

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

2021 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43

8	基金份额持有人信息	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2	期末上市基金前十名持有人	45
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	45
9	开放式基金份额变动	45
10	重大事件揭示	46
10.1	基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	46
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	48
10.9	其他重大事件	49
11	影响投资者决策的其他重要信息	50
12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	51
12.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	华安中证 500 低波 ETF
场内简称	500 低波
基金主代码	512260
交易代码	512260
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,697,720.00 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	2019 年 1 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 行业中性低波动指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区金融大街25号

	世纪大道8号国金中心二期31 -32层	
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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	14,075,691.75
本期利润	12,572,867.45
加权平均基金份额本期利润	0.1251
本期加权平均净值利润率	8.89%
本期基金份额净值增长率	9.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	44,452,765.57
期末可供分配基金份额利润	0.4848
期末基金资产净值	136,150,485.57
期末基金份额净值	1.4848
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.48%

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

所列数字。

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

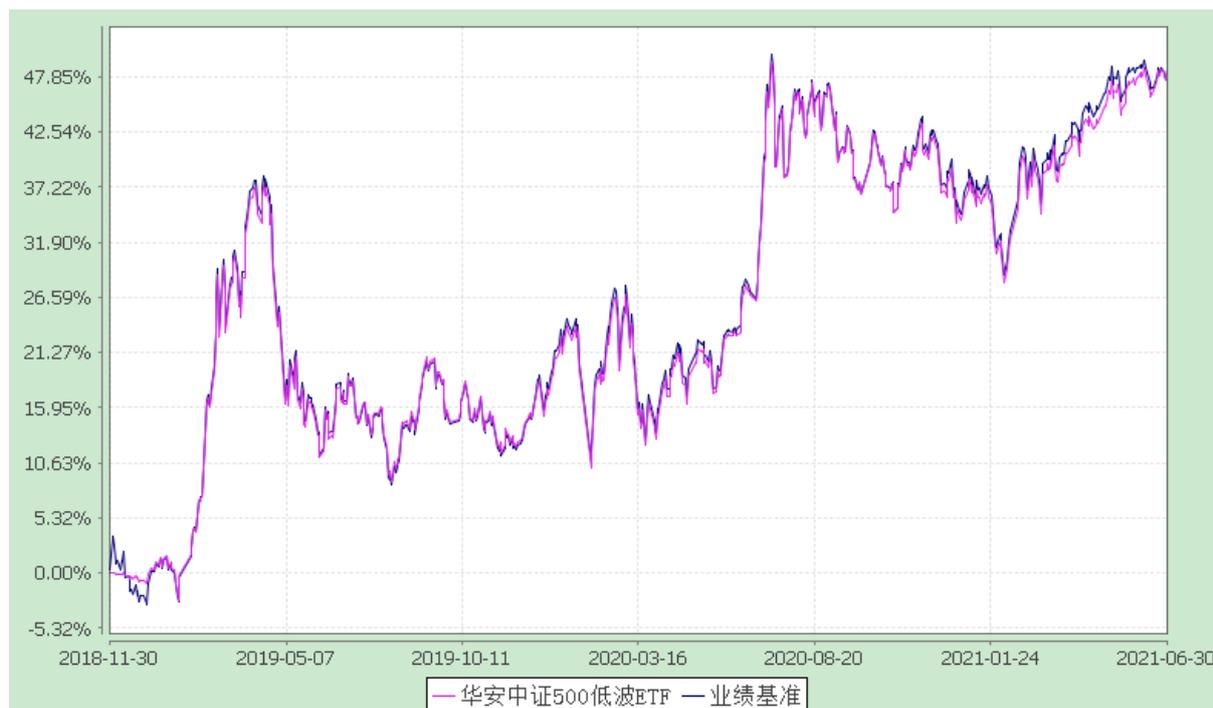
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.68%	0.44%	-0.14%	0.42%	0.82%	0.02%
过去三个月	6.48%	0.53%	5.65%	0.54%	0.83%	-0.01%
过去六个月	9.26%	0.82%	8.64%	0.84%	0.62%	-0.02%
过去一年	15.95%	1.08%	15.72%	1.12%	0.23%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	48.48%	1.27%	48.46%	1.31%	0.02%	-0.04%

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

华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2018 年 11 月 30 日至 2021 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 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 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏卿云	本基金的基金	2018-11-30	-	13 年	硕士研究生，13 年证券行业从业

	<p>经理、指数与 量化投资部副 总监</p>			<p>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, 历任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月至 2021 年 3 月, 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 月至 2021 年 3 月, 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 月至 2021 年 3 月, 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 月至 2021 年 3 月, 同时担任华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起, 同时担任华安中证银行指数型证券投资</p>
--	---------------------------------	--	--	--

					基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，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

2021 年上半年，随着国民经济稳中向好，工业生产需求稳定恢复，企业经营状况持续改善，企业利润平稳较快增长。从经济指标来看，上半年，全国规模以上工业企业利润同比增长 66.9%，过去两年平均增长 20.6%。分行业来看，上游采矿业和原材料制造业企业利润增长明显，在经济向好、需求扩大、价格上涨、上年同期基数较低等因素共同作用下，化工、钢铁、煤炭行业利润同比分别增长 1.77 倍、2.34 倍、1.14 倍。高技术和装备制造业利润保持较快增长，上半年，高技术制造业利润同比增长 62.0%；两年平均增长 36.2%。消费品制造业利润加快恢复，上半年，消费品制造业利润同比增长 38.6%；两年平均增长 17.0%，比一季度加快 1.6 个百分点，恢复态势进一步巩固。从证券市场风格来看，上半年，估值水平处于低位的中盘股的代表指数中证 500 表现优于大盘指数沪深 300。在中证 500 指数内部，低波动因子表现出一定的超额收益。

基金跟踪的指数是中证 500 行业中性低波动指数（简称：500SNLV，代码 930782）。该指数的

行业权重与中证 500 保持一致。在各个行业内部，按照波动率进行筛选，共选出波动率最低的 150 个股票，并按照波动率的倒数进行加权。该指数的风格与中证 500 趋于一致，估值水平显著低于中证 500。截至 2021 年年上半年末，500SNLV 指数的动态市盈率 (P/E) 为 14.12，股息率 2.46；同期，中证 500 指数的动态市盈率 (P/E) 为 22.01，股息率 1.43。相对于中证 500 指数，体现出了低估值、高股息率的特征。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，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 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4848 元，本报告期份额净值增长率为 9.26%，同期业绩比较基准增长率为 8.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济稳中向好，工业生产进一步恢复，消费快速复苏，经济增长的势头将继续保持。随着货币政策回归正常化，市场的风格切换已经发生，部分板块和行业由于估值处于高位，具有一定的压力。而以中证 500 指数为代表的中盘股由于估值水平相对处于低位，具有较高的性价比，有继续提升的空间。在中证 500 指数板块内，低波动、低估值、高股息的资产有望继续保持较好表现。特别是，中证 500 行业中性低波动指数的估值水平和股息率等指标要显著优于中证 500 指数，投资价值凸显。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法

的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,267,579.21	3,185,477.29
结算备付金		25,241.66	362,058.11
存出保证金		15,371.79	41,884.39
交易性金融资产	6.4.7.2	131,187,419.63	154,219,651.60
其中：股票投资		131,187,419.63	154,219,651.60
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	462.17	492.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		136,496,074.46	157,809,563.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,761.84	68,058.24
应付托管费		11,352.35	13,611.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	153,214.55	277,263.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,260.15	213,000.00
负债合计		345,588.89	571,933.48
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	91,697,720.00	115,697,720.00

未分配利润	6.4.7.10	44,452,765.57	41,539,910.18
所有者权益合计		136,150,485.57	157,237,630.18
负债和所有者权益总计		136,496,074.46	157,809,563.66

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4848 元，基金份额总额 91,697,720.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		13,414,765.98	18,560,270.67
1.利息收入		7,057.39	21,371.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,011.68	21,016.93
债券利息收入		45.71	354.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,758,098.24	19,123,338.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,094,723.23	16,427,908.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	48,358.13	475,741.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,615,016.88	2,219,688.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,502,824.30	-700,944.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	152,434.65	116,504.83
减：二、费用		841,898.53	1,481,757.31
1. 管理人报酬		350,103.76	572,701.96
2. 托管费		70,020.69	114,540.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	261,283.69	631,483.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.17	1.17
7. 其他费用	6.4.7.21	160,490.22	163,030.58

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,572,867.45	17,078,513.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,572,867.45	17,078,513.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	115,697,720.00	41,539,910.18	157,237,630.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,572,867.45	12,572,867.45
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）	-24,000,000.00	-9,660,012.06	-33,660,012.06
其中：1.基金申购款	25,600,000.00	9,971,905.17	35,571,905.17
2.基金赎回款	-49,600,000.00	-19,631,917.23	-69,231,917.23
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）	91,697,720.00	44,452,765.57	136,150,485.57
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	215,697,720.00	41,505,271.55	257,202,991.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,078,513.36	17,078,513.36
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）	-54,400,000.00	-13,325,887.59	-67,725,887.59
其中：1.基金申购款	145,600,000.00	29,040,959.35	174,640,959.35
2.基金赎回款	-200,000,000.00	-42,366,846.94	-242,366,846.94
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）	161,297,720.00	45,257,897.32	206,555,617.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证 500 行业中性低波动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 945 号《关于准予华安中证 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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 352,497,720.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0715 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2018 年 11 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 352,497,720.00 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]4 号文核准同意，本基金 352,497,720.00 份基金份额于 2019 年 1 月 11 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《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为中证 500 行业中性低波动指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、衍生工具(权证、股指期货等)、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(包括协议存款、定期存款及

其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金管理人在履行适当程序后,本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产的 90%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证 500 行业中性低波动指数收益率。

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,于 2019 年 1 月 15 日募集成立了华安中证 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(以下简称“华安中证 500 低波 ETF 联接基金”)。华安中证 500 低波 ETF 联接基金为契约型开放式基金,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 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中证 500 行业中性低波动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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,267,579.21
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,267,579.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,361,146.73	131,187,419.63	-173,727.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	131,361,146.73	131,187,419.63	-173,727.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	445.70
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	10.26
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	6.21
合计	462.17

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	153,214.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	153,214.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
应付指数使用费	35,000.00
合计	124,260.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,697,720.00	115,697,720.00
本期申购	25,600,000.00	25,600,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-49,600,000.00	-49,600,000.00
本期末	91,697,720.00	91,697,720.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,218,538.20	-4,678,628.02	41,539,910.18
本期利润	14,075,691.75	-1,502,824.30	12,572,867.45
本期基金份额交易产生的变动数	-10,196,833.82	536,821.76	-9,660,012.06
其中：基金申购款	10,394,255.74	-422,350.57	9,971,905.17
基金赎回款	-20,591,089.56	959,172.33	-19,631,917.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,097,396.13	-5,644,630.56	44,452,765.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,480.00
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	1,328.89
其他	202.79
合计	7,011.68

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,162,201.66
股票投资收益——赎回差价收入	932,521.57
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,094,723.23

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	91,266,384.99
减：卖出股票成本总额	79,104,183.33
买卖股票差价收入	12,162,201.66

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	69,231,917.23
减：现金支付赎回款总额	27,149,563.23
减：赎回股票成本总额	41,149,832.43
赎回差价收入	932,521.57

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	291,205.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	242,800.00
减：应收利息总额	47.09
买卖债券差价收入	48,358.13

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,615,016.88
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,615,016.88

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-1,502,824.30
——股票投资	-1,502,824.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,502,824.30

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	152,434.65
合计	152,434.65

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

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	261,283.69
银行间市场交易费用	-
合计	261,283.69

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	1,230.07
合计	160,490.22

注：根据《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基金合同》、《中证指数使用许可协议》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支。在 2020 年 1 月 1 日前，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，收取下限为每季 5 万元。逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。

根据《关于国内市场 A 股 ETF 收费调整的通知》，自 2020 年 1 月 1 日起，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。具体就每个计费季度而言，当季度日均基金资产净值(日均基金资产净值 = 基金当季存续日的基金资产净值之和 / 基金当季存续天数，下同)大于人民币 5,000 万元时，收取下限为每季 3.5 万元；当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元

的，指数许可使用的按照按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人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，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
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	本基金的联接基金
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
国泰君安证券股份	57,480,577.15	34.09%	399,150.00	0.10%

有限公司				
------	--	--	--	--

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
国泰君安证券股份有限公司	230,034.62	43.08%	712,900.00	19.96%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	占期末应付佣金总量的 比例
国泰君安证券股份有限公司	52,382.11	33.78%	50,545.38	32.99%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	占期末应付佣金总量的 比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	350,103.76	572,701.96
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,020.69	114,540.38

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
中国建设银行股份有限公司—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	8,859,100.00	9.66%	8,729,100.00	7.54%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
中国建设银行	5,267,579.21	5,480.00	6,835,956.61	16,748.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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
600811	东方集团	2021-06-30	重大事项或临时停牌	3.05	2021-07-14	3.36	410,300.00	1,489,522.85	1,251,415.00	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	5,267,579.21	-	-	-	5,267,579.21
结算备付金	25,241.66	-	-	-	25,241.66
存出保证金	15,371.79	-	-	-	15,371.79
交易性金融资产	-	-	-	131,187,419.63	131,187,419.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	462.17	462.17
资产总计	5,308,192.66	-	-	131,187,881.80	136,496,074.46

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	-	-	-	56,761.84	56,761.84
应付托管费	-	-	-	11,352.35	11,352.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	153,214.55	153,214.55
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	124,260.15	124,260.15
负债总计	-	-	-	345,588.89	345,588.89
利率敏感度缺口	5,308,192.66	-	-	130,842,292.91	136,150,485.57
上年度末 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	3,185,477.29	-	-	-	3,185,477.29
结算备付金	362,058.11	-	-	-	362,058.11
存出保证金	41,884.39	-	-	-	41,884.39
交易性金融资产	-	-	-	154,219,651.60	154,219,651.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	492.27	492.27
资产总计	3,589,419.79	-	-	154,220,143.87	157,809,563.66
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	-	-	-	-	-

产款					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	68,058.24	68,058.24
应付托管费	-	-	-	13,611.64	13,611.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	277,263.60	277,263.60
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	213,000.00	213,000.00
负债总计	-	-	-	571,933.48	571,933.48
利率敏感度缺口	3,589,419.79	-	-	153,648,210.39	157,237,630.18

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、

资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	131,187,419.63	96.35	154,219,651.60	98.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	131,187,419.63	96.35	154,219,651.60	98.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 668	增加约 768
	业绩比较基准下降 5%	减少约 668	减少约 768

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	131,187,419.63	96.11
	其中：股票	131,187,419.63	96.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,292,820.87	3.88
8	其他各项资产	15,833.96	0.01
9	合计	136,496,074.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,194,578.00	3.08
B	采矿业		

		5,276,129.38	3.88
C	制造业	74,286,648.76	54.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,241,999.00	2.38
E	建筑业	6,266,401.00	4.60
F	批发和零售业	3,820,816.41	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	2,775,202.92	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,123,955.00	7.44
J	金融业	7,533,534.90	5.53
K	房地产业	4,350,505.56	3.20
L	租赁和商务服务业	1,530,588.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,311,763.10	3.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,216,949.60	0.89
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,211,280.00	0.89
S	综合	1,047,068.00	0.77
	合计	131,187,419.63	96.35

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002223	鱼跃医疗	54,661	2,084,223.93	1.53
2	600171	上海贝岭	66,300	2,017,509.00	1.48
3	600170	上海建工	604,900	1,669,524.00	1.23
4	600820	隧道股份	284,500	1,505,005.00	1.11
5	002180	纳思达	44,500	1,432,900.00	1.05

6	601992	金隅集团	515,000	1,385,350.00	1.02
7	300482	万孚生物	21,000	1,358,490.00	1.00
8	000553	安道麦 A	146,000	1,353,420.00	0.99
9	600528	中铁工业	165,800	1,342,980.00	0.99
10	002185	华天科技	85,500	1,315,845.00	0.97
11	601106	中国一重	372,600	1,263,114.00	0.93
12	002458	益生股份	125,900	1,255,223.00	0.92
13	600811	东方集团	410,300	1,251,415.00	0.92
14	601117	中国化学	141,900	1,243,044.00	0.91
15	603377	东方时尚	113,840	1,216,949.60	0.89
16	600582	天地科技	309,600	1,207,440.00	0.89
17	600598	北大荒	77,900	1,165,384.00	0.86
18	601200	上海环境	97,330	1,165,040.10	0.86
19	000563	陕国投 A	360,600	1,161,132.00	0.85
20	600500	中化国际	147,600	1,160,136.00	0.85
21	600062	华润双鹤	96,700	1,151,697.00	0.85
22	603379	三美股份	60,900	1,139,439.00	0.84
23	000988	华工科技	48,400	1,138,368.00	0.84
24	600881	亚泰集团	399,400	1,138,290.00	0.84
25	600737	中粮糖业	112,900	1,130,129.00	0.83
26	603228	景旺电子	42,800	1,121,360.00	0.82
27	002203	海亮股份	104,647	1,113,444.08	0.82
28	603866	桃李面包	35,296	1,101,235.20	0.81
29	000709	河钢股份	442,500	1,088,550.00	0.80
30	000778	新兴铸管	291,900	1,085,868.00	0.80
31	002511	中顺洁柔	39,400	1,085,470.00	0.80
32	600271	航天信息	82,400	1,073,672.00	0.79
33	600808	马钢股份	249,300	1,069,497.00	0.79
34	600068	葛洲坝	142,200	1,065,078.00	0.78
35	600369	西南证券	217,900	1,061,173.00	0.78
36	600673	东阳光	233,200	1,047,068.00	0.77
37	601958	金钼股份	161,500	1,046,520.00	0.77
38	002299	圣农发展	43,700	1,043,556.00	0.77
39	000050	深天马 A	72,700	1,030,886.00	0.76
40	600388	龙净环保	120,365	1,025,509.80	0.75
41	000999	华润三九	38,100	1,019,175.00	0.75
42	601608	中信重工	272,500	1,019,150.00	0.75
43	002926	华西证券	105,300	1,014,039.00	0.74
44	000686	东北证券	119,900	1,013,155.00	0.74
45	002815	崇达技术	81,000	1,010,880.00	0.74
46	000559	万向钱潮	187,000	992,970.00	0.73
47	600728	佳都科技	133,500	989,235.00	0.73
48	002048	宁波华翔	50,500	984,750.00	0.72
49	600177	雅戈尔	149,400	984,546.00	0.72

50	600572	康恩贝	221,700	984,348.00	0.72
51	002085	万丰奥威	175,300	981,680.00	0.72
52	601869	长飞光纤	40,200	979,272.00	0.72
53	000401	冀东水泥	79,200	978,120.00	0.72
54	002233	塔牌集团	94,800	974,544.00	0.72
55	300146	汤臣倍健	29,600	973,840.00	0.72
56	600567	山鹰国际	277,900	958,755.00	0.70
57	600968	海油发展	369,700	957,523.00	0.70
58	601828	美凯龙	79,510	954,120.00	0.70
59	000970	中科三环	98,100	936,855.00	0.69
60	600312	平高电气	158,100	923,304.00	0.68
61	600839	四川长虹	317,200	923,052.00	0.68
62	002004	华邦健康	148,600	922,806.00	0.68
63	000997	新大陆	55,400	919,086.00	0.68
64	002110	三钢闽光	134,900	909,226.00	0.67
65	002440	闰土股份	102,600	908,010.00	0.67
66	000623	吉林敖东	58,010	898,574.90	0.66
67	600755	厦门国贸	108,621	891,778.41	0.65
68	600487	亨通光电	78,000	889,200.00	0.65
69	002434	万里扬	108,600	880,746.00	0.65
70	601568	北元集团	101,700	870,552.00	0.64
71	600348	华阳股份	115,500	857,010.00	0.63
72	603568	伟明环保	37,200	849,276.00	0.62
73	600718	东软集团	86,500	845,970.00	0.62
74	600398	海澜之家	116,300	842,012.00	0.62
75	000898	鞍钢股份	189,100	841,495.00	0.62
76	600667	太极实业	92,400	840,840.00	0.62
77	300070	碧水源	114,800	839,188.00	0.62
78	600022	山东钢铁	484,500	833,340.00	0.61
79	002302	西部建设	105,000	829,500.00	0.61
80	000581	威孚高科	39,100	814,453.00	0.60
81	600256	广汇能源	243,986	812,473.38	0.60
82	600633	浙数文化	112,900	810,622.00	0.60
83	002155	湖南黄金	104,500	809,875.00	0.59
84	600566	济川药业	44,800	801,920.00	0.59
85	600056	中国医药	65,699	798,242.85	0.59
86	000629	攀钢钒钛	348,100	797,149.00	0.59
87	600871	石化油服	402,400	792,728.00	0.58
88	603927	中科软	18,400	790,280.00	0.58
89	600879	航天电子	104,900	788,848.00	0.58
90	600649	城投控股	165,200	786,352.00	0.58
91	600039	四川路桥	125,000	783,750.00	0.58
92	601003	柳钢股份	132,400	781,160.00	0.57
93	002266	浙富控股	155,800	777,442.00	0.57

94	601179	中国西电	187,500	772,500.00	0.57
95	600535	天士力	52,100	771,601.00	0.57
96	600801	华新水泥	43,700	767,809.00	0.56
97	002065	东华软件	96,500	765,245.00	0.56
98	300271	华宇软件	39,500	760,375.00	0.56
99	002268	卫士通	38,700	753,876.00	0.55
100	600307	酒钢宏兴	324,600	753,072.00	0.55
101	600377	宁沪高速	76,500	746,640.00	0.55
102	603000	人民网	43,200	742,608.00	0.55
103	600959	江苏有线	243,200	741,760.00	0.54
104	000528	柳工	89,800	736,360.00	0.54
105	002465	海格通信	77,600	734,096.00	0.54
106	601118	海南橡胶	143,500	730,415.00	0.54
107	603515	欧普照明	28,400	729,028.00	0.54
108	600446	金证股份	49,700	717,668.00	0.53
109	600835	上海机电	43,800	711,750.00	0.52
110	300257	开山股份	48,800	701,256.00	0.52
111	002195	二三四五	341,200	692,636.00	0.51
112	600998	九州通	44,600	685,502.00	0.50
113	000967	盈峰环境	99,100	680,817.00	0.50
114	002966	苏州银行	90,400	664,440.00	0.49
115	601928	凤凰传媒	91,700	654,738.00	0.48
116	603858	步长制药	28,900	649,961.00	0.48
117	603868	飞科电器	15,300	643,518.00	0.47
118	000598	兴蓉环境	122,700	639,267.00	0.47
119	603708	家家悦	36,500	634,005.00	0.47
120	600717	天津港	159,576	625,537.92	0.46
121	601997	贵阳银行	87,300	625,068.00	0.46
122	002038	双鹭药业	59,000	621,270.00	0.46
123	600637	东方明珠	72,600	594,594.00	0.44
124	600642	申能股份	95,600	586,984.00	0.43
125	002422	科伦药业	29,400	586,530.00	0.43
126	002818	富森美	47,800	576,468.00	0.42
127	002936	郑州银行	156,170	573,143.90	0.42
128	600867	通化东宝	47,600	568,344.00	0.42
129	600325	华发股份	83,200	560,768.00	0.41
130	600928	西安银行	120,100	559,666.00	0.41
131	601098	中南传媒	63,100	556,542.00	0.41
132	600663	陆家嘴	41,000	546,120.00	0.40
133	600008	首创环保	181,200	545,412.00	0.40
134	600266	城建发展	113,044	535,828.56	0.39
135	000685	中山公用	64,100	523,056.00	0.38
136	601333	广深铁路	246,400	522,368.00	0.38
137	601512	中新集团	50,500	502,980.00	0.37

138	600863	内蒙华电	212,900	496,057.00	0.36
139	600704	物产中大	62,100	488,727.00	0.36
140	002244	滨江集团	113,100	473,889.00	0.35
141	000402	金融街	70,000	472,500.00	0.35
142	002146	荣盛发展	83,700	472,068.00	0.35
143	600901	江苏租赁	89,700	466,440.00	0.34
144	600021	上海电力	65,300	451,223.00	0.33
145	601228	广州港	140,900	448,062.00	0.33
146	601000	唐山港	179,500	432,595.00	0.32
147	600153	建发股份	51,200	414,720.00	0.30
148	600390	五矿资本	66,100	395,278.00	0.29
149	600729	重庆百货	13,200	362,340.00	0.27
150	002419	天虹股份	52,400	343,744.00	0.25

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300482	万孚生物	1,522,377.00	0.97
2	000553	安道麦 A	1,382,247.00	0.88
3	002458	益生股份	1,286,084.00	0.82
4	600598	北大荒	1,227,986.00	0.78
5	002180	纳思达	1,218,470.00	0.77
6	600271	航天信息	1,181,381.00	0.75
7	600369	西南证券	1,162,020.00	0.74
8	600177	雅戈尔	1,154,930.00	0.73
9	002185	华天科技	1,142,684.00	0.73
10	600673	东阳光	1,129,127.00	0.72
11	600500	中化国际	1,111,276.40	0.71
12	603379	三美股份	1,090,385.00	0.69
13	002926	华西证券	1,079,705.00	0.69
14	000401	冀东水泥	1,061,627.00	0.68
15	002233	塔牌集团	1,059,195.00	0.67
16	000988	华工科技	1,056,823.00	0.67
17	300146	汤臣倍健	1,052,463.00	0.67
18	600068	葛洲坝	1,023,321.00	0.65
19	002815	崇达技术	1,019,306.00	0.65

20	002004	华邦健康	1,002,404.00	0.64
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000825	太钢不锈	2,430,779.38	1.55
2	600460	士兰微	2,307,830.00	1.47
3	000301	东方盛虹	2,305,798.00	1.47
4	300244	迪安诊断	2,109,792.00	1.34
5	600623	华谊集团	1,888,185.00	1.20
6	000488	晨鸣纸业	1,875,985.00	1.19
7	000718	苏宁环球	1,826,482.55	1.16
8	000960	锡业股份	1,676,140.00	1.07
9	000039	中集集团	1,670,568.20	1.06
10	000932	华菱钢铁	1,604,907.00	1.02
11	603225	新凤鸣	1,577,868.80	1.00
12	000729	燕京啤酒	1,570,078.00	1.00
13	000630	铜陵有色	1,521,536.00	0.97
14	002372	伟星新材	1,518,142.00	0.97
15	002690	美亚光电	1,466,142.00	0.93
16	601966	玲珑轮胎	1,445,307.80	0.92
17	002595	豪迈科技	1,388,249.00	0.88
18	000869	张裕 A	1,386,082.00	0.88
19	000008	神州高铁	1,359,294.00	0.86
20	600563	法拉电子	1,341,560.00	0.85

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	77,334,649.09
卖出股票的收入（成交）总额	91,266,384.99

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,371.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	462.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,833.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例

5,639	16,261.34	15,790,428.00	17.22%	75,907,292.00	82.78%
-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李质健	4,605,200.00	5.02%
2	广发证券股份有限公司	4,153,506.00	4.53%
3	中信建投证券股份有限公司	2,075,531.00	2.26%
4	许健超	2,041,600.00	2.23%
5	张自然	1,982,000.00	2.16%
6	郑维丽	1,186,700.00	1.29%
7	李升	994,100.00	1.08%
8	杨松涛	728,400.00	0.79%
9	宁超贤	607,000.00	0.66%
10	朱建人	599,000.00	0.65%
11	中国建设银行股份有限公司—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	8,859,100.00	9.66%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日）基金份额总额	352,497,720.00
本报告期期初基金份额总额	115,697,720.00
本报告期基金总申购份额	25,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	49,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	91,697,720.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 2 月 6 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》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
招商证券	3	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	67,657,321.05	40.13%	63,010.18	40.64%	-
国泰君安证券	1	57,480,577.15	34.09%	52,382.11	33.78%	-
长江证券	2	36,301,366.24	21.53%	33,081.31	21.34%	-
申万宏源	2	4,606,687.00	2.73%	4,198.14	2.71%	-
兴业证券	1	2,555,082.64	1.52%	2,379.54	1.53%	-

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，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(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：

2021 年 3 月完成租用托管在建设银行的 中信建投证券 上交所 49968 交易单元。

2021 年 6 月完成托管在建设银行的 申万宏源深交所 278300 交易单元退租。

10.8.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	230,034.62	43.08%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	303,970.60	56.92%	-	-	-	-

10.9 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	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 2020 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	2021-01-21
2	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	2021-02-06
3	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-09
4	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 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-30
5	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	2021-03-31
6	华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式	中国证监会基金电子披	2021-03-31

	指数证券投资基金基金合同(更新)	露网站和公司网站	
7	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招募说明书(2021年第1号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
8	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分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	2021-03-31
9	华安基金管理有限公司关于华安中证 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	2021-04-12
10	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 2021 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	2021-04-21

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210101-20210630	8,729,100.00	5,060,000.00	4,930,000.00	8,859,100.00	9.66%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《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招募说明书》
- 3、《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托管协议》
- 4、中国证监会批准华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日