比，国内采取了较为稳健的财政和货币政策。由于国内疫情处理得当，复工复产较早，在经济快速复苏的背景下，资本市场表现优异，特别是消费、医药、新能源等行业涨幅居前。在经济基本面好转、人民币美元利差扩大的情况下，A 股资产在全球的吸引力提升，全年沪深港通北上资金净流入超过 2000 亿元人民币。

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 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.6975 元，本报告期份额净值增长率为 29.93%，同期业绩比较基准增长率为 31.18%。

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 2021 年，全球将迎来经济加快复苏。原因如下：一是当前全球疫苗接种加快推进，疫情感染人数及死亡率等数据不断下降，尽管可能存在病毒变异和接种进度等不确定性的扰动，但是经济向上修复趋势不变；二是美国财政刺激计划落地出台，加大对于美国经济的提振力度，带动全球复苏进程；三是中欧投资协定谈判超预期落地带来全球经贸环境的复苏改善。国内市场来看，经济的复苏态势更为明确，以公募基金、银行理财、保险等机构为代表的中长线资金配置权益市场的趋势仍在延续。由于美元的全球性泛滥，叠加海外疫情反复，人民币配置价值提升，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

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

(2) 积极落实新《证券法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法规要求，督促各项工作稳妥、有序开展。

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《中华人民共和国证券投资基金法》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 12 月 31 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遵规守信、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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务指标、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 24870 号

华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华安 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“华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 强调事项

我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述，华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的剩余资产。因此，上述华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。

基金管理人治理层负责监督华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出

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

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

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

许康玮 楼茜蓉

上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	2,210,278.38	1,451,967.78
结算备付金		-	20,129.25
存出保证金		5,173.59	1,169.58
交易性金融资产	7.4.7.2	24,513,949.43	34,895,825.33
其中：股票投资		24,493,949.43	34,889,825.33
基金投资		-	-
债券投资		20,000.00	6,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	431.58	315.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,729,832.98	36,369,407.22

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		10,812.39	14,807.93
应付托管费		2,162.48	2,961.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	13,570.80	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	7.4.7.8	177,762.00	246,632.00
负债合计		204,307.67	276,806.77
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	15,626,372.00	27,626,372.00
未分配利润	7.4.7.10	10,899,153.31	8,466,228.45
所有者权益合计		26,525,525.31	36,092,600.45
负债和所有者权益总计		26,729,832.98	36,369,407.22

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6975 元，基金份额总额 15,626,372.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		8,038,365.95	23,890,535.65
1.利息收入		10,978.67	10,653.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,968.28	10,605.19
债券利息收入		10.39	48.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,771,502.65	11,427,097.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,301,741.36	10,593,833.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,132.50	36,909.90
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	454,628.79	796,353.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	156,697.76	12,286,944.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	99,186.87	165,840.75
减：二、费用		461,650.83	777,854.67
1. 管理人报酬		137,855.14	248,477.53
2. 托管费		27,571.06	49,695.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	47,576.32	102,254.39
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	7.4.7.19	248,648.31	377,427.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,576,715.12	23,112,680.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,576,715.12	23,112,680.98

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	7,576,715.12	7,576,715.12
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）	-12,000,000.00	-5,143,790.26	-17,143,790.26
其中：1.基金申购款	9,000,000.00	3,744,868.44	12,744,868.44
2.基金赎回款	-21,000,000.00	-8,888,658.70	-29,888,658.70
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）	15,626,372.00	10,899,153.31	26,525,525.31
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	23,112,680.98	23,112,680.98
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）	-90,000,000.00	-11,177,173.13	-101,177,173.13
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	-93,000,000.00	-11,853,695.37	-104,853,695.37
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）	27,626,372.00	8,466,228.45	36,092,600.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安 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(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。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、存托凭证)、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。

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 2021 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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》、本基金基金份额持有人大会于 2021 年 3 月 9 日表决通过的《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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》以及基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 10 日发布的《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2021 年 3 月 10 日进入财产清算期，详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2020 年 12 月 31 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有

能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

于本报告期内及上年度可比期间，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。于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购

和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率(经汇率调整)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。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，

债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	2,210,278.38	1,451,967.78
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	2,210,278.38	1,451,967.78

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末

		2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		18,409,691.01	24,493,949.43	6,084,258.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	20,000.00	20,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,000.00	20,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		18,429,691.01	24,513,949.43	6,084,258.42
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		28,962,264.67	34,889,825.33	5,927,560.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	6,000.00	6,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,000.00	6,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		28,968,264.67	34,895,825.33	5,927,560.66

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	427.76	305.14
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	-	9.00
应收债券利息	1.52	0.64
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	2.30	0.50
合计	431.58	315.28

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	13,570.80	12,405.27
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	13,570.80	12,405.27
----	-----------	-----------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
指数使用费	69,762.00	68,632.00
可退替代款	-	-
预提费用	108,000.00	178,000.00
合计	177,762.00	246,632.00

7.4.7.9 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 12 月 31 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	9,000,000.00	9,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
本期末	15,626,372.00	15,626,372.00

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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,026,172.11	1,440,056.34	8,466,228.45
本期利润	7,420,017.36	156,697.76	7,576,715.12
本期基金份额交易产生的变动数	-4,121,033.25	-1,022,757.01	-5,143,790.26

其中：基金申购款	4,548,740.75	-803,872.31	3,744,868.44
基金赎回款	-8,669,774.00	-218,884.70	-8,888,658.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,325,156.22	573,997.09	10,899,153.31

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,652.06	9,132.21
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	256.30	400.87
其他	59.92	1,072.11
合计	10,968.28	10,605.19

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,157,702.39	4,982,994.83
股票投资收益——赎回差价收入	3,144,038.97	5,610,838.58
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	7,301,741.36	10,593,833.41

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	18,000,245.31	43,573,390.93
减：卖出股票成本总额	13,842,542.92	38,590,396.10

买卖股票差价收入	4,157,702.39	4,982,994.83
----------	--------------	--------------

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
赎回基金份额对价总额	29,888,658.70	104,853,695.37
减：现金支付赎回款总额	10,659,707.70	31,397,382.37
减：赎回股票成本总额	16,084,912.03	67,845,474.42
赎回差价收入	3,144,038.97	5,610,838.58

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,132.50	36,909.90
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,132.50	36,909.90

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	67,642.01	378,058.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,500.00	341,100.00
减：应收利息总额	9.51	48.45
买卖债券差价收入	15,132.50	36,909.90

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	454,628.79	796,353.85
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	454,628.79	796,353.85

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	156,697.76	12,286,944.50
——股票投资	156,697.76	12,286,944.50
——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	156,697.76	12,286,944.50

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	99,186.87	165,840.75
合计	99,186.87	165,840.75

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	47,576.32	102,254.39
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	47,576.32	102,254.39

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	58,000.00	58,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
指数使用费	139,524.00	137,264.00
银行汇划费用	1,124.31	2,163.28
其他费用	-	-
上市年费	-	60,000.00

合计	248,648.31	377,427.28
----	------------	------------

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于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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

1、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》、本基金基金份额持有人大会于 2021 年 3 月 9 日表决通过的《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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》以及基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 10 日发布的《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2021 年 3 月 10 日进入财产清算程序。

2、根据华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2021]669 号文核准，华安基金管理有限公司股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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	本基金联接基金
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	137,855.14	248,477.53
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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.50%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	27,571.06	49,695.47

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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 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	3,316,900.00	21.23%	10,451,300.00	37.83%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	2,210,278.38	10,652.06	1,451,967.78	9,132.21

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	110073	国投转债	老股东配售	40.00	4,000.00
国泰君安证券股份有限公司	113040	星宇转债	老股东配售	10.00	1,000.00
国泰君安证券股份有限公司	113044	大秦转债	老股东配售	190.00	19,000.00
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	110059	浦发转债	老股东配售	640.00	64,000.00
国泰君安证券股份有限公司	113543	欧派转债	老股东配售	10.00	1,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

(1) 于 2020 年 12 月 31 日, 本基金持有 43,300 股托管人农业银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 150,855.28 元, 估值总额为人民币 135,962.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.51%(2019 年 12 月 31 日: 本基金持有 87,400 股托管人农业银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 320,900.22 元, 估值总额为人民币 322,506.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.89%)。

(2) 于 2020 年 12 月 31 日, 本基金持有 4,400 股国泰君安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 76,332.80 元, 估值总额为人民币 77,132.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.29%(2019 年 12 月 31 日: 本基金持有 8,800 股国泰君安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 147,176.75 元, 估值总额为人民币 162,712.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.45%)。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600919	江苏银行	2020-12-17	2021-01-14	配股未上市	4.59	5.46	2,010.00	9,225.90	10,974.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020-12-14	2021-01-15	配债未上市	100.00	100.00	190.00	19,000.00	19,000.00	-

11361 6	韦尔 转债	2020- 12-28	2021- 01-22	配债 未上 市	100.00	100.00	10.00	1,000. 00	1,000. 00	-
------------	----------	----------------	----------------	---------------	--------	--------	-------	--------------	--------------	---

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.08%（2019 年 12 月 31 日：0.02%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.12%。

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。2020 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 26,693,253.21 元，超过经确认的当日净赎回金额。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,210,278.38	-	-	-	2,210,278.38

存出保证金	5,173.59	-	-	-	5,173.59
交易性金融资产	20,000.00	-	-	24,493,949.43	24,513,949.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	431.58	431.58
资产总计	2,235,451.97	-	-	24,494,381.01	26,729,832.98
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	-	-	-	10,812.39	10,812.39
应付托管费	-	-	-	2,162.48	2,162.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,570.80	13,570.80
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	177,762.00	177,762.00
负债总计	-	-	-	204,307.67	204,307.67
利率敏感度缺口	2,235,451.97	-	-	24,290,073.34	26,525,525.31
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.08%(2019 年 12 月 31 日：0.02%)，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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本

面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	24,493,949.43	92.34	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	-	-	-	-
合计	24,493,949.43	92.34	34,889,825.33	96.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,260,000.00	增加约 1,770,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,260,000.00	减少约 1,770,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 12,744,868.44 元(2019 年度：3,676,522.24 元)，

其中包括以股票支付的申购款 7,889,928.00 元和以现金支付的申购款 4,854,940.44 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 2,516,468.00 元和以现金支付的申购款 1,160,054.24 元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 24,482,974.83 元，属于第二层次的余额为 30,974.60 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 34,826,336.63 元，第二层次 69,488.70 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

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

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,493,949.43	91.64
	其中:股票	24,493,949.43	91.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,000.00	0.07
	其中:债券	20,000.00	0.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,210,278.38	8.27
8	其他各项资产	5,605.17	0.02
9	合计	26,729,832.98	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	299,229.50	1.13
B	采矿业	580,354.92	2.19
C	制造业	13,972,577.68	52.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	481,474.70	1.82
E	建筑业	384,375.00	1.45
F	批发和零售业	353,560.10	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	687,783.00	2.59
H	住宿和餐饮业	25,765.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	890,848.86	3.36
J	金融业	4,940,127.90	18.62
K	房地产业	675,060.10	2.54
L	租赁和商务服务业	440,323.00	1.66
M	科学研究和技术服务业	203,755.40	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	13,770.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	35,130.00	0.13
Q	卫生和社会工作	333,579.47	1.26
R	文化、体育和娱乐业	167,683.80	0.63
S	综合	8,551.00	0.03
	合计	24,493,949.43	92.34

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	700	1,398,600.00	5.27
2	000858	五 粮 液	2,300	671,255.00	2.53
3	601318	中国平安	6,300	547,974.00	2.07
4	600036	招商银行	12,000	527,400.00	1.99
5	300750	宁德时代	1,400	491,554.00	1.85
6	600276	恒瑞医药	3,056	340,621.76	1.28
7	603288	海天味业	1,560	312,842.40	1.18
8	601888	中国中免	1,100	310,695.00	1.17
9	002415	海康威视	5,400	261,954.00	0.99
10	300760	迈瑞医疗	600	255,600.00	0.96
11	601166	兴业银行	12,100	252,527.00	0.95
12	600900	长江电力	12,800	245,248.00	0.92
13	002475	立讯精密	4,106	230,428.72	0.87
14	000001	平安银行	11,300	218,542.00	0.82
15	002594	比亚迪	1,100	213,730.00	0.81
16	002304	洋河股份	900	212,391.00	0.80
17	601012	隆基股份	2,210	203,762.00	0.77
18	000568	泸州老窖	900	203,544.00	0.77
19	002352	顺丰控股	2,200	194,106.00	0.73
20	600809	山西汾酒	500	187,645.00	0.71
21	600030	中信证券	6,200	182,280.00	0.69
22	300015	爱尔眼科	2,423	181,458.47	0.68
23	600031	三一重工	4,900	171,402.00	0.65
24	002714	牧原股份	2,149	165,687.90	0.62
25	600000	浦发银行	17,100	165,528.00	0.62
26	603259	药明康德	1,220	164,358.40	0.62
27	600309	万华化学	1,800	163,872.00	0.62
28	000002	万 科 A	5,700	163,590.00	0.62
29	601398	工商银行	31,400	156,686.00	0.59
30	600887	伊利股份	3,500	155,295.00	0.59
31	300059	东方财富	5,000	155,000.00	0.58
32	601601	中国太保	3,700	142,080.00	0.54
33	601288	农业银行	43,300	135,962.00	0.51
34	300122	智飞生物	900	133,119.00	0.50
35	002142	宁波银行	3,500	123,690.00	0.47
36	601668	中国建筑	24,400	121,268.00	0.46
37	600585	海螺水泥	2,300	118,726.00	0.45
38	000725	京东方 A	19,700	118,200.00	0.45

39	603501	韦尔股份	500	115,550.00	0.44
40	600104	上汽集团	4,500	109,980.00	0.41
41	600048	保利地产	6,900	109,158.00	0.41
42	600690	海尔智家	3,700	108,077.00	0.41
43	600016	民生银行	20,600	107,120.00	0.40
44	600436	片仔癀	400	107,004.00	0.40
45	601899	紫金矿业	11,400	105,906.00	0.40
46	601328	交通银行	22,800	102,144.00	0.39
47	600999	招商证券	4,280	99,895.20	0.38
48	600346	恒力石化	3,460	96,776.20	0.36
49	600438	通威股份	2,500	96,100.00	0.36
50	300124	汇川技术	1,000	93,300.00	0.35
51	601818	光大银行	23,200	92,568.00	0.35
52	300014	亿纬锂能	1,121	91,361.50	0.34
53	002493	荣盛石化	3,300	91,113.00	0.34
54	000661	长春高新	200	89,782.00	0.34
55	002027	分众传媒	8,500	83,895.00	0.32
56	601100	恒立液压	736	83,168.00	0.31
57	600588	用友网络	1,854	81,334.98	0.31
58	000538	云南白药	700	79,520.00	0.30
59	000895	双汇发展	1,689	79,281.66	0.30
60	002812	恩捷股份	550	77,979.00	0.29
61	601688	华泰证券	4,300	77,443.00	0.29
62	600893	航发动力	1,300	77,155.00	0.29
63	601211	国泰君安	4,400	77,132.00	0.29
64	300433	蓝思科技	2,500	76,525.00	0.29
65	601766	中国中车	14,100	74,871.00	0.28
66	300413	芒果超媒	1,030	74,675.00	0.28
67	000063	中兴通讯	2,200	74,030.00	0.28
68	600837	海通证券	5,600	72,016.00	0.27
69	600406	国电南瑞	2,700	71,739.00	0.27
70	002241	歌尔股份	1,900	70,908.00	0.27
71	600703	三安光电	2,600	70,226.00	0.26
72	300601	康泰生物	400	69,800.00	0.26
73	601336	新华保险	1,200	69,564.00	0.26
74	600745	闻泰科技	700	69,300.00	0.26
75	000166	申万宏源	13,100	69,168.00	0.26
76	601919	中远海控	5,600	68,376.00	0.26
77	600570	恒生电子	649	68,080.10	0.26
78	300498	温氏股份	3,720	67,815.60	0.26
79	601066	中信建投	1,600	67,200.00	0.25
80	600050	中国联通	15,000	66,900.00	0.25
81	601988	中国银行	20,400	64,872.00	0.24
82	600196	复星医药	1,200	64,788.00	0.24

83	601229	上海银行	8,230	64,523.20	0.24
84	603993	洛阳钼业	10,300	64,375.00	0.24
85	600019	宝钢股份	10,800	64,260.00	0.24
86	601390	中国中铁	11,800	62,186.00	0.23
87	601628	中国人寿	1,600	61,424.00	0.23
88	002460	赣锋锂业	600	60,720.00	0.23
89	600028	中国石化	14,800	59,644.00	0.22
90	000596	古井贡酒	219	59,568.00	0.22
91	601169	北京银行	12,300	59,532.00	0.22
92	002311	海大集团	900	58,950.00	0.22
93	000768	中航西飞	1,600	58,688.00	0.22
94	603345	安井食品	300	57,861.00	0.22
95	300274	阳光电源	800	57,824.00	0.22
96	600660	福耀玻璃	1,200	57,660.00	0.22
97	601088	中国神华	3,200	57,632.00	0.22
98	000625	长安汽车	2,600	56,888.00	0.21
99	601006	大秦铁路	8,700	56,202.00	0.21
100	000876	新希望	2,497	55,932.80	0.21
101	601989	中国重工	13,300	55,727.00	0.21
102	000776	广发证券	3,400	55,352.00	0.21
103	600763	通策医疗	200	55,304.00	0.21
104	000338	潍柴动力	3,500	55,265.00	0.21
105	000100	TCL 科技	7,800	55,224.00	0.21
106	600760	中航沈飞	700	54,726.00	0.21
107	603799	华友钴业	690	54,717.00	0.21
108	002271	东方雨虹	1,400	54,320.00	0.20
109	002371	北方华创	300	54,222.00	0.20
110	002049	紫光国微	400	53,524.00	0.20
111	603605	珀莱雅	300	53,400.00	0.20
112	002230	科大讯飞	1,300	53,131.00	0.20
113	601186	中国铁建	6,700	52,930.00	0.20
114	600741	华域汽车	1,800	51,876.00	0.20
115	601857	中国石油	12,500	51,875.00	0.20
116	002050	三花智控	2,090	51,518.50	0.19
117	600926	杭州银行	3,450	51,474.00	0.19
118	601877	正泰电器	1,300	50,908.00	0.19
119	001979	招商蛇口	3,800	50,502.00	0.19
120	601901	方正证券	4,800	49,776.00	0.19
121	300454	深信服	200	49,602.00	0.19
122	600547	山东黄金	2,096	49,507.52	0.19
123	601633	长城汽车	1,300	49,153.00	0.19
124	002179	中航光电	620	48,539.80	0.18
125	601138	工业富联	3,500	47,915.00	0.18
126	600919	江苏银行	8,710	47,556.60	0.18

127	603986	兆易创新	240	47,400.00	0.18
128	600015	华夏银行	7,500	46,875.00	0.18
129	601009	南京银行	5,800	46,864.00	0.18
130	603160	汇顶科技	300	46,665.00	0.18
131	601155	新城控股	1,330	46,323.90	0.17
132	002841	视源股份	400	46,012.00	0.17
133	002129	中环股份	1,800	45,900.00	0.17
134	002007	华兰生物	1,085	45,830.40	0.17
135	300782	卓胜微	80	45,643.20	0.17
136	600009	上海机场	600	45,396.00	0.17
137	601225	陕西煤业	4,800	44,832.00	0.17
138	603899	晨光文具	500	44,280.00	0.17
139	601788	光大证券	2,300	42,596.00	0.16
140	002024	苏宁易购	5,450	42,019.50	0.16
141	300450	先导智能	500	41,995.00	0.16
142	601360	三六零	2,600	40,846.00	0.15
143	002600	领益智造	3,400	40,766.00	0.15
144	600958	东方证券	3,500	40,705.00	0.15
145	002001	新 和 成	1,200	40,416.00	0.15
146	603369	今世缘	700	40,166.00	0.15
147	601799	星宇股份	200	40,100.00	0.15
148	000786	北新建材	1,000	40,050.00	0.15
149	600176	中国巨石	2,000	39,920.00	0.15
150	600600	青岛啤酒	400	39,760.00	0.15
151	601933	永辉超市	5,500	39,490.00	0.15
152	002414	高德红外	930	38,827.50	0.15
153	603882	金域医学	300	38,436.00	0.14
154	600584	长电科技	900	38,313.00	0.14
155	601816	京沪高铁	6,700	37,922.00	0.14
156	603833	欧派家居	280	37,660.00	0.14
157	000157	中联重科	3,800	37,620.00	0.14
158	002555	三七互娱	1,200	37,476.00	0.14
159	300408	三环集团	1,000	37,250.00	0.14
160	300033	同花顺	300	37,194.00	0.14
161	601985	中国核电	7,500	36,900.00	0.14
162	600183	生益科技	1,300	36,608.00	0.14
163	002916	深南电路	332	35,875.92	0.14
164	600132	重庆啤酒	300	35,697.00	0.13
165	601939	建设银行	5,600	35,168.00	0.13
166	002607	中公教育	1,000	35,130.00	0.13
167	600383	金地集团	2,600	35,100.00	0.13
168	300142	沃森生物	900	34,704.00	0.13
169	600886	国投电力	4,000	34,560.00	0.13
170	601669	中国电建	8,900	34,532.00	0.13

171	600845	宝信软件	500	34,490.00	0.13
172	603806	福斯特	400	34,160.00	0.13
173	000069	华侨城 A	4,800	34,032.00	0.13
174	601377	兴业证券	3,900	33,852.00	0.13
175	002236	大华股份	1,700	33,813.00	0.13
176	000938	紫光股份	1,652	33,783.40	0.13
177	603659	璞泰来	300	33,717.00	0.13
178	600426	华鲁恒升	900	33,570.00	0.13
179	600872	中炬高新	500	33,325.00	0.13
180	002624	完美世界	1,119	33,010.50	0.12
181	002736	国信证券	2,400	32,736.00	0.12
182	603338	浙江鼎力	320	32,380.80	0.12
183	300347	泰格医药	200	32,322.00	0.12
184	000066	中国长城	1,700	32,283.00	0.12
185	002466	天齐锂业	820	32,201.40	0.12
186	600029	南方航空	5,400	32,184.00	0.12
187	601878	浙商证券	2,100	32,130.00	0.12
188	603233	大参林	400	31,340.00	0.12
189	000799	酒鬼酒	200	31,300.00	0.12
190	002568	百润股份	300	31,287.00	0.12
191	601881	中国银河	2,500	31,275.00	0.12
192	002709	天赐材料	300	31,140.00	0.12
193	601658	邮储银行	6,500	31,070.00	0.12
194	603517	绝味食品	400	31,016.00	0.12
195	600010	包钢股份	26,500	31,005.00	0.12
196	002601	龙蟠佰利	1,000	30,770.00	0.12
197	002602	世纪华通	4,320	30,715.20	0.12
198	603939	益丰药房	340	30,664.60	0.12
199	300529	健帆生物	450	30,519.00	0.12
200	603737	三棵树	200	30,300.00	0.11
201	002821	凯莱英	100	29,914.00	0.11
202	600161	天坛生物	716	29,857.20	0.11
203	600109	国金证券	1,800	29,286.00	0.11
204	300628	亿联网络	400	29,248.00	0.11
205	601111	中国国航	3,900	29,211.00	0.11
206	300724	捷佳伟创	200	29,120.00	0.11
207	600061	国投资本	2,100	29,043.00	0.11
208	603658	安图生物	200	29,036.00	0.11
209	000860	顺鑫农业	400	29,016.00	0.11
210	600340	华夏幸福	2,240	28,963.20	0.11
211	002625	光启技术	1,300	28,925.00	0.11
212	002791	坚朗五金	200	28,800.00	0.11
213	300595	欧普康视	350	28,672.00	0.11
214	002202	金风科技	2,012	28,671.00	0.11

215	603019	中科曙光	832	28,479.36	0.11
216	601618	中国中冶	10,400	28,392.00	0.11
217	603816	顾家家居	400	28,204.00	0.11
218	000963	华东医药	1,060	28,153.60	0.11
219	601021	春秋航空	500	27,715.00	0.10
220	300207	欣旺达	900	27,639.00	0.10
221	601600	中国铝业	7,600	27,588.00	0.10
222	603589	口子窖	400	27,560.00	0.10
223	000703	恒逸石化	2,150	27,520.00	0.10
224	600111	北方稀土	2,100	27,489.00	0.10
225	600606	绿地控股	4,700	27,401.00	0.10
226	600521	华海药业	810	27,386.10	0.10
227	002074	国轩高科	700	27,384.00	0.10
228	300144	宋城演艺	1,540	27,288.80	0.10
229	300003	乐普医疗	1,000	27,180.00	0.10
230	600079	人福医药	800	27,104.00	0.10
231	300285	国瓷材料	600	27,066.00	0.10
232	000783	长江证券	3,200	26,880.00	0.10
233	300699	光威复材	300	26,715.00	0.10
234	601108	财通证券	2,100	26,565.00	0.10
235	601916	浙商银行	6,500	26,520.00	0.10
236	600486	扬农化工	200	26,400.00	0.10
237	300661	圣邦股份	100	26,380.00	0.10
238	002120	韵达股份	1,680	26,376.00	0.10
239	002013	中航机电	2,300	26,335.00	0.10
240	002044	美年健康	2,300	26,059.00	0.10
241	002384	东山精密	1,000	26,000.00	0.10
242	600352	浙江龙盛	1,900	25,878.00	0.10
243	601990	南京证券	2,100	25,767.00	0.10
244	600754	锦江酒店	500	25,765.00	0.10
245	002032	苏泊尔	330	25,736.70	0.10
246	300676	华大基因	200	25,712.00	0.10
247	600143	金发科技	1,500	25,710.00	0.10
248	600795	国电电力	11,400	25,650.00	0.10
249	002157	正邦科技	1,500	25,560.00	0.10
250	600298	安琪酵母	500	25,535.00	0.10
251	601727	上海电气	4,700	25,380.00	0.10
252	600115	东方航空	5,400	25,272.00	0.10
253	300677	英科医疗	150	25,222.50	0.10
254	600674	川投能源	2,500	25,125.00	0.09
255	600779	水井坊	300	24,906.00	0.09
256	000547	航天发展	900	24,750.00	0.09
257	600018	上港集团	5,400	24,678.00	0.09
258	600489	中金黄金	2,800	24,668.00	0.09

259	601966	玲珑轮胎	700	24,619.00	0.09
260	600332	白云山	836	24,453.00	0.09
261	002459	晶澳科技	600	24,432.00	0.09
262	002252	上海莱士	3,300	24,420.00	0.09
263	601216	君正集团	4,900	24,255.00	0.09
264	002080	中材科技	1,000	24,180.00	0.09
265	000425	徐工机械	4,500	24,165.00	0.09
266	600862	中航高科	800	24,080.00	0.09
267	600362	江西铜业	1,200	23,940.00	0.09
268	002797	第一创业	2,400	23,880.00	0.09
269	601162	天风证券	3,900	23,790.00	0.09
270	600536	中国软件	300	23,628.00	0.09
271	002410	广联达	300	23,622.00	0.09
272	002739	万达电影	1,300	23,504.00	0.09
273	300496	中科创达	200	23,400.00	0.09
274	600482	中国动力	1,300	23,296.00	0.09
275	002385	大北农	2,400	23,184.00	0.09
276	601689	拓普集团	600	23,058.00	0.09
277	300357	我武生物	300	23,010.00	0.09
278	601555	东吴证券	2,310	22,776.60	0.09
279	600705	中航资本	5,200	22,776.00	0.09
280	600316	洪都航空	400	22,748.00	0.09
281	000728	国元证券	2,530	22,668.80	0.09
282	601233	桐昆股份	1,100	22,649.00	0.09
283	600118	中国卫星	700	22,526.00	0.08
284	601838	成都银行	2,100	22,407.00	0.08
285	000977	浪潮信息	832	22,364.16	0.08
286	601319	中国人保	3,400	22,338.00	0.08
287	600219	南山铝业	7,000	22,120.00	0.08
288	601872	招商轮船	3,900	22,035.00	0.08
289	600066	宇通客车	1,300	21,996.00	0.08
290	000656	金科股份	3,100	21,979.00	0.08
291	600739	辽宁成大	900	21,888.00	0.08
292	002185	华天科技	1,600	21,792.00	0.08
293	300146	汤臣倍健	900	21,735.00	0.08
294	600885	宏发股份	400	21,688.00	0.08
295	002078	太阳纸业	1,500	21,645.00	0.08
296	600089	特变电工	2,125	21,568.75	0.08
297	300136	信维通信	600	21,528.00	0.08
298	300558	贝达药业	200	21,474.00	0.08
299	300253	卫宁健康	1,220	21,350.00	0.08
300	601198	东兴证券	1,600	21,312.00	0.08
301	002507	涪陵榨菜	500	21,150.00	0.08
302	601607	上海医药	1,100	21,120.00	0.08

303	002456	欧菲光	1,600	21,088.00	0.08
304	300316	晶盛机电	700	21,056.00	0.08
305	000800	一汽解放	1,800	21,024.00	0.08
306	002353	杰瑞股份	600	21,000.00	0.08
307	600369	西南证券	3,900	20,982.00	0.08
308	600233	圆通速递	1,800	20,700.00	0.08
309	603638	艾迪精密	300	20,682.00	0.08
310	000050	深天马 A	1,400	20,636.00	0.08
311	300251	光线传媒	1,700	20,519.00	0.08
312	002508	老板电器	500	20,390.00	0.08
313	300308	中际旭创	400	20,344.00	0.08
314	300037	新宙邦	200	20,280.00	0.08
314	002673	西部证券	2,000	20,280.00	0.08
316	002156	通富微电	800	20,192.00	0.08
317	600460	士兰微	800	20,000.00	0.08
318	600998	九州通	1,100	19,976.00	0.08
319	600004	白云机场	1,400	19,782.00	0.07
320	002773	康弘药业	410	19,741.50	0.07
321	600511	国药股份	400	19,724.00	0.07
322	601800	中国交建	2,700	19,602.00	0.07
323	002340	格林美	2,800	19,572.00	0.07
324	600522	中天科技	1,800	19,512.00	0.07
325	000961	中南建设	2,200	19,426.00	0.07
326	002925	盈趣科技	300	19,299.00	0.07
327	600699	均胜电子	760	19,273.60	0.07
328	600011	华能国际	4,300	19,264.00	0.07
329	600598	北大荒	1,000	19,250.00	0.07
330	002500	山西证券	2,150	19,242.50	0.07
331	600023	浙能电力	5,300	19,239.00	0.07
332	002127	南极电商	1,400	19,152.00	0.07
333	600085	同仁堂	800	19,120.00	0.07
334	600177	雅戈尔	2,640	18,981.60	0.07
335	600038	中直股份	300	18,813.00	0.07
336	002463	沪电股份	1,000	18,790.00	0.07
337	002926	华西证券	1,500	18,720.00	0.07
338	002299	圣农发展	700	18,578.00	0.07
339	000750	国海证券	3,170	18,576.20	0.07
340	002294	信立泰	646	18,301.18	0.07
341	300223	北京君正	200	18,298.00	0.07
342	600390	五矿资本	2,600	18,148.00	0.07
343	600988	赤峰黄金	1,000	17,910.00	0.07
344	002603	以岭药业	702	17,901.00	0.07
345	603456	九洲药业	500	17,900.00	0.07
346	300482	万孚生物	200	17,842.00	0.07

347	600068	葛洲坝	2,700	17,766.00	0.07
348	603866	桃李面包	300	17,730.00	0.07
349	002690	美亚光电	400	17,712.00	0.07
350	600150	中国船舶	1,000	17,690.00	0.07
351	600372	中航电子	900	17,685.00	0.07
352	600415	小商品城	3,200	17,632.00	0.07
353	603883	老百姓	280	17,592.40	0.07
354	600637	东方明珠	1,957	17,495.58	0.07
355	002558	巨人网络	1,000	17,430.00	0.07
356	603707	健友股份	490	17,213.70	0.06
357	002373	千方科技	900	17,208.00	0.06
358	002372	伟星新材	920	17,204.00	0.06
359	000932	华菱钢铁	3,580	17,112.40	0.06
360	000021	深科技	900	17,109.00	0.06
361	601117	中国化学	2,900	17,023.00	0.06
362	002223	鱼跃医疗	600	16,926.00	0.06
363	002705	新宝股份	400	16,900.00	0.06
364	600655	豫园股份	1,900	16,891.00	0.06
365	600498	烽火通信	700	16,856.00	0.06
366	600909	华安证券	2,100	16,800.00	0.06
367	002511	中顺洁柔	800	16,696.00	0.06
368	603712	七一二	400	16,660.00	0.06
369	000513	丽珠集团	410	16,605.00	0.06
370	600801	华新水泥	800	16,504.00	0.06
371	002405	四维图新	1,150	16,410.50	0.06
372	002146	荣盛发展	2,500	16,325.00	0.06
373	601099	太平洋	4,000	16,320.00	0.06
374	000739	普洛药业	700	16,296.00	0.06
375	600859	王府井	500	16,290.00	0.06
376	002958	青农商行	3,200	16,288.00	0.06
377	002557	洽洽食品	300	16,155.00	0.06
378	002030	达安基因	470	16,121.00	0.06
379	002429	兆驰股份	2,600	16,120.00	0.06
380	600867	通化东宝	1,200	16,056.00	0.06
381	000738	航发控制	700	16,051.00	0.06
382	002180	纳思达	600	16,038.00	0.06
383	000723	美锦能源	2,400	16,032.00	0.06
384	000987	越秀金控	1,100	16,016.00	0.06
384	600848	上海临港	800	16,016.00	0.06
386	600875	东方电气	1,600	15,952.00	0.06
387	603858	步长制药	690	15,918.30	0.06
388	600380	健康元	1,140	15,857.40	0.06
389	000998	隆平高科	800	15,848.00	0.06
390	600516	方大炭素	2,221	15,702.47	0.06

391	000630	铜陵有色	6,100	15,677.00	0.06
392	600170	上海建工	5,200	15,652.00	0.06
393	000671	阳光城	2,400	15,648.00	0.06
394	002422	科伦药业	800	15,552.00	0.06
395	002153	石基信息	500	15,545.00	0.06
396	600515	海航基础	2,300	15,525.00	0.06
397	603156	养元饮品	600	15,504.00	0.06
398	600208	新湖中宝	5,000	15,500.00	0.06
399	000423	东阿阿胶	400	15,484.00	0.06
400	601231	环旭电子	800	15,472.00	0.06
401	000999	华润三九	620	15,462.80	0.06
402	300383	光环新网	900	15,453.00	0.06
403	002939	长城证券	1,200	15,444.00	0.06
404	600487	亨通光电	1,100	15,389.00	0.06
405	600895	张江高科	900	15,336.00	0.06
406	601077	渝农商行	3,400	15,300.00	0.06
407	002151	北斗星通	300	15,273.00	0.06
408	300168	万达信息	700	15,183.00	0.06
409	600642	申能股份	2,900	15,138.00	0.06
410	600529	山东药玻	300	15,045.00	0.06
411	002081	金螳螂	1,600	15,024.00	0.06
412	300773	拉卡拉	500	14,960.00	0.06
413	002152	广电运通	1,400	14,952.00	0.06
413	603027	千禾味业	400	14,952.00	0.06
415	002065	东华软件	1,800	14,940.00	0.06
416	002212	天融信	700	14,707.00	0.06
417	601997	贵阳银行	1,840	14,628.00	0.06
418	600201	生物股份	700	14,623.00	0.06
419	600221	海航控股	9,600	14,592.00	0.06
420	600497	驰宏锌锗	3,000	14,400.00	0.05
421	002683	宏大爆破	400	14,380.00	0.05
422	002075	沙钢股份	1,300	14,261.00	0.05
423	601992	金隅集团	4,800	14,256.00	0.05
424	000627	天茂集团	2,900	14,123.00	0.05
425	600188	兖州煤业	1,400	14,098.00	0.05
426	002465	海格通信	1,300	14,079.00	0.05
427	300463	迈克生物	300	13,980.00	0.05
428	300418	昆仑万维	700	13,965.00	0.05
429	000988	华工科技	600	13,914.00	0.05
430	600315	上海家化	400	13,892.00	0.05
431	000709	河钢股份	6,200	13,888.00	0.05
432	000027	深圳能源	2,280	13,885.20	0.05
433	002626	金达威	400	13,868.00	0.05
434	600271	航天信息	1,100	13,860.00	0.05

435	601179	中国西电	3,000	13,830.00	0.05
436	300070	碧水源	1,800	13,770.00	0.05
437	300012	华测检测	500	13,685.00	0.05
438	000729	燕京啤酒	1,600	13,632.00	0.05
439	000975	银泰黄金	1,580	13,603.80	0.05
440	600549	厦门钨业	800	13,480.00	0.05
441	000983	山西焦煤	2,390	13,479.60	0.05
442	600297	广汇汽车	4,700	13,442.00	0.05
443	600026	中远海能	2,000	13,360.00	0.05
444	600535	天士力	900	13,311.00	0.05
445	600027	华电国际	3,900	13,260.00	0.05
446	002019	亿帆医药	700	13,251.00	0.05
447	600155	华创阳安	1,000	13,190.00	0.05
448	000686	东北证券	1,340	13,158.80	0.05
449	600153	建发股份	1,600	13,136.00	0.05
450	002563	森马服饰	1,300	13,026.00	0.05
451	600160	巨化股份	1,600	12,976.00	0.05
452	002216	三全食品	500	12,975.00	0.05
453	001914	招商积余	600	12,918.00	0.05
454	002242	九阳股份	400	12,816.00	0.05
455	002506	协鑫集成	3,000	12,750.00	0.05
456	600704	物产中大	2,900	12,673.00	0.05
457	000540	中天金融	4,000	12,600.00	0.05
458	300088	长信科技	1,400	12,446.00	0.05
459	600008	首创股份	4,350	12,310.50	0.05
460	600967	内蒙一机	1,000	12,160.00	0.05
461	601118	海南橡胶	2,500	12,050.00	0.05
462	600688	上海石化	3,500	12,040.00	0.05
463	600879	航天电子	1,600	11,968.00	0.05
464	601106	中国一重	4,000	11,960.00	0.05
465	300271	华宇软件	500	11,935.00	0.04
466	000825	太钢不锈	3,300	11,913.00	0.04
467	002131	利欧股份	3,900	11,817.00	0.04
468	601128	常熟银行	1,600	11,808.00	0.04
469	600583	海油工程	2,600	11,674.00	0.04
470	002281	光迅科技	400	11,616.00	0.04
470	600737	中粮糖业	1,200	11,616.00	0.04
472	000581	威孚高科	500	11,595.00	0.04
473	000623	吉林敖东	700	11,529.00	0.04
474	600528	中铁工业	1,300	11,362.00	0.04
475	600667	太极实业	1,200	11,340.00	0.04
476	600256	广汇能源	4,000	11,320.00	0.04
476	000401	冀东水泥	800	11,320.00	0.04
478	600977	中国电影	900	11,214.00	0.04

479	300376	易事特	1,400	11,144.00	0.04
480	300024	机器人	900	11,070.00	0.04
481	601699	潞安环能	1,700	11,050.00	0.04
482	300212	易华录	360	11,034.00	0.04
483	601598	中国外运	2,500	11,000.00	0.04
484	000402	金融街	1,700	10,965.00	0.04
485	600398	海澜之家	1,700	10,914.00	0.04
486	000629	攀钢钒钛	5,000	10,850.00	0.04
487	600021	上海电力	1,500	10,680.00	0.04
488	600100	同方股份	1,700	10,540.00	0.04
489	601098	中南传媒	1,100	10,483.00	0.04
490	002399	海普瑞	600	10,332.00	0.04
491	600167	联美控股	900	10,215.00	0.04
492	603000	人民网	600	10,140.00	0.04
493	600566	济川药业	500	10,115.00	0.04
494	000089	深圳机场	1,200	9,804.00	0.04
495	300017	网宿科技	1,400	9,646.00	0.04
496	600959	江苏有线	2,900	9,599.00	0.04
497	300296	利亚德	1,500	9,540.00	0.04
498	000028	国药一致	200	9,160.00	0.03
499	002387	维信诺	800	9,120.00	0.03
500	002468	申通快递	900	9,072.00	0.03
501	002010	传化智联	1,900	8,949.00	0.03
502	002439	启明星辰	300	8,763.00	0.03
503	600673	东阳光	1,700	8,551.00	0.03
504	300026	红日药业	1,800	8,244.00	0.03
505	000046	泛海控股	2,500	8,200.00	0.03
506	002572	索菲亚	300	7,770.00	0.03
507	600185	格力地产	1,200	7,752.00	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000858	五粮液	268,255.00	0.74
2	300760	迈瑞医疗	242,887.00	0.67
3	603986	兆易创新	226,277.00	0.63
4	600036	招商银行	197,032.00	0.55
5	600519	贵州茅台	176,240.00	0.49

6	300750	宁德时代	169,845.00	0.47
7	002714	牧原股份	168,588.00	0.47
8	002352	顺丰控股	158,540.00	0.44
9	000661	长春高新	154,633.00	0.43
10	300782	卓胜微	149,215.19	0.41
11	300661	圣邦股份	143,372.00	0.40
12	603993	洛阳钼业	131,035.00	0.36
13	000063	中兴通讯	129,799.00	0.36
14	000001	平安银行	128,725.00	0.36
15	002821	凯莱英	126,056.00	0.35
16	002475	立讯精密	125,905.00	0.35
17	002415	海康威视	124,927.00	0.35
18	300454	深信服	120,278.00	0.33
19	000002	万科 A	102,859.00	0.28
20	603605	珀莱雅	99,771.00	0.28

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	658,274.00	1.82
2	300750	宁德时代	367,025.00	1.02
3	002415	海康威视	324,416.00	0.90
4	002475	立讯精密	310,821.50	0.86
5	000651	格力电器	279,406.00	0.77
6	000002	万科 A	268,374.00	0.74
7	000001	平安银行	263,605.00	0.73
8	002714	牧原股份	259,389.00	0.72
9	300760	迈瑞医疗	232,056.00	0.64
10	000661	长春高新	222,607.00	0.62
11	000333	美的集团	217,770.86	0.60
12	000063	中兴通讯	207,631.00	0.58
13	603986	兆易创新	187,568.00	0.52
14	300782	卓胜微	185,441.00	0.51
15	002304	洋河股份	176,634.00	0.49
16	600519	贵州茅台	173,473.00	0.48
17	002821	凯莱英	167,492.00	0.46

18	002142	宁波银行	166,841.00	0.46
19	000725	京东方 A	162,483.00	0.45
20	300454	深信服	156,691.00	0.43

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	11,484,953.29
卖出股票的收入（成交）总额	18,000,245.31

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	20,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,000.00	0.08

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	190	19,000.00	0.07
2	113616	韦尔转债	10	1,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告

编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,173.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	431.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,605.17

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
242	64,571.79	10,340,923.00	66.18%	5,285,449.00	33.82%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	4,571,293.00	29.25%
2	招商证券股份有限公司	2,446,342.00	15.66%
3	刘晓予	649,147.00	4.15%
4	贺碧燕	534,400.00	3.42%
5	刘晓风	488,406.00	3.13%
6	蒋轩放	320,000.00	2.05%
7	刘晓春	233,328.00	1.49%
8	黄仕梅	218,000.00	1.40%
9	李楚娥	181,600.00	1.16%
10	张栓紧	155,600.00	1.00%
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联接基金	3,316,900.00	21.23%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

注：(参与关联方主承销证券的情况)备注

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(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	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,626,372.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2020 年 8 月 15 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，童威先生离任本基金管理人的总经理。

(2) 2020 年 8 月 22 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，薛珍女士离任本基金管理人的督察长。

(3) 2020 年 10 月 17 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生新任本基金管理人的总经理。

(4) 2020 年 12 月 18 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》，范伟隽先生新任本基金管理人的首席信息官。

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：

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：58,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.7 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稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	18,356,709.50	62.34%	16,728.47	62.05%	-
招商证券	4	6,296,459.65	21.38%	5,864.03	21.75%	-
长江证券	1	4,793,174.11	16.28%	4,367.91	16.20%	-

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东方证券深圳009393交易单元

2020年4月完成租用托管在农业银行的中信建投证券深圳000302交易单元

11.8.2 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	4.49%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	28,392.00	41.97%	-	-	-	-
长江证券	36,215.73	53.54%	-	-	-	-

11.9 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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-15

2	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（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-15
3	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-15
4	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-18
5	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-18
6	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-21
7	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-28
8	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-02-04
9	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（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
10	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（更新）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
11	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年 2 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
12	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2020 年 2 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
13	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
14	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-12
15	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-14
16	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2020-03-25

		定媒介	
17	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-30
18	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-11
19	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-22
20	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-22
21	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新增一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-24
22	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-20
23	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
24	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
25	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-21
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-29
27	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-15
28	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-22
29	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-28
30	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产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-31
31	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方	中国证监会基金电子披	2020-09-28

	式费率优惠活动的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
32	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-28
33	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-17
34	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（星宇转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-24
35	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-27
36	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(大秦转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-16
37	华安基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-18
38	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-18
39	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(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-19
40	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(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-19
41	华安基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-19
42	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产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
43	华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2020 年第 3 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
44	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28
45	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200114-20201231	5,048,845.00	46,345,380.00	46,822,932.00	4,571,293.00	29.25%
联接基金	1	20200101-20201231	10,451,300.00	1,330,000.00	8,464,400.00	3,316,900.00	21.23%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安 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；

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日