

# 华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基 金

**2018 年半年度报告**

**2018 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| <b>2 基金简介</b>                           | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>4 管理人报告</b>                          | <b>8</b>  |
| 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        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>13</b> |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 13        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 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        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 33        |
| 7.2 期末投资目标基金明细                          | 34        |
| 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 34        |
| 7.4 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       | 35        |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 35        |
| 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37        |
| 7.7 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      | 37        |
| 7.8 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   | 37        |
| 7.9 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   | 37        |
| 7.10 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     | 37        |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 37        |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 37        |
| 7.13 投资组合报告附注                           | 38        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>39</b> |

|        |                                     |    |
|--------|-------------------------------------|----|
| 8.1    | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 39 |
| 8.2    | 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 ..... | 39 |
| 9      | 开放式基金份额变动 .....                     | 39 |
| 10     | 重大事件揭示 .....                        | 39 |
| 10.1   | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 39 |
| 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 .....   | 39 |
| 10.3   | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 40 |
| 10.4   | 基金投资策略的改变 .....                     | 40 |
| 10.5   | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 40 |
| 10.6   | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 40 |
| 10.7   | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 40 |
| 10.7.2 | 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....       | 41 |
| 10.8   | 其他重大事件 .....                        | 41 |
| 11     | 备查文件目录 .....                        | 42 |
| 11.1   | 备查文件目录 .....                        | 42 |
| 11.2   | 存放地点 .....                          | 42 |
| 11.3   | 查阅方式 .....                          | 43 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                            |
|------------|----------------------------|
| 基金名称       | 华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 |
| 基金简称       | 华安上证龙头 ETF 联接              |
| 基金主代码      | 040190                     |
| 交易代码       | 040190                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                     |
| 基金合同生效日    | 2010 年 11 月 18 日           |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司                 |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额 | 67,566,282.01 份            |
| 基金合同存续期    | 不定期                        |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 510190               |
| 基金运作方式       | 交易型开放式（ETF）          |
| 基金合同生效日      | 2010 年 11 月 18 日     |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所              |
| 上市日期         | 2011 年 1 月 10 日      |
| 基金管理人名称      | 华安基金管理有限公司           |
| 基金托管人名称      | 中国工商银行股份有限公司         |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 通过投资于目标 ETF，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   | 本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 95%×上证龙头企业指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似，属于证券投资基金中                                                                                                       |

|  |               |
|--|---------------|
|  | 风险较高、收益较高的品种。 |
|--|---------------|

## 2.2.1 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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   | 本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数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票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，但因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。 |
| 业绩比较基准 | 上证龙头企业指数                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。                                                                                               |

## 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                              | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                                      | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38969999                            | 010-66105798        |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn                    | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008850099                              | 95588               |
| 传真          |      | 021-68863414                            | 010-66105799        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道8号国金中心二期31<br>—32层 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号 |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道8号国金中心二期31<br>—32层 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号 |
| 邮政编码        |      | 200120                                  | 100140              |
| 法定代表人       |      | 朱学华                                     | 易会满                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                        |
|----------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、上海证券报、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 |

|  |        |
|--|--------|
|  | 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 | 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 层、32 层 |

## 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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 3,197,270.71                         |
| 本期利润          | -13,122,761.15                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1849                              |
| 本期加权平均净值利润率   | -13.39%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -13.09%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 15,388,858.07                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2278                               |
| 期末基金资产净值      | 82,955,140.08                        |
| 期末基金份额净值      | 1.228                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 22.80%                               |

注：1、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

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

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

### 3.2 基金净值表现

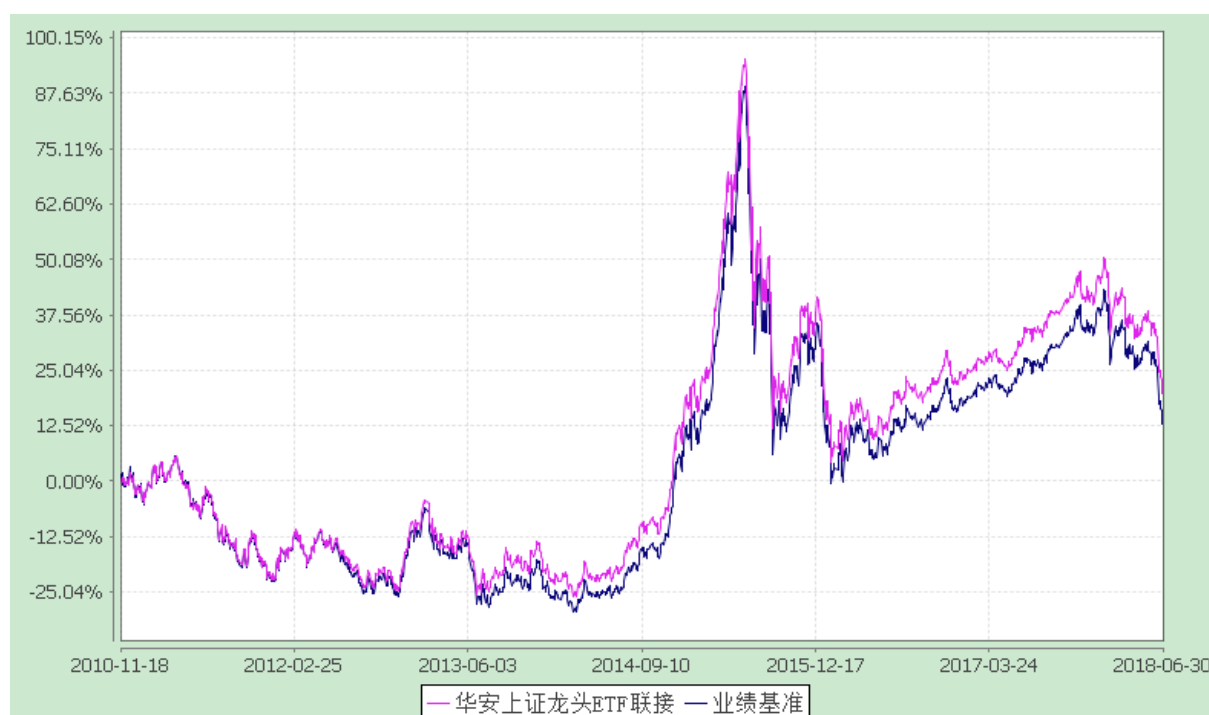
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -9.57%   | 1.27%       | -10.19%    | 1.32%         | 0.62% | -0.05% |

|            |         |       |         |       |       |        |
|------------|---------|-------|---------|-------|-------|--------|
| 过去三个月      | -10.30% | 1.07% | -11.00% | 1.09% | 0.70% | -0.02% |
| 过去六个月      | -13.09% | 1.10% | -13.69% | 1.12% | 0.60% | -0.02% |
| 过去一年       | -8.70%  | 0.89% | -9.45%  | 0.90% | 0.75% | -0.01% |
| 过去三年       | -24.20% | 1.45% | -25.61% | 1.46% | 1.41% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.80%  | 1.35% | 15.59%  | 1.36% | 7.21% | -0.01% |

### 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

华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 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  
 （2010 年 11 月 18 日至 2018 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投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、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 2018 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 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 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<br>（助理）期限 |            | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|--------------|---------------------|------------|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |              | 任职日期                | 离任日期       |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 牛勇  | 本基金的基金<br>经理 | 2010-11-18          | 2018-01-15 | 13 年       | 复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），13 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 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助理，2010 年 6 月至 2012 年 12 月担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2010 年 11 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本基金的基金经理。2012 年 6 月至 2015 年 5 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。2014 年 12 月起担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月离开华安基金。 |
| 苏卿云 | 本基金的基金<br>经理 | 2017-12-25          | -          | 10 年       | 硕士研究生，10 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资事业总部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月起，担任                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2017 年 10 月起,同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017 年 12 月起,同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及本基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

## 4.2 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》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、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》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、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。同时加强了对基金、专户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 3 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

2018 年上半年，第一季度 GDP 增幅 6.8%，第二季度微降至 6.7%，第三产业在经济增长中的贡献率虽有所下降但仍处高位，最终消费支出对经济增长的贡献率有所提升，反映出国内经济增长的结构有所改变。消费升级逐见成效，支撑最终消费支出维持较高增速；投资承压下行，制造业投资抬升抵抗房地产和基建投资的回落；海外经济复苏分化，外需乏力，工业生产增长受阻。经济行为反应在二级市场上就是餐饮旅游、医药、食品饮料等内需消费的主要行业得到了比较好的市场表现。但是建筑、房地产等行业收到去杠杆以等宏观调控的影响，二级市场表现也难见起色。

上证龙头 ETF 所跟踪的上证龙头指数选取中证二级行业里面的龙头公司，代表了上海市场龙头公司的整体表现。

投资管理上，基金采取完全投资于上证龙头 ETF 的方式跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.228 元，本报告期份额净值增长率为-13.09%，同期业绩比较基准增长率为-13.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年内需没有明显反弹动能，外需又因贸易战而受限，经济下行压力加大，扩大内需将成为下半年经济增长的重点措施。货币政策方面，预计下半年继续实行总体稳健，结构性宽松；财政政策方面，我们认为财政政策应该更加积极灵活。在去杠杆达到初步成效的前提下，政策层面将进入稳杠杆阶段，实体经济随之进行结构性调整。

展望未来，我们依然对中国经济有强烈的信心。随着中国经济转型升级，各行业集中度将进一步提升，行业龙头公司具备较强的竞争，并将体现在公司的盈利水平增加和估值提升上。

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。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、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

本报告期内，本基金托管人在对华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年 6 月 6 日持有基金托管人股票，经本托管人以函件形式提示后，华安基金管理有限公司对华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资组合进行了调整。本报告期内，华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金未进行利润分配。

#### 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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 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：华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 5,418,308.43                   | 5,259,111.44                     |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | 4,528.00                       | 3,072.62                         |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 77,835,982.60                  | 98,277,943.16                    |
| 其中：股票投资         |            | 407,915.00                     | 269,915.00                       |
| 基金投资            |            | 77,428,067.60                  | 98,008,028.16                    |
| 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         |            | -                              | 52,079.24                        |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 886.06                         | 1,115.57                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 26,075.49                      | 562,647.41                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>83,285,780.58</b>           | <b>104,155,969.44</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            | -                              | -                                |
| 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           |            | 201,861.59                     | 39,120.25                        |
| 应付管理人报酬         |            | 2,139.90                       | 2,483.06                         |
| 应付托管费           |            | 428.01                         | 496.61                           |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 12,039.75                      | 2,914.82                         |
| 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  | 114,171.25           | 275,015.68            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>330,640.50</b>    | <b>320,030.42</b>     |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                    | -                     |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 67,566,282.01        | 73,511,997.67         |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 15,388,858.07        | 30,323,941.35         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>82,955,140.08</b> | <b>103,835,939.02</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>83,285,780.58</b> | <b>104,155,969.44</b> |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.228 元，基金份额总额 67,566,282.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>-12,965,387.75</b>                    | <b>10,236,481.95</b>                          |
| 1.利息收入                |          | 21,612.00                                | 20,812.36                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 21,612.00                                | 20,812.36                                     |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 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）      |          | 3,318,964.31                             | 2,345,024.90                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 172,951.29                               | -28,263.05                                    |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13 | 3,144,326.26                             | 2,372,107.51                                  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.15 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.17 | 1,686.76                                 | 1,180.44                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | -16,320,031.86                           | 7,865,543.23                                  |
| 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 | 14,067.80                                | 5,101.46                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>157,373.40</b>                        | <b>175,253.47</b>                             |
| 1. 管理人报酬              |          | 14,867.61                                | 14,015.19                                     |
| 2. 托管费                |          | 2,973.54                                 | 2,803.15                                      |

|                            |          |                       |                      |
|----------------------------|----------|-----------------------|----------------------|
| 3. 销售服务费                   |          | -                     | -                    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20 | 24,992.25             | 19,510.41            |
| 5. 利息支出                    |          | -                     | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                     | -                    |
| 6.税金及附加                    |          | 410.47                | -                    |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.21 | 114,129.53            | 138,924.72           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-13,122,761.15</b> | <b>10,061,228.48</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-13,122,761.15</b> | <b>10,061,228.48</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>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）                        | 73,511,997.67                              | 30,323,941.35  | 103,835,939.02 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -13,122,761.15 | -13,122,761.15 |
| 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）      | -5,945,715.66                              | -1,812,322.13  | -7,758,037.79  |
| 其中：1.基金申购款                             | 8,844,382.77                               | 3,972,763.82   | 12,817,146.59  |
| 2.基金赎回款                                | -14,790,098.43                             | -5,785,085.95  | -20,575,184.38 |
| 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）                        | 67,566,282.01                              | 15,388,858.07  | 82,955,140.08  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 87,689,155.60                              | 19,692,720.71  | 107,381,876.31 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 10,061,228.48  | 10,061,228.48  |

|                                        |                |               |                |
|----------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 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）      | -7,891,732.04  | -2,217,950.59 | -10,109,682.63 |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,419,819.68   | 659,358.19    | 3,079,177.87   |
| 2.基金赎回款                                | -10,311,551.72 | -2,877,308.78 | -13,188,860.50 |
| 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）                        | 79,797,423.56  | 27,535,998.60 | 107,333,422.16 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2010]1203 号《关于核准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《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,745,656,607.24 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(2010)第 297 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 11 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,745,903,944.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 247,336.84 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对上证龙头企业指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金以目标 ETF、上证龙头企业指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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%；本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的业绩比较基准为：95%×上证龙头企业指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。

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 2018 年 8 月 23 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安上证龙头企业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、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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本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[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政策的补充通知》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。对证券投资基金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。

(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。

## 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<br>2018 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 5,418,308.43           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 5,418,308.43           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 461,167.48             | 407,915.00    | -53,252.48    |
| 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            | 67,082,825.75          | 77,428,067.60 | 10,345,241.85 |
| 其他            | -                      | -             | -             |
| 合计            | 67,543,993.23          | 77,835,982.60 | 10,291,989.37 |

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|            | 2018 年 6 月 30 日 |
|------------|-----------------|
| 应收活期存款利息   | 884.26          |
| 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  | -               |
| 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 | -               |
| 其他         | 1.80            |
| 合计         | 886.06          |

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 12,039.75              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 12,039.75              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 117.72                 |
| 预提审计费       | 29,752.78              |
| 预提信息披露费     | 84,300.75              |
| 合计          | 114,171.25             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |               |
|------|---------------------------------------|---------------|
|      | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末 | 73,511,997.67                         | 73,511,997.67 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购          | 8,844,382.77   | 8,844,382.77   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,790,098.43 | -14,790,098.43 |
| 本期末           | 67,566,282.01  | 67,566,282.01  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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           | 43,836,835.30 | -13,512,893.95 | 30,323,941.35  |
| 本期利润           | 3,197,270.71  | -16,320,031.86 | -13,122,761.15 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,698,350.90 | 1,886,028.77   | -1,812,322.13  |
| 其中：基金申购款       | 5,444,976.98  | -1,472,213.16  | 3,972,763.82   |
| 基金赎回款          | -9,143,327.88 | 3,358,241.93   | -5,785,085.95  |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 43,335,755.11 | -27,946,897.04 | 15,388,858.07  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 21,492.32                             |
| 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 | 82.94                                 |
| 其他        | 36.74                                 |
| 合计        | 21,612.00                             |

#### 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 181,689.04                            |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                     |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -8,737.75                             |
| 合计               | 172,951.29                            |

##### 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 |
|----|----|
|----|----|

|            | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 10,704,765.04                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,523,076.00                   |
| 买卖股票差价收入   | 181,689.04                      |

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 申购基金份额总额    | 5,846,000.00                          |
| 减：现金支付申购款总额 | 17,106.73                             |
| 减：申购股票成本总额  | 5,837,631.02                          |
| 申购差价收入      | -8,737.75                             |

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 13,325,583.59                         |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 10,181,257.33                         |
| 基金投资收益        | 3,144,326.26                          |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,686.76                   |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 1,686.76                   |

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -16,320,031.86             |
| ——股票投资                     | -53,168.48                 |
| ——债券投资                     | -                          |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -16,266,863.38             |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -16,320,031.86             |

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 14,067.80                  |
| 合计      | 14,067.80                  |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 24,992.25                             |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 24,992.25                             |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用   | 29,752.78                  |
| 信息披露费  | 84,300.75                  |
| 银行汇划费用 | 76.00                      |
| 合计     | 114,129.53                 |

#### 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

无。

##### 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 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                         | 与本基金的关系             |
|-------------------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)          | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)          | 基金托管人、基金代销机构        |
| 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(“目标ETF”) | 本基金的基金管理人管理的其他基金    |

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

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

## 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<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 14,867.61                      | 14,015.19                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 102,668.92                     | 112,718.75                          |

注：本基金投资于目标 ETF 的部分豁免管理费。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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.5% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,973.54                       | 2,803.15                            |

注：本基金投资于目标 ETF 的部分豁免托管费。支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.1% / 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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 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<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 5,418,308.43               | 21,492.32 | 5,500,682.33                    | 20,788.63 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

于本报告期末，本基金持有 24,016,150 份目标 ETF 基金份额(2017 年 12 月 31 日：26,170,368.00 份)，占其总份额的比例为 83.82%(2017 年 12 月 31 日：85.38%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 600158 | 中体产业 | 2018-03-27 | 重大事项停牌 | 11.64  | 2018-07-16 | 11.61  | 2,400.00     | 27,936.00  | 27,936.00  | -  |
| 600485 | 信威集团 | 2016-12-26 | 重大事项停牌 | 14.59  | -          | -      | 22,100.00    | 322,498.48 | 322,439.00 | -  |

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于 ETF 联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，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基金投资、股票投资及债券投资。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 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管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司督察长负责。

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

#### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 中国工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2017 年 12 月 31 日：同)。

### 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，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持全部证券在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                     | 5,418,308.43 | -     | -     | -             | 5,418,308.43   |
| 存出保证金                    | 4,528.00     | -     | -     | -             | 4,528.00       |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 77,835,982.60 | 77,835,982.60  |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 886.06        | 886.06         |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 26,075.49     | 26,075.49      |
| 资产总计                     | 5,422,836.43 | -     | -     | 77,862,944.15 | 83,285,780.58  |
| 负债                       |              |       |       |               |                |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 201,861.59    | 201,861.59     |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 2,139.90      | 2,139.90       |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 428.01        | 428.01         |
| 应付交易费用                   | -            | -     | -     | 12,039.75     | 12,039.75      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 114,171.25    | 114,171.25     |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 330,640.50    | 330,640.50     |
| 利率敏感度缺口                  | 5,422,836.43 | -     | -     | 77,532,303.65 | 82,955,140.08  |
| 上年度末<br>2017 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                     | 5,259,111.44 | -     | -     | -             | 5,259,111.44   |
| 存出保证金                    | 3,072.62     | -     | -     | -             | 3,072.62       |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 98,277,943.16 | 98,277,943.16  |
| 应收证券清算款                  | -            | -     | -     | 52,079.24     | 52,079.24      |
| 应收利息                     | -            | -     | -     | 1,115.57      | 1,115.57       |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 562,647.41    | 562,647.41     |
| 资产总计                     | 5,262,184.06 | -     | -     | 98,893,785.38 | 104,155,969.44 |

| 负债      |              |   |   |               |                |
|---------|--------------|---|---|---------------|----------------|
| 应付赎回款   | -            | - | - | 39,120.25     | 39,120.25      |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 2,483.06      | 2,483.06       |
| 应付托管费   | -            | - | - | 496.61        | 496.61         |
| 应付交易费用  | -            | - | - | 2,914.82      | 2,914.82       |
| 其他负债    | -            | - | - | 275,015.68    | 275,015.68     |
| 负债总计    | -            | - | - | 320,030.42    | 320,030.42     |
| 利率敏感度缺口 | 5,262,184.06 | - | - | 98,573,754.96 | 103,835,939.02 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2018 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以目标 ETF、上证龙头企业指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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%；本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2017 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  | 407,915.00             | 0.49          | 269,915.00               | 0.26          |
| 交易性金融资产—基金投资  | 77,428,067.60          | 93.34         | 98,008,028.16            | 94.39         |
| 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            | 77,835,982.60          | 93.83         | 98,277,943.16            | 94.65         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                              |                          |
|----|----------------------|------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日       | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加约 410                      | 增加约 513                  |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少约 410                      | 减少约 513                  |

#### 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  | 407,915.00 | 0.49          |
|    | 其中：股票 | 407,915.00 | 0.49          |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              | 77,428,067.60 | 92.97  |
| 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      | 5,418,308.43  | 6.51   |
| 8 | 其他各项资产            | 31,489.55     | 0.04   |
| 9 | 合计                | 83,285,780.58 | 100.00 |

## 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                 | 基金类型 | 运作方式        | 管理人        | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------|-------------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型  | 交易型开放式(ETF) | 华安基金管理有限公司 | 77,428,067.60 | 93.34        |

## 7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.3.1 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              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 322,439.00 | 0.39         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | 57,540.00  | 0.07         |
| 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 | -          | -    |
| J | 金融业             | -          | -    |
| K | 房地产业            | 27,936.00  | 0.03 |
| 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         | -          | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -          | -    |
| S | 综合              | -          | -    |
|   | 合计              | 407,915.00 | 0.49 |

#### 7.4 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

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  | 600485 | 信威集团 | 22,100 | 322,439.00 | 0.39         |
| 2  | 600682 | 南京新百 | 3,500  | 57,540.00  | 0.07         |
| 3  | 600158 | 中体产业 | 2,400  | 27,936.00  | 0.03         |

#### 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.5.1 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

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  | 600519 | 贵州茅台 | 229,619.00 | 0.22           |
| 2  | 600340 | 华夏幸福 | 108,872.00 | 0.10           |
| 3  | 600048 | 保利地产 | 108,822.00 | 0.10           |
| 4  | 600606 | 绿地控股 | 101,935.00 | 0.10           |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 100,755.00 | 0.10           |
| 6  | 601933 | 永辉超市 | 98,874.00  | 0.10           |
| 7  | 601088 | 中国神华 | 95,273.00  | 0.09           |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 95,069.00  | 0.09           |
| 9  | 600690 | 青岛海尔 | 94,650.00  | 0.09           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 10 | 600028 | 中国石化 | 93,412.00 | 0.09 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 92,896.00 | 0.09 |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 92,411.00 | 0.09 |
| 13 | 601111 | 中国国航 | 92,253.00 | 0.09 |
| 14 | 600138 | 中青旅  | 92,009.00 | 0.09 |
| 15 | 601888 | 中国国旅 | 91,769.00 | 0.09 |
| 16 | 601988 | 中国银行 | 91,656.00 | 0.09 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 89,700.00 | 0.09 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 89,321.64 | 0.09 |
| 19 | 600977 | 中国电影 | 88,360.00 | 0.09 |
| 20 | 600158 | 中体产业 | 87,574.00 | 0.08 |

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。

### 7.5.2 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<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 363,977.00 | 0.35               |
| 2  | 600048 | 保利地产 | 199,263.00 | 0.19               |
| 3  | 601888 | 中国国旅 | 185,752.00 | 0.18               |
| 4  | 601088 | 中国神华 | 182,443.31 | 0.18               |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 181,398.00 | 0.17               |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 180,156.00 | 0.17               |
| 7  | 600019 | 宝钢股份 | 178,437.00 | 0.17               |
| 8  | 601288 | 农业银行 | 178,130.00 | 0.17               |
| 9  | 600340 | 华夏幸福 | 177,741.00 | 0.17               |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 175,337.00 | 0.17               |
| 11 | 600690 | 青岛海尔 | 175,065.00 | 0.17               |
| 12 | 601111 | 中国国航 | 173,452.00 | 0.17               |
| 13 | 600606 | 绿地控股 | 172,419.00 | 0.17               |
| 14 | 600977 | 中国电影 | 169,312.00 | 0.16               |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 168,436.00 | 0.16               |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 167,406.55 | 0.16               |
| 17 | 600138 | 中青旅  | 166,367.00 | 0.16               |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 165,117.00 | 0.16               |
| 19 | 600585 | 海螺水泥 | 164,949.00 | 0.16               |
| 20 | 600196 | 复星医药 | 164,860.00 | 0.16               |

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。

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 5,758,845.02  |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 10,704,765.04 |

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

## 7.6 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。

## 7.7 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投资。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

### 7.13.3 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   | 4,528.00  |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 886.06    |
| 5  | 应收申购款   | 26,075.49 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 31,489.55 |

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 600485 | 信威集团 | 322,439.00      | 0.39             | 重大事项停<br>牌   |
| 2  | 600158 | 中体产业 | 27,936.00       | 0.03             | 重大事项停<br>牌   |

## 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<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 2,745    | 24,614.31     | 0.00  | 0.00%      | 67,566,282.01 | 100.00%    |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010 年 11 月 18 日）基金份额总额 | 1,745,903,944.08 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 73,511,997.67    |
| 本报告期基金总申购份额                     | 8,844,382.77     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 14,790,098.43    |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 67,566,282.01    |

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额。

## 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：

2018 年 2 月 13 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 招商证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华鑫证券 | 1      | 16,463,610.06 | 100.00%      | 12,039.75 | 100.00%    | -  |

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

基金管理人或被选择的券商签订《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：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              | 基金交易         |              |
|------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|--------------|--------------|
|      | 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 | 成交金额         | 占当期基金成交总额的比例 |
| 招商证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -            | -            |
| 华鑫证券 | -    | -            | -    | -            | -    | -            | 2,613,558.05 | 100.00 %     |

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  | 华安基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-01-03 |
| 2  | 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-01-13 |
| 3  | 华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-02-13 |
| 4  | 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-03-14 |
| 5  | 关于电子直销平台开展“微钱宝”账户交易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 | 2018-03-21 |

|    |                                    | 司网站                         |            |
|----|------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 6  | 关于旗下公开募集证券投资基金根据流动性风险管理规定修改基金合同的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-03-24 |
| 7  | 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同修改前后对照表    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-03-24 |
| 8  | 关于基金电子交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-11 |
| 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      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-15 |
| 10 | 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       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-27 |
| 11 | 关于基金电子交易平台调整微钱宝快速取现服务限额的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2018-06-27 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 2、《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- 3、《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、《关于核准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募集的批复》；
- 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；

### 11.2 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>。

### 11.3 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

二〇一八年八月二十四日