

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
（原华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)）

2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.1.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	6
2.1.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	6
2.2 基金产品说明	7
2.2.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	7
2.2.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.1.2 基金净值表现.....	9
3.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)	10
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2.2 基金净值表现.....	10
4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验.....	11
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.3.1 公平交易制度的执行情况.....	14
4.3.2 异常交易行为的专项说明.....	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析.....	15
4.4.2 报告期内基金的业绩表现.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	17

6.1.1 资产负债表	17
6.1.2 利润表	18
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.1.4 报表附注	20
6.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)	33
6.2.1 资产负债表	33
6.2.2 利润表	34
6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表	35
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	36
6.2.4 报表附注	37
7 投资组合报告	50
7.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	50
7.1.1 期末基金资产组合情况	50
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
7.1.3 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
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	55
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	56
7.1.8 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	56
7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	56
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.1.12 投资组合报告附注	56
7.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)	57
7.2.1 期末基金资产组合情况	57
7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
7.2.4 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	59
7.2.5 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.2.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	61
7.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	61
7.2.9 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	61
7.2.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	61
7.2.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.2.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.2.13 投资组合报告附注	62
8 基金份额持有人信息	63
8.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	63
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63

8.1.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	64
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.2.4 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.....	65
9 开放式基金份额变动.....	65
9.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	65
9.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	65
10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.7.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）.....	66
10.7.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF).....	68
10.8 其他重大事件.....	69
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

基金名称	华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华安量化多因子混合（LOF）
场内简称	华安量化
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月11日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	15,451,218.24份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华安量化多因子混合（LOF）
下属分级基金的场内简称	华安量化
下属分级基金的交易代码	160415
报告期末下属分级基金的份额总额	15,451,218.24份

2.1.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

基金名称	华安深证300指数证券投资基金(LOF)
基金简称	华安深证300（LOF）
场内简称	华安S300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月2日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

报告期末基金份额总额	31,085,420.67份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	华安深证300（LOF）
下属分级基金的场内简称	华安S300
下属分级基金的交易代码	160415
报告期末下属分级基金的份额总额	31,085,420.67份

2.2 基金产品说明

2.2.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

投资目标	通过量化选股模型精选具备投资价值的个股，追求资产的长期增值，在严格控制组合风险同时，力争获得稳定的超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用多因子量化模型投资策略，综合技术、财务、流动性等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.2.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，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	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆滢	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月11日至2019年6月30日)
本期已实现收益	-301,563.79
本期利润	2,954,933.15

加权平均基金份额本期利润	0.1780
本期加权平均净值利润率	16.10%
本期基金份额净值增长率	18.19%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,371,612.20
期末可供分配基金份额利润	-0.2829
期末基金资产净值	18,166,179.35
期末基金份额净值	1.1757
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18.19%

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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

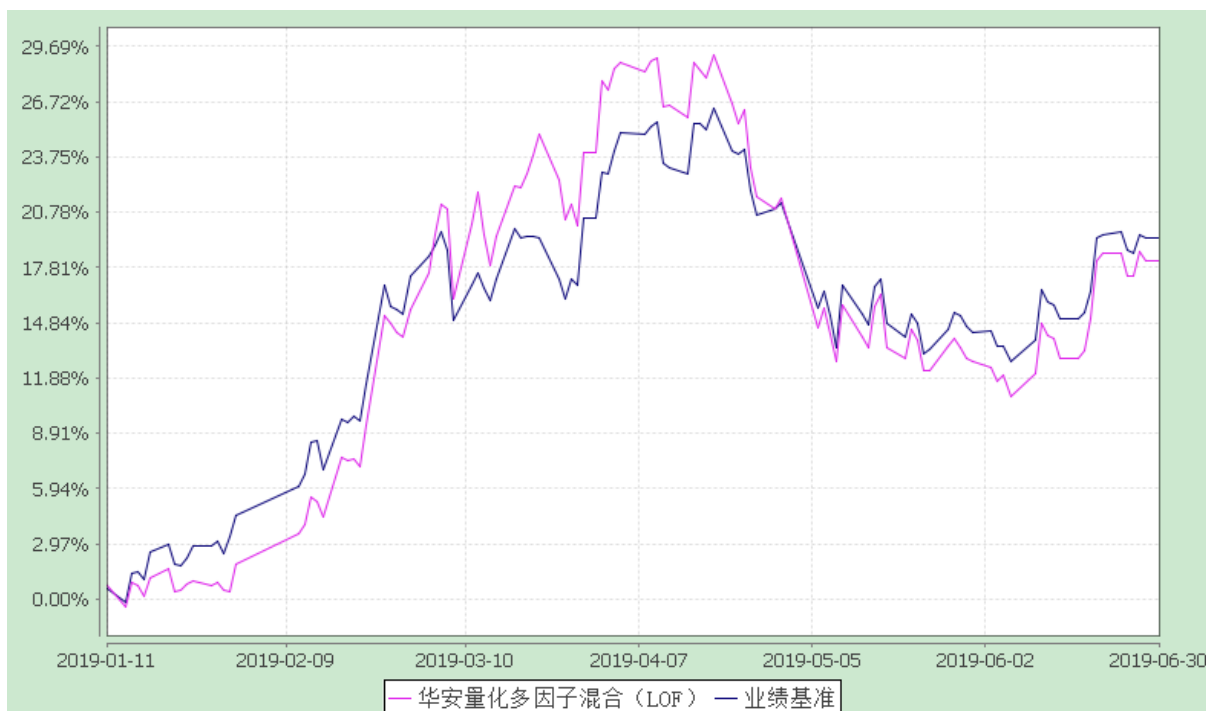
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.81%	1.06%	4.37%	0.93%	0.44%	0.13%
过去三个月	-4.65%	1.42%	-0.90%	1.22%	-3.75%	0.20%
基金转型至今	18.19%	1.49%	19.36%	1.26%	-1.17%	0.23%

3.1.2.2 自基金转型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

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：null

3.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日)
本期已实现收益	-707,508.10
本期利润	529,535.20
加权平均基金份额本期利润	0.0160
本期加权平均净值利润率	2.40%
本期基金份额净值增长率	2.56%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 1 月 10 日)
期末可供分配利润	-9,875,536.23
期末可供分配基金份额利润	-0.3177
期末基金资产净值	21,209,884.44
期末基金份额净值	0.6820
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 1 月 10 日)
基金份额累计净值增长率	-14.17%

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

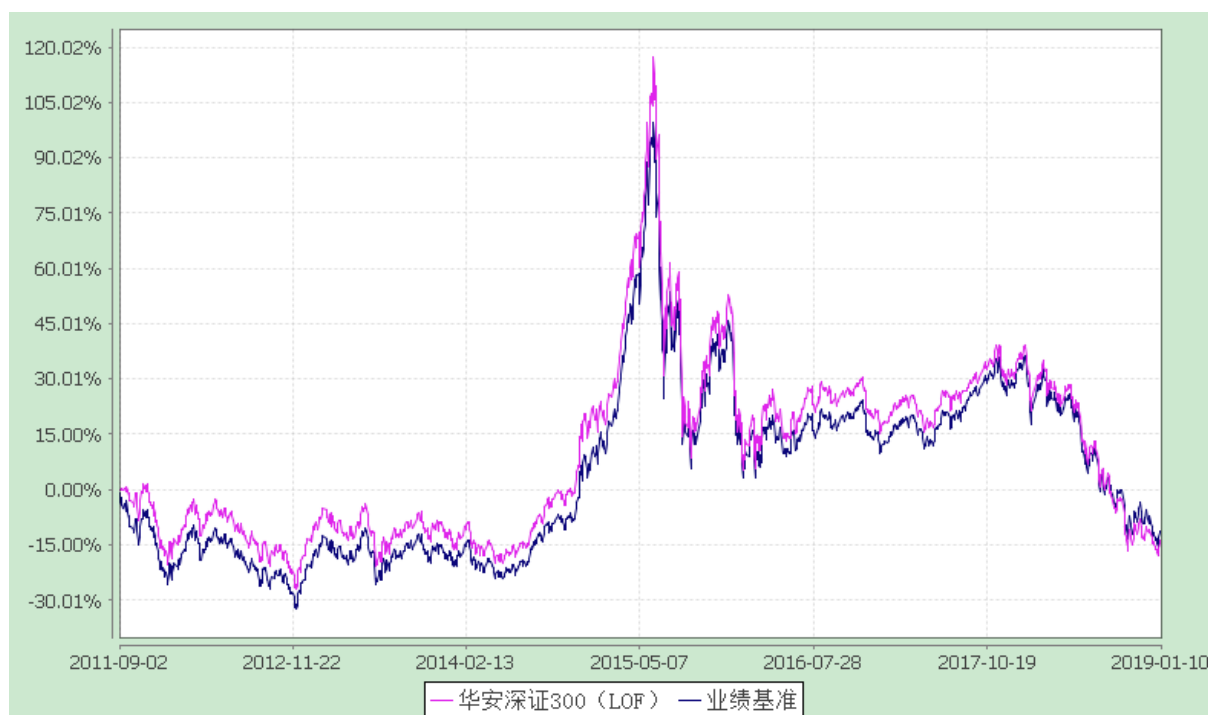
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	-2.85%	0.94%	-2.38%	1.11%	-0.47%	-0.17%
过去三个月	-7.71%	1.55%	-7.00%	1.68%	-0.71%	-0.13%
过去六个月	-22.50%	1.47%	-18.23%	1.55%	-4.27%	-0.08%
过去一年	-37.14%	1.39%	-33.37%	1.45%	-3.77%	-0.06%
过去三年	-32.21%	1.32%	-26.90%	1.29%	-5.31%	0.03%
自基金成立 至今	-14.17%	1.56%	-11.36%	1.54%	-2.81%	0.02%

3.2.2.2 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

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 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、上海、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2019 年 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 123 只开放式基金，管理资产规模达到 3171.00 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的 基金经理、指数 与量化投资部高级 总监、总 经理助理	2011-09-02	2019-03-29	15	理学博士，15 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型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任本基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015

					<p>年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p>
孙晨进	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2015-03-20	-	8	<p>硕士研究生，8 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月至 2019 年 1 月，担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月起，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。2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时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。2016 年 12 月起，同时担任本基金的基金经理。2017 年 1 月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。</p>
马丁	本基金的	2019-03-29	-	3	<p>博士研究生，3 年证券基金行</p>

	基金经理			业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师。2018 年 1 月加入华安基金，担任指数与量化投资部基金经理助理。2019 年 3 月起，担任本基金的基金经理。
--	------	--	--	---

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，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 0 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在企业盈利预期下行和贸易摩擦反复的背景下，基金管理人通过多因子和基本面相结合的选股策略管理本产品。2019 年上半年，工业增加值增速冲高后持续回落，经贸分歧反复，市场乐观情绪消退，预期经济见底时点不断推后。工业企业利润增速处在低位，减税等财政政策对制造业的支持初见成效，消费相关制造业好于上游强周期行业。贸易摩擦使高新科技国产替代迫在眉睫，科创板顺利启动有力支持本土科创企业的发展，为此我们持续加大对科技板块的关注。基金管理人基于量化策略，寻找景气确定性反转和技术确定性革新的板块进行配置，选股方面侧重价值低估标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，华安量化多因子混合基金份额净值为 1.1757 元，本报告期（2019 年 1 月 11 日-2019 年 6 月 30 日）份额净值增长率为 18.19%，同期业绩比较基准增长率为 19.36%。截至 2019 年 1 月 10 日，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）份额净值为 0.6820 元，本报告期（2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 10 日）份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准增长率为 2.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济下行压力不减，积极的财政政策预期依然存在。中美贸易谈判前景不确定性较高，国际贸易摩擦整体在加剧，市场风险偏好可能受到抑制，宏观经济处在探底阶段。预计 CPI 可能有上行压力，制造业景气度在外需回落冲击下可能持续低迷，但是减税有望对利润做正向贡献。科创板将对权益市场有深刻影响，有利于市场风格向成熟市场转变。基金管理人将加大价值策略权重，挖掘新的增长驱动力，基于安全边际、长期产业格局等方面寻找机会，围绕基本面量化的核心策略，力争稳健收益。

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。估值委员会成员由投资总监、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安量化多因子混合型证券投

资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

6.1.1 资产负债表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,617,520.91
结算备付金		44,253.58
存出保证金		20,261.37
交易性金融资产	6.4.7.2	16,671,880.93
其中：股票投资		16,589,542.63
基金投资		-
债券投资		82,338.30
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-

买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.3	425.47
应收股利		-
应收申购款		3,791.62
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		18,358,133.88
负债和所有者权益		本期末 2019 年 6 月 30 日
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		630.00
应付赎回款		40,280.16
应付管理人报酬		21,796.99
应付托管费		3,632.81
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.4	66,095.27
应交税费		0.53
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	59,518.77
负债合计		191,954.53
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.6	22,537,791.55
未分配利润	6.4.7.7	-4,371,612.20
所有者权益合计		18,166,179.35
负债和所有者权益总计		18,358,133.88

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1757 元，基金份额总额 15,451,218.24 份。

6.1.2 利润表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,336,055.44
1.利息收入	6.4.7.8	9,006.39
其中：存款利息收入		8,931.20
债券利息收入		75.19
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）		34,696.83
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-128,353.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.10	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.11	163,050.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	3,256,496.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	35,855.28
减：二、费用		381,122.29
1. 管理人报酬		127,234.95
2. 托管费		21,205.84
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.14	107,236.50
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		0.19
7. 其他费用	6.4.7.15	125,444.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,954,933.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,954,933.15

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 11 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）	31,085,420.67	-9,875,536.23	21,209,884.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,954,933.15	2,954,933.15
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）	-8,547,629.12	2,548,990.88	-5,998,638.24
其中：1.基金申购款	6,857,332.65	-1,526,014.90	5,331,317.75
2.基金赎回款	-15,404,961.77	4,075,005.78	-11,329,955.99
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）	22,537,791.55	-4,371,612.20	18,166,179.35

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：

基金管理公司负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“华安深证 300 基金”）基金转型而来。根据本基金的基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布的《关于华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 9 日表决通过了《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》，同时根据《关于准予华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2018]1030 号）批复，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）于 2019 年 1 月 11 日实施转型。同日起，原《华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）》

失效，《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2019 年 1 月 24 日发布的《关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算比例及停复牌的公告》，基金管理人以 2019 年 1 月 23 日为份额折算基准日，在基金份额持有人持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，将原华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金的基金份额变更登记为华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金份额，基金份额净值为 1.0000 元，基金份额数按折算比例 0.685569884 相应调整。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。投资于股票资产的比例不低于基金资产的 60%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

6.1.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.1.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.1.4.6 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	1,617,520.91
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,617,520.91

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,862,369.96	16,589,542.63	727,172.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	82,338.30	4,238.30
	银行间市场	-	-
	合计	82,338.30	4,238.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	15,940,469.96	16,671,880.93	731,410.97

6.1.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	310.36

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	17.91
应收债券利息	88.54
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	0.47
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.19
合计	425.47

6.1.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	66,095.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	66,095.27

6.1.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.21
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	-
指数使用费	-
预提上市年费	29,752.78
合计	59,518.77

6.1.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月11日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	31,085,420.67	31,085,420.67

-基金份额折算调整	-7,024,205.75	0.00
本期末	15,451,218.24	22,537,791.55

6.1.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	-3,350,146.22	-6,525,390.01	-9,875,536.23
本期利润	-301,563.79	3,256,496.94	2,954,933.15
本期基金份额交易产生的变动数	803,870.15	1,745,120.73	2,548,990.88
其中：基金申购款	-1,287,979.96	-238,034.94	-1,526,014.90
基金赎回款	2,091,850.11	1,983,155.67	4,075,005.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,847,839.86	-1,523,772.34	-4,371,612.20

6.1.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
活期存款利息收入	8,127.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	614.42
其他	189.55
合计	8,931.20

6.1.4.7.9 股票投资收益

6.1.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	37,580,804.82
减：卖出股票成本总额	37,709,158.66
买卖股票差价收入	-128,353.84

6.1.4.7.10 债券投资收益

无。

6.1.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	163,050.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	163,050.67

6.1.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,256,496.94
——股票投资	3,254,200.92
——债券投资	2,296.02
——资产支持证券投资	-
——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	3,256,496.94

6.1.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
基金赎回费收入	35,855.28
合计	35,855.28

6.1.4.7.14 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	107,236.50

银行间市场交易费用	-
合计	107,236.50

6.1.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
审计费	28,108.98
信息披露费	-
银行汇划费用	1,992.12
上市年费	28,108.98
帐户维护费	9,000.00
其他费用	58,234.73
合计	125,444.81

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 或有事项

无。

6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.1.4.9 关联方关系

6.1.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2019年1月11日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	14,393,236.33	20.93%

6.1.4.10.2 债券交易

无。

6.1.4.10.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2019年1月11日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	13,116.75	20.74%	13,116.75	20.74%

6.1.4.10.4 关联方报酬

6.1.4.10.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	127,234.95
其中：支付销售机构的客户维护费	45,011.13

注：支付基金管理人华安基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

6.1.4.10.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月11日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,205.84

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.1.4.10.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月11日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,617,520.91	8,528.49

6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.1.4.11 利润分配情况

无。

6.1.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2019 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。

6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2019 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。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基

金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

6.1.4.13.2 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，并根据本基金的基金管理人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。

6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模

式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

6.1.4.13.4 市场风险

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

6.1.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性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。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	1,617,520.91	-	-	-	1,617,520.91
结算备付金	44,253.58	-	-	-	44,253.58
存出保证金	20,261.37	-	-	-	20,261.37
交易性金融资产	-	-	82,338.30	16,589,542.63	16,671,880.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	425.47	425.47
应收申购款	-	-	-	3,791.62	3,791.62
资产总计	1,682,035.86	-	82,338.30	16,593,759.72	18,358,133.88
应付证券清算款	-	-	-	630.00	630.00
应付赎回款	-	-	-	40,280.16	40,280.16
应付管理人报酬	-	-	-	21,796.99	21,796.99
应付托管费	-	-	-	3,632.81	3,632.81
应付交易费用	-	-	-	66,095.27	66,095.27
应交税费	-	-	-	0.53	0.53
其他负债	-	-	-	59,518.77	59,518.77
负债总计	-	-	-	191,954.53	191,954.53
利率敏感度缺口	1,682,035.86	-	82,338.30	16,401,805.19	18,166,179.35

6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占资产净值的比例为 0.45%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.1.4.13.4.2 外汇风险

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

6.1.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 60%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	16,589,542.63	91.32
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	16,589,542.63	91.32

6.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动
----	-----------------------

除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2019 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 103
	业绩比较基准下降 5%	减少约 103

6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

6.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

6.2.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 1 月 10 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,585,531.58	2,289,380.02
结算备付金		191,849.12	-
存出保证金		28,806.18	35,891.32
交易性金融资产	6.4.7.2	19,578,472.86	21,853,124.91
其中：股票投资		19,556,430.58	21,832,175.35
基金投资		-	-
债券投资		22,042.28	20,949.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		664,859.35	-
应收利息	6.4.7.3	960.38	483.68
应收股利		-	-
应收申购款		4,186.62	3,079.17
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,054,666.09	24,181,959.10

负债和所有者权益		本期末 2019 年 1 月 10 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
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		-	584,294.29
应付赎回款		486,413.99	480.68
应付管理人报酬		3,036.81	10,696.73
应付托管费		607.36	2,139.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	107,838.16	105,272.32
应交税费		0.02	0.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	246,885.31	298,001.69
负债合计		844,781.65	1,000,885.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.6	31,085,420.67	34,834,086.06
未分配利润	6.4.7.7	-9,875,536.23	-11,653,012.05
所有者权益合计		21,209,884.44	23,181,074.01
负债和所有者权益总计		22,054,666.09	24,181,959.10

注：报告截止日 2019 年 1 月 10 日，基金份额净值 0.6820 元，基金份额总额 31,085,420.67 份。

6.2.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日-
一、收入	-	544,016.55	-5,811,003.67
1.利息收入	6.4.7.8	476.68	52,003.67
其中：存款利息收入	-	475.63	51,490.68

债券利息收入	-	1.05	512.99
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）	-	-696,498.70	29,591,001.39
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-696,130.01	28,627,074.75
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-	207,946.78
资产支持证券投资收益	-	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	-	-	-
股利收益	6.4.7.11	-368.69	755,979.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	1,237,043.30	-36,050,010.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	2,995.27	596,001.58
减：二、费用	-	14,481.35	1,732,493.33
1. 管理人报酬	-	3,036.81	428,904.60
2. 托管费	-	607.36	85,780.95
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	5,632.07	946,396.22
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	6.4.7.15	5,205.11	271,410.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	529,535.20	-7,543,497.00
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	529,535.20	-7,543,497.00

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 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）	34,834,086.06	-11,653,012.05	23,181,074.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	529,535.20	529,535.20
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）	-3,748,665.39	1,247,940.62	-2,500,724.77
其中：1.基金申购款	292,896.89	-99,658.10	193,238.79
2.基金赎回款	-4,041,562.28	1,347,598.72	-2,693,963.56
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）	31,085,420.67	-9,875,536.23	21,209,884.44
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	562,710,310.90	25,979,415.59	588,689,726.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,543,497.00	-7,543,497.00
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）	-444,761,843.39	-30,259,338.91	-475,021,182.30
其中：1.基金申购款	2,521,262.36	-5,274.46	2,515,987.90
2.基金赎回款	-447,283,105.75	-30,254,064.45	-477,537,170.20
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）	117,948,467.51	-11,823,420.32	106,125,047.19

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：

基金管理公司负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(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[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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 607,830,415.01 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意，本基金 146,584,084.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2019 年 1 月 10 日发布的《关于华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 9 日表决通过了《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》，同时根据《关于准予华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2018]1030 号）准予注册的批复，本基金于 2019 年 1 月 11 日实施转型。同日起，《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，原《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效。本基金基金份额持有人将按照《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》享有权利并承担义务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的基金投资范围主要为标的指数深证 300 价格指数成份股及其备选成份股，少

量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发等)、债券、现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%；其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%。本基金的业绩比较基准为：95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率。

6.2.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 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 2019 年 1 月 10 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.2.4.6 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 10 日
活期存款	1,585,531.58

定期存款	-
其他存款	-
合计	1,585,531.58

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月10日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,083,458.83	19,556,430.58	-2,527,028.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	20,100.00	22,042.28
	银行间市场	-	-
	合计	20,100.00	22,042.28
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,103,558.83	19,578,472.86	-2,525,085.97

6.2.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月10日
应收活期存款利息	857.20
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	60.41
应收债券利息	11.26
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	1.35
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	30.16
合计	960.38

6.2.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 10 日
交易所市场应付交易费用	107,838.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	107,838.16

6.2.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 10 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,832.44
预提账户维护费	-
预提审计费	1,643.80
预提信息披露费	191,643.80
指数使用费	50,121.47
预提上市年费	1,643.80
合计	246,885.31

6.2.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,834,086.06	34,834,086.06
本期申购	292,896.89	292,896.89
本期赎回（以“-”号填列）	-4,041,562.28	-4,041,562.28
本期末	31,085,420.67	31,085,420.67

6.2.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	-2,981,965.31	-8,671,046.74	-11,653,012.05
本期利润	-707,508.10	1,237,043.30	529,535.20
本期基金份额交易产生的变动数	339,327.19	908,613.43	1,247,940.62

其中：基金申购款	-26,368.23	-73,289.87	-99,658.10
基金赎回款	365,695.42	981,903.30	1,347,598.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,350,146.22	-6,525,390.01	-9,875,536.23

6.2.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日
活期存款利息收入	401.26
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	60.41
其他	13.96
合计	475.63

6.2.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日
卖出股票成交总额	2,815,565.34
减：卖出股票成本总额	3,511,695.35
买卖股票差价收入	-696,130.01

6.2.4.7.10 债券投资收益

无。

6.2.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日
股票投资产生的股利收益	-368.69
基金投资产生的股利收益	-
合计	-368.69

6.2.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 10 日
1.交易性金融资产	1,237,043.30
——股票投资	1,235,950.58
——债券投资	1,092.72
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
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	1,237,043.30

6.2.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月10日
基金赎回费收入	2,995.27
合计	2,995.27

6.2.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月10日
交易所市场交易费用	5,632.07
银行间市场交易费用	-
合计	5,632.07

6.2.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月10日
审计费	1,643.80
信息披露费	1,643.80
银行汇划费用	152.24
上市年费	1,643.80
帐户维护费	-

其他费用	-
指数使用费	121.47
合计	5,205.11

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 或有事项

无。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.2.4.9 关联方关系

6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

无。

6.2.4.10.1.2 债券回购交易

无。

6.2.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月	2018年1月1日至2018年6月

	10日	30日-
当期发生的基金应支付的管理费	3,036.81	428,904.60
其中：支付销售机构的客户维护费	711.93	18,146.31

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：

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

6.2.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月10日	2018年1月1日至2018年6月30日-
当期发生的基金应支付的托管费	607.36	85,780.95

注：支付基金托管人中国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：

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

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.10.4 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	
	2019年1月1日至2019年1月10日		2018年1月1日至2018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
中国银行	1,585,531.58	401.26	8,935,262.86	48,721.56

6.2.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.2.4.11 利润分配情况

无。

6.2.4.12 期末（2019年1月10日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000693	*ST 华泽	2018-06-29	重大风险停牌	3.31	2019-05-27	2.98	1,360.00	29,419.08	4,501.60	

6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 1 月 10 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。

6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 1 月 10 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。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪深证 300 指数，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其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，追求尽可能贴近目标指数的表现。

6.2.4.14 金融工具风险及管理

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

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

6.2.4.14.1 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，并根据本基金的基金管理人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。

6.2.4.14.2 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。

6.2.4.14.3 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。

6.2.4.14.3.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有的利率敏感性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。

6.2.4.14.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年1月10日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,585,531.58	-	-	-	1,585,531.58
结算备付金	191,849.12	-	-	-	191,849.12
存出保证金	28,806.18	-	-	-	28,806.18
交易性金融资产	-	-	22,042.28	19,556,430.58	19,578,472.86
应收证券清算款	-	-	-	664,859.35	664,859.35
应收利息	-	-	-	960.38	960.38
应收申购款	-	-	-	4,186.62	4,186.62
资产总计	1,806,186.88	-	22,042.28	20,226,436.93	22,054,666.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	486,413.99	486,413.99
应付管理人报酬	-	-	-	3,036.81	3,036.81
应付托管费	-	-	-	607.36	607.36
应付交易费用	-	-	-	107,838.16	107,838.16
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	246,885.31	246,885.31
负债总计	-	-	-	844,781.65	844,781.65
利率敏感度缺口	1,806,186.88	-	22,042.28	19,381,655.28	21,209,884.44
上年度末 2018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	2,289,380.02	-	-	-	2,289,380.02
存出保证金	35,891.32	-	-	-	35,891.32
交易性金融资产	-	-	20,949.56	21,832,175.35	21,853,124.91
应收证券清算款	-	-	-	483.68	483.68
应收利息	-	-	-	3,079.17	3,079.17
应收申购款	-	-	-	-	-

资产总计	2,325,271.34	-	20,949.56	21,835,738.20	24,181,959.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	584,294.29	584,294.29
应付赎回款	-	-	-	480.68	480.68
应付管理人报酬	-	-	-	10,696.73	10,696.73
应付托管费	-	-	-	2,139.31	2,139.31
应付交易费用	-	-	-	105,272.32	105,272.32
应付税费	-	-	-	0.07	0.07
其他负债	-	-	-	298,001.69	298,001.69
负债总计	-	-	-	1,000,885.09	1,000,885.09
利率敏感度缺口	2,325,271.34	-	20,949.56	20,834,853.11	23,181,074.01

6.2.4.14.3.1.2 利率风险的敏感性分析

于转型日 2019 年 1 月 10 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占资产净值的比例为 0.10%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.2.4.14.3.2 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。

6.2.4.14.3.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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。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。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。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。

6.2.4.14.3.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 10 日		上年度末 2018 年 6 月 30 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	19,556,430.58	92.20	100,552,700.60	94.75
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	19,556,430.58	92.20	100,552,700.60	94.75

6.2.4.14.3.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 1 月 10 日	上年度末 2018 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	1,024,517.77	1,093,490.91
	业绩比较基准下降 5%	-1,024,517.77	-1,093,490.91

6.2.4.15 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 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2019年1月11日-2019年6月30日）

7.1.1 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	16,589,542.63	90.37
	其中：股票	16,589,542.63	90.37

2	固定收益投资	82,338.30	0.45
	其中：债券	82,338.30	0.45
	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	1,661,774.49	9.05
7	其他各项资产	24,478.46	0.13
8	合计	18,358,133.88	100.00

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	507,168.00	2.79
C	制造业	7,362,205.84	40.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	245,384.73	1.35
E	建筑业	905,999.00	4.99
F	批发和零售业	177,566.40	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	571,967.00	3.15
H	住宿和餐饮业	182,336.00	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	563,749.00	3.10
J	金融业	4,323,899.00	23.80
K	房地产业	956,715.96	5.27
L	租赁和商务服务业	195,030.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	99,389.70	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	182,723.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	315,409.00	1.74
S	综合	-	-
	合计	16,589,542.63	91.32

7.1.3 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	601318	中国平安	7,600	673,436.00	3.71
2	601166	兴业银行	29,200	534,068.00	2.94
3	600872	中炬高新	12,200	522,526.00	2.88
4	600519	贵州茅台	500	492,000.00	2.71
5	000333	美的集团	8,900	461,554.00	2.54
6	600030	中信证券	17,600	419,056.00	2.31
7	601688	华泰证券	17,000	379,440.00	2.09
8	600036	招商银行	10,200	366,996.00	2.02
9	300003	乐普医疗	15,600	359,112.00	1.98
10	000002	万 科 A	12,294	341,896.14	1.88
11	600201	生物股份	20,500	321,645.00	1.77
12	300199	翰宇药业	34,600	317,282.00	1.75
13	300024	机器人	20,600	313,738.00	1.73
14	000001	平安银行	21,900	301,782.00	1.66
15	600390	五矿资本	30,800	290,444.00	1.60
16	002475	立讯精密	11,654	288,902.66	1.59
17	601398	工商银行	47,600	280,364.00	1.54
18	002142	宁波银行	11,500	278,760.00	1.53
19	600362	江西铜业	17,700	278,598.00	1.53
20	601939	建设银行	37,400	278,256.00	1.53
21	600522	中天科技	29,900	274,183.00	1.51
22	002146	荣盛发展	28,138	264,215.82	1.45
23	600219	南山铝业	108,200	244,532.00	1.35
24	002415	海康威视	8,800	242,704.00	1.34
25	600068	葛洲坝	34,500	214,935.00	1.18
26	002153	石基信息	5,700	206,283.00	1.14
27	601111	中国国航	21,300	203,841.00	1.12
28	601888	中国国旅	2,200	195,030.00	1.07
29	002304	洋河股份	1,600	194,496.00	1.07
30	600026	中远海能	29,900	194,051.00	1.07
31	002020	京新药业	16,800	193,536.00	1.07
32	000651	格力电器	3,477	191,235.00	1.05
33	600276	恒瑞医药	2,800	184,800.00	1.02
34	600660	福耀玻璃	8,100	184,113.00	1.01
35	300166	东方国信	14,900	183,121.00	1.01
36	300015	爱尔眼科	5,900	182,723.00	1.01
37	600754	锦江股份	7,400	182,336.00	1.00

38	600795	国电电力	71,600	181,864.00	1.00
39	600104	上汽集团	7,100	181,050.00	1.00
40	601169	北京银行	30,500	180,255.00	0.99
41	601898	中煤能源	37,400	179,520.00	0.99
42	000156	华数传媒	16,300	179,463.00	0.99
43	600808	马钢股份	52,600	179,366.00	0.99
44	601390	中国中铁	27,400	178,648.00	0.98
45	002236	大华股份	12,300	178,596.00	0.98
46	000963	华东医药	6,840	177,566.40	0.98
47	600000	浦发银行	15,200	177,536.00	0.98
48	000926	福星股份	25,600	177,152.00	0.98
49	601117	中国化学	29,000	174,580.00	0.96
50	600728	佳都科技	17,700	174,345.00	0.96
51	601000	唐山港	63,300	174,075.00	0.96
52	600657	信达地产	42,100	173,452.00	0.95
53	600971	恒源煤电	29,640	173,394.00	0.95
54	601877	正泰电器	7,500	173,175.00	0.95
55	601618	中国中冶	55,900	169,936.00	0.94
56	601668	中国建筑	29,200	167,900.00	0.92
57	600176	中国巨石	17,220	164,106.60	0.90
58	000776	广发证券	11,900	163,506.00	0.90
59	300124	汇川技术	7,100	162,661.00	0.90
60	600028	中国石化	28,200	154,254.00	0.85
61	600089	特变电工	21,100	152,975.00	0.84
62	002092	中泰化学	19,100	152,036.00	0.84
63	600881	亚泰集团	45,000	146,250.00	0.81
64	300133	华策影视	20,200	135,946.00	0.75
65	600118	中国卫星	4,710	106,210.50	0.58
66	000826	启迪桑德	8,430	99,389.70	0.55
67	002078	太阳纸业	13,468	91,717.08	0.50
68	002572	索菲亚	4,900	90,944.00	0.50
69	300394	天孚通信	3,200	88,384.00	0.49
70	600183	生益科技	5,800	87,290.00	0.48
71	600879	航天电子	14,100	86,856.00	0.48
72	300602	飞荣达	3,300	85,404.00	0.47
73	300677	英科医疗	5,300	85,118.00	0.47
74	603186	华正新材	3,000	85,110.00	0.47
75	600027	华电国际	16,849	63,520.73	0.35

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600390	五矿资本	652,685.00	3.08
2	600872	中炬高新	536,251.00	2.53
3	002153	石基信息	533,796.00	2.52
4	601166	兴业银行	508,195.00	2.40
5	600126	杭钢股份	507,749.10	2.39
6	601333	广深铁路	505,616.00	2.38
7	601009	南京银行	504,548.00	2.38
8	601898	中煤能源	490,446.00	2.31
9	601169	北京银行	484,744.00	2.29
10	601318	中国平安	484,252.00	2.28
11	600879	航天电子	483,831.00	2.28
12	600875	东方电气	482,704.00	2.28
13	601818	光大银行	468,448.00	2.21
14	600519	贵州茅台	449,861.00	2.12
15	000333	美的集团	449,183.00	2.12
16	600362	江西铜业	446,419.36	2.10
17	002236	大华股份	436,681.00	2.06
18	600522	中天科技	403,447.00	1.90
19	600487	亨通光电	400,859.60	1.89
20	300024	机器人	396,277.00	1.87

7.1.4.2 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	000333	美的集团	901,770.54	4.25
2	000651	格力电器	808,717.45	3.81
3	300498	温氏股份	705,998.68	3.33
4	000990	诚志股份	611,671.00	2.88
5	600875	东方电气	600,421.95	2.83
6	601009	南京银行	571,144.00	2.69
7	600126	杭钢股份	508,352.00	2.40
8	601333	广深铁路	507,809.00	2.39
9	600390	五矿资本	502,253.00	2.37
10	000877	天山股份	501,147.96	2.36
11	002415	海康威视	487,495.79	2.30
12	000858	五粮液	483,244.30	2.28
13	601818	光大银行	448,943.00	2.12
14	600879	航天电子	447,900.00	2.11

15	000600	建投能源	409,167.00	1.93
16	000001	平安银行	399,752.32	1.88
17	002236	大华股份	395,480.67	1.86
18	002153	石基信息	394,361.00	1.86
19	000028	国药一致	386,916.00	1.82
20	600487	亨通光电	385,948.00	1.82

7.1.4.3 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	31,488,069.79
卖出股票的收入（成交）总额	37,580,804.82

7.1.5 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）	82,338.30	0.45
8	其他	-	-
9	合计	82,338.30	0.45

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110051	中天转债	490	51,508.80	0.28
2	128045	机电转债	142	15,585.92	0.09
3	110056	亨通转债	90	8,882.10	0.05
4	128048	张行转债	43	4,511.56	0.02
5	128047	光电转债	16	1,849.92	0.01

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.1.8 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。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1 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。

7.1.10.2 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，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 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。

7.1.11.2 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	20,261.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	425.47
5	应收申购款	3,791.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,478.46

7.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	128045	机电转债	15,585.92	0.09
2	128048	张行转债	4,511.56	0.02
3	128047	光电转债	1,849.92	0.01

7.1.12.5 期末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。

7.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

（报告期：2019年1月1日-2019年1月10日）

7.2.1 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	19,556,430.58	88.67
	其中：股票	19,556,430.58	88.67
2	固定收益投资	22,042.28	0.10
	其中：债券	22,042.28	0.10
	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	1,777,380.70	8.06
7	其他各项资产	698,812.53	3.17
8	合计	22,054,666.09	100.00

7.2.2 报告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	678,342.66	3.20
B	采矿业	63,748.16	0.30
C	制造业	11,458,066.57	54.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,083.98	0.74
E	建筑业	108,528.58	0.51
F	批发和零售业	437,280.39	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	184,250.98	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,567,159.37	7.39
J	金融业	1,499,538.19	7.07
K	房地产业	1,379,719.17	6.51
L	租赁和商务服务业	184,406.54	0.87
M	科学研究和技术服务业	48,728.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	87,248.29	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	228,291.68	1.08
R	文化、体育和娱乐业	330,344.02	1.56
S	综合	41,705.40	0.20
	合计	18,454,441.98	87.01

7.2.3 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,501.60	0.02
C	制造业	728,342.00	3.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,476.00	0.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,574.00	0.79
J	金融业	25,200.00	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,840.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	80,055.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	1,101,988.60	5.20

7.2.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.2.4.1 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	000333	美的集团	22,165	870,862.85	4.11
2	000651	格力电器	22,942	866,289.92	4.08
3	000002	万科A	21,295	534,717.45	2.52
4	300498	温氏股份	17,863	497,841.81	2.35
5	002415	海康威视	17,185	486,851.05	2.30
6	000858	五粮液	8,752	436,374.72	2.06
7	000001	平安银行	39,268	396,606.80	1.87
8	000725	京东方A	120,838	322,637.46	1.52
9	002304	洋河股份	2,741	252,692.79	1.19
10	300059	东方财富	18,378	229,908.78	1.08

7.2.4.2 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	300750	宁德时代	1,400	106,792.00	0.50
2	300760	迈瑞医疗	800	82,656.00	0.39

3	000860	顺鑫农业	1,900	65,018.00	0.31
4	300347	泰格医药	1,600	61,840.00	0.29
5	002180	纳思达	2,000	50,300.00	0.24

7.2.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.5.1 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

无。

7.2.5.2 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	002027	分众传媒	221,613.52	0.96
2	300124	汇川技术	122,453.24	0.53
3	000651	格力电器	97,187.90	0.42
4	000333	美的集团	94,720.85	0.41
5	002460	赣锋锂业	90,854.72	0.39
6	000728	国元证券	82,811.56	0.36
7	300070	碧水源	68,216.84	0.29
8	300146	汤臣倍健	68,164.82	0.29
9	000002	万 科 A	61,058.84	0.26
10	000503	国新健康	57,931.00	0.25
11	300498	温氏股份	55,996.59	0.24
12	002508	老板电器	53,579.80	0.23
13	000839	中信国安	51,569.91	0.22
14	002415	海康威视	51,139.10	0.22
15	002506	协鑫集成	50,469.06	0.22
16	000066	中国长城	49,919.00	0.22
17	002310	东方园林	47,148.64	0.20
18	000001	平安银行	45,509.00	0.20
19	300274	阳光电源	45,427.00	0.20
20	000858	五 粮 液	43,879.50	0.19

7.2.5.3 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	0.00
卖出股票的收入（成交）总额	2,815,565.34

7.2.6 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	22,042.28	0.10
8	其他	-	-
9	合计	22,042.28	0.10

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（%）
2	128045	机电转债	142	15,852.88	0.07
4	128048	张行转债	43	4,418.68	0.02
5	128047	光电转债	16	1,770.72	0.01

7.2.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.9 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。

7.2.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.11.1 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。

7.2.11.2 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，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货

合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.2.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

7.2.13 投资组合报告附注

7.2.13.1 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。

7.2.13.2 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。

7.2.13.3 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	28,806.18
2	应收证券清算款	664,859.35
3	应收股利	-
4	应收利息	960.38
5	应收申购款	4,186.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	698,812.53

7.2.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产
----	------	------	------	-------

				净值比例(%)
1	128045	机电转债	15,852.88	0.07
2	128048	张行转债	4,418.68	0.02
3	128047	光电转债	1,770.72	0.01

7.2.13.5 期末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。

8 基金份额持有人信息

8.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2019年1月11日-2019年6月30日）

8.1.1 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
1,369	11,286.50	0.00	0.00%	15,451,218.24	100.00%

8.1.2 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	望月英里	1,363,085.40	8.82%
2	蔺杰	619,774.06	4.01%
3	林志英	582,590.89	3.77%
4	朱若增	339,622.41	2.20%
5	李少芳	339,499.01	2.20%
6	蒋冰	339,421.88	2.20%
7	韩超	267,346.13	1.73%
8	易丰	241,111.50	1.56%
9	卢奕	234,753.88	1.52%
10	袁宁	224,246.14	1.45%

8.1.3 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	165,535.84	1.07%

员持有本基金		
--------	--	--

8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

（报告期：2019年1月1日-2019年1月10日）

8.2.1 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
1,345	23,111.84	0.00	0.00%	31,085,420.67	100.00%

8.2.2 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	叶俊琼	7,011,220.20	22.55%
2	望月英里	1,988,251.57	6.40%
3	高盼	1,391,393.39	4.48%
4	蔺杰	904,027.44	2.91%
5	林志英	849,790.65	2.73%
6	金幼文	695,697.39	2.24%
7	易丰	637,474.74	2.05%
8	朱若增	495,387.00	1.59%
9	李少芳	495,207.00	1.59%
10	蒋冰	495,094.50	1.59%

8.2.3 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	239,025.65	0.77%

8.2.4 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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

9 开放式基金份额变动

9.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2019年1月11日-2019年6月30日）

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 11 日）基金份额 总额	31,085,420.67
本报告期期初基金份额总额	31,085,420.67
本报告期基金总申购份额	4,710,351.79
减：本报告期基金总赎回份额	13,320,348.47
本报告期基金拆分变动份额	-7,024,205.75
本报告期期末基金份额总额	15,451,218.24

9.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

（报告期：2019年1月1日-2019年1月10日）

单位：份

基金合同生效日（2011 年 9 月 2 日）基金份额 总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	34,834,086.06
本报告期基金总申购份额	292,896.89
减：本报告期基金总赎回份额	4,041,562.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,085,420.67

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2018 年 12 月 11 日至 2019 年 1 月 7 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过了《关于华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关

事项的议案》，决议自 2019 年 1 月 9 日起生效，并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金修改后的《华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》自 2019 年 1 月 11 日起生效。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布的《关于华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布了《关于华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2019 年 1 月 11 日起“华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）”转型为“华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）”，基金的投资策略作出相应的改变。详情请见本基金管理人发布的相关公告。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚的情况

2019 年 1 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2019 年 2 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2019年1月11日-2019年6月30日）

10.7.1.1 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	
长江证券	1	25,182,356.84	36.62%	22,948.80	36.28%	-
国泰君安	1	14,393,236.33	20.93%	13,116.75	20.74%	-
安信证券	1	8,840,289.19	12.86%	8,232.90	13.02%	-
国信证券	1	7,329,999.83	10.66%	6,826.36	10.79%	-
中泰证券	1	6,816,823.34	9.91%	6,348.80	10.04%	-
西南证券	1	6,201,215.60	9.02%	5,774.86	9.13%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2019 年 5 月完成租用托管在中国银行的招商证券上海 36598 交易单元。

10.7.2 华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)

（报告期：2019年1月1日-2019年1月10日）

10.7.2 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	
长江证券	1	2,815,565.34	100.00%	2,565.84	100.00%	-

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，最大限度地调调整体资源，为基金投资赢取机会；
- （4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2019 年 5 月完成租用托管在中国银行的招商证券上海 36598 交易单元。

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	关于旗下部分基金参加基煜基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-15
2	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-18
3	华安基金关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-23
4	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）开通系统内转托管和跨系统转托管业务的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-23
5	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算比例及停复牌的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-24
6	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）份额折算结果公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-25
7	华安基金关于旗下基金参加中国中投证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-27
8	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
9	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-30
10	关于华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-30
11	华安基金关于旗下基金参加中金公司优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-08
12	华安基金关于旗下基金参加植信基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-12
13	关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构	《证券时报》和公司网站	2019-04-08

	的公告	网站	
14	华安基金关于旗下基金参加民生银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-14
15	华安基金关于旗下基金参加海银基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-28
16	华安基金关于参加长城国瑞证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-17
17	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-21
18	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
19	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《证券时报》和公司网站

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

11.1.1 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

无。

11.2 华安深证300指数证券投资基金(LOF)

11.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20190101-20190110	7,011,220.20	0.00	7,011,220.20	0.00	0.00%
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。							

11.3 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、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》
- 2、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 3、《华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中国证监会批准华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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住所，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
二〇一九年八月二十八日