

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|------------|---|------------|
| 基金简称 | 华安中国 A 股增强指数 | |
| 基金主代码 | 040002 | |
| 交易代码 | 040002（前端） | 041002（后端） |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2002 年 11 月 8 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,002,582,519.27 份 | |
| 投资目标 | 运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。 | |
| 投资策略 | （1）资产配置：本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市 | |

| | |
|--------|--|
| | <p>场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资：本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 |
|-----------------|----------------------------------|
| | (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
| 1. 本期已实现收益 | 79,486,494.10 |
| 2. 本期利润 | 203,929,433.86 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1006 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,160,190,461.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.079 |

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

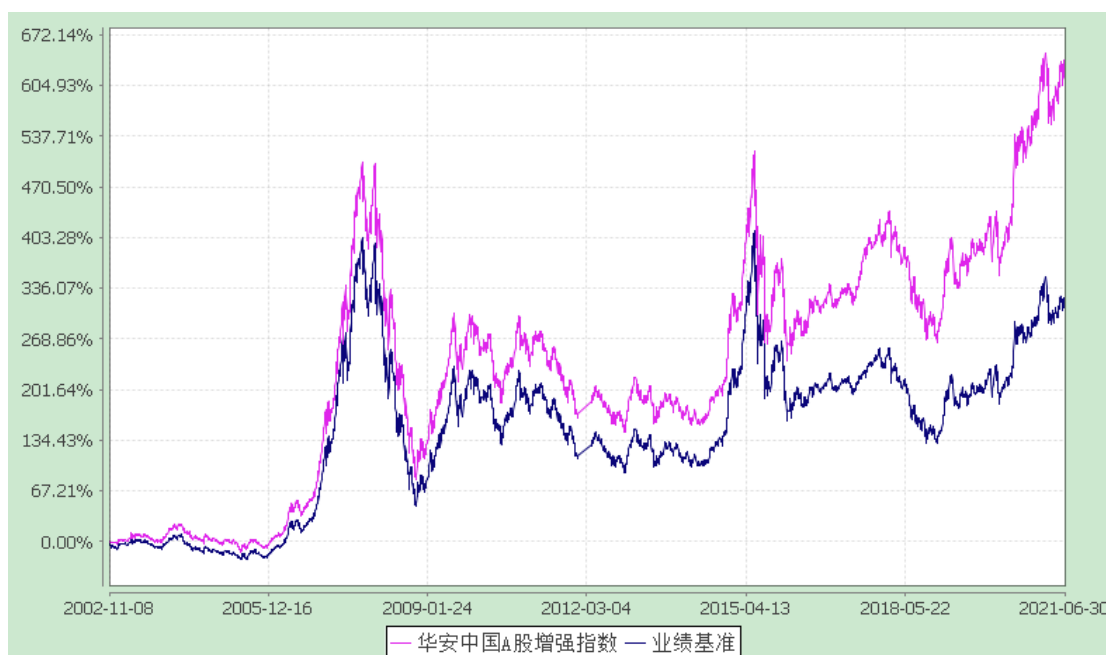
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 10.33% | 1.00% | 6.07% | 0.90% | 4.26% | 0.10% |
| 过去六个月 | 7.47% | 1.37% | 2.73% | 1.22% | 4.74% | 0.15% |
| 过去一年 | 34.07% | 1.38% | 24.96% | 1.26% | 9.11% | 0.12% |
| 过去三年 | 68.52% | 1.37% | 51.10% | 1.32% | 17.42% | 0.05% |
| 过去五年 | 87.41% | 1.20% | 43.33% | 1.14% | 44.08% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 640.73% | 1.56% | 322.16% | 1.54% | 318.57% | 0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来 基金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 股指数增强型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2002 年 11 月 8 日至 2021 年 6 月 30 日）



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------------------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 许之彦 | 本基金的基金经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理 | 2017-12-25 | - | 17 年 | 理学博士，17 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师。2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月,同时担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月,同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月,同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金(2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金)、华安中证银行指数分级证券投资基金(2021 年 1 月起转型为华安中证银行指数型证券投资基金) 的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月,担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安创业板 50 指数型证券投资基金) 的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起,同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起,同时担任华安创业板 50 交</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|----|----------|------------|---|-----|--|
| | | | | | 易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |
| 马韬 | 本基金的基金经理 | 2018-01-15 | - | 6 年 | 硕士研究生，6 年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部数量分析师。2018 年 1 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|-----|----------|---------|-------------------|------------|
| 许之彦 | 公募基金 | 11.00 | 59,074,195,142.53 | 2008-04-25 |
| | 私募资产管理计划 | 3.00 | 292,810,199.40 | 2021-01-22 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 14.00 | 59,367,005,341.93 | - |

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 公平交易专项说明

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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年二季度全球通胀水平抬升，美国由于财政支出力度加大资金面非常宽松，美债收益率震荡下行。国内经济继续保持复苏，货币政策基调继续以稳为主，资金流动性相对宽松。在相对友好的宏观环境下，权益市场在 3 月底触底后开启了近 1 个季度的反弹，尤其以科创板、创业板为代表的新兴经济大幅跑赢市场。

从因子模型表现来看，二季度的大类因子风格与过去两年的风格表现较为不同，成长与估值的分化大幅缩小，分析师预期因子领跑全市场，与此同时盈利因子表现仍然强势。本基金配置上仍然坚持基本面较好且与技术面共振的价值股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.079 元，本报告期份额净值增长率为 10.33%，同期业绩比较基准增长率为 6.07%。

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 年下半年，随着新冠疫苗不断推进全球宏观经济将相继回到正常化水平，虽然疫情的平息大概率还有波折，但正常化的预期不可逆。我们继续维持在一季报中的判断，虽然近期宏观数据实证了工业企业处于景气周期之中，但应该已经逐渐接近短期顶点。国内资金面可能过了最宽松的时候，尤其需要担心海内外联动，出口在下半年可能也逐步度过景气高点。

对证券市场整体的判断应该是震荡偏防御的格局，估值存在一定的压力，配置上将重点考虑后周期板块以及通胀交易板块。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将

在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,038,790,401.43 | 93.67 |
| | 其中：股票 | 2,038,790,401.43 | 93.67 |
| 2 | 固定收益投资 | 88,396,342.36 | 4.06 |
| | 其中：债券 | 88,396,342.36 | 4.06 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 40,434,049.52 | 1.86 |
| 7 | 其他各项资产 | 8,834,193.36 | 0.41 |
| 8 | 合计 | 2,176,454,986.67 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 24,630,325.80 | 1.14 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业 | 648.00 | 0.00 |
| C | 制造业 | 312,197,509.98 | 14.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,105,886.50 | 0.75 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 16,189,762.06 | 0.75 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,541,920.00 | 0.40 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,120,131.13 | 1.02 |
| J | 金融业 | 35,187.10 | 0.00 |
| K | 房地产业 | 404.00 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 242.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 85,810.35 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 399,933,198.29 | 18.51 |

5.2.2 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 203,274.40 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 43,086,931.75 | 1.99 |
| C | 制造业 | 964,659,848.14 | 44.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,643,803.00 | 0.17 |
| E | 建筑业 | 5,079.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 24,531,624.90 | 1.14 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 44,928,467.89 | 2.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | 40,405.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 77,572,879.76 | 3.59 |
| J | 金融业 | 269,988,856.42 | 12.50 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业 | 32,814,918.53 | 1.52 |
| L | 租赁和商务服务业 | 79,962,755.09 | 3.70 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 26,185,173.63 | 1.21 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,602.00 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 24,598,037.67 | 1.14 |
| Q | 卫生和社会工作 | 31,080,062.02 | 1.44 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 15,544,207.94 | 0.72 |
| S | 综合 | 2,276.00 | 0.00 |
| | 合计 | 1,638,857,203.14 | 75.87 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 58,533 | 120,384,821.10 | 5.57 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 1,583,700 | 85,820,703.00 | 3.97 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 104,251 | 55,753,434.80 | 2.58 |
| 4 | 601888 | 中国中免 | 158,770 | 47,646,877.00 | 2.21 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 486,851 | 43,251,842.84 | 2.00 |
| 6 | 000725 | 京东方 A | 6,926,718 | 43,222,720.32 | 2.00 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 1,107,895 | 36,327,877.05 | 1.68 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 541,334 | 34,796,949.52 | 1.61 |
| 9 | 601717 | 郑煤机 | 2,920,515 | 33,965,589.45 | 1.57 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 111,444 | 33,198,053.16 | 1.54 |

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|--------------|
| 1 | 601208 | 东材科技 | 2,657,100.00 | 43,363,872.00 | 2.01 |
| 2 | 300119 | 瑞普生物 | 916,600.00 | 30,999,412.00 | 1.44 |
| 3 | 300572 | 安车检测 | 936,281.00 | 30,372,955.64 | 1.41 |
| 4 | 300761 | 立华股份 | 743,104.00 | 24,619,035.52 | 1.14 |

| | | | | | |
|---|--------|-----|------------|---------------|------|
| 5 | 300696 | 爱乐达 | 590,230.00 | 24,565,372.60 | 1.14 |
|---|--------|-----|------------|---------------|------|

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 80,048,000.00 | 3.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,048,000.00 | 3.71 |
| 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） | 8,348,342.36 | 0.39 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 88,396,342.36 | 4.09 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 210201 | 21 国开 01 | 800,000 | 80,048,000.00 | 3.71 |
| 2 | 123111 | 东财转 3 | 22,319 | 3,266,608.84 | 0.15 |
| 3 | 113047 | 旗滨转债 | 11,830 | 1,886,766.70 | 0.09 |
| 4 | 127036 | 三花转债 | 12,336 | 1,615,892.64 | 0.07 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 7,950 | 905,266.50 | 0.04 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 9 月 29 日，招商银行因违反外汇市场交易管理行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检[2020]76 号）责令改正、并处罚款人民币 120 万元的行政处罚，并对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分。2020 年 11 月 27 日，招商银行因金融机构违反规定办理结汇、售汇的行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检（2020）92 号）责令改正、并处罚款人民币 55 万元、没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚。2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监

罚决字（2021）16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

2021 年 1 月 12 日，杭州银行因经收的海关税款存在延压情况等违法违规事项，被中国人民银行杭州中心支行（杭银处罚字[2021]6 号）给予警告，并处罚款 25 万元的行政处罚。2021 年 5 月 18 日，杭州银行因房地产项目融资业务不审慎等违法违规事项，被中国银保监会浙江监管局（浙银保监罚决字（2021）25 号）给予罚款 250 万元的行政处罚。

本基金投资招商银行、杭银转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 603,022.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,585,732.17 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 846,209.32 |
| 5 | 应收申购款 | 1,799,228.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,834,193.36 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,048,919,498.07 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 72,644,450.15 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 118,981,428.95 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,002,582,519.27 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 20210401-20210630 | 566,601,686.71 | 0.00 | 0.00 | 566,601,686.71 | 28.29% |
| 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。 | | | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》

10.2 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>。

10.3 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

二〇二一年七月二十日