

华安沪深 300 指数分级证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 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：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	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	11
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	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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
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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
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	52
10.8 其他重大事件	53
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	华安沪深 300 指数分级		
场内简称	华安 300		
基金主代码	160417		
交易代码	160417		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 25 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	215,561,680.96 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 7 月 23 日		
下属分级基金的基金简称	华安沪深 300 指数分级 A	华安沪深 300 指数分级 B	华安沪深 300 指数分级
下属分级基金的场内简称	HS300A	HS300B	华安 300
下属分级基金的交易代码	150104	150105	160417
报告期末下属分级基金的份额总额	1,379,155.00 份	1,379,155.00 份	212,803,370.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。
业绩比较基准	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率(税后)}$
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

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	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	336,122.98
本期利润	60,955,708.80
加权平均基金份额本期利润	0.2837
本期加权平均净值利润率	22.32%

本期基金份额净值增长率	26.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	107,707,694.87
期末可供分配基金份额利润	0.4997
期末基金资产净值	290,772,810.24
期末基金份额净值	1.3489
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	58.84%

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	5.57%	1.10%	5.13%	1.10%	0.44%	0.00%
过去三个月	-0.10%	1.44%	-1.14%	1.45%	1.04%	-0.01%
过去六个月	26.82%	1.46%	25.72%	1.47%	1.10%	-0.01%
过去一年	11.26%	1.43%	8.53%	1.45%	2.73%	-0.02%
过去三年	29.24%	1.04%	20.28%	1.05%	8.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	58.84%	1.42%	49.79%	1.42%	9.05%	0.00%

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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金

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

（2012 年 6 月 25 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十六部分“基金的投资”中投资范围、投资限制等有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2019 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 123 只开放式基金，管理资产规模达到 3171.00 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏卿云	本基金的基金经理、指数与量化投资部助理总监	2017-10-11	-	11 年	硕士研究生，11 年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 11 月，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任本基金、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其联接基金的基金经理。2018 年 9 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 11 月，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 月起，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。

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等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，受政策宽松预期和市场风险偏好抬升等因素影响，A 股各大指数录得正收益，其中，沪深 300 指数领涨各大宽基指数。截至 2019 年 6 月底，沪深 300 指数上涨 27.92%，同期上证 50 指数上涨 18.76%，中证 500 指数上涨 18.97%。从估值水平来看，沪深 300 指数动态市盈率（P/E）12.44 倍，市净率（P/B）1.48 倍，处于历史估值的后 1/3 区间。

本基金所跟踪的沪深 300 指数由上海和深圳证券市场中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3489 元，本报告期份额净值增长率为 26.82%，同期业绩比较基准增长率为 25.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球开启新一轮降息周期，国内市场利率仍有一定的下行空间，市场流动性维持宽松，企业融资问题将会得到改善。中美贸易摩擦有所缓和并开启新一轮谈判，给制造业等产业提

供时间窗口，国内经济基本面有望得到一定改善。沪深 300 指数作为蓝筹指数的代表，当前估值位于合理位置。对比全球重要指数，估值水平具备一定的优势，长期配置价值凸显。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内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合规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	20,014,267.83	13,612,712.94
结算备付金		11,549.80	65,349.80
存出保证金		2,896.19	4,349.73
交易性金融资产	6.4.7.2	271,339,885.09	213,089,783.27
其中：股票投资		271,339,885.09	213,048,783.27
基金投资		-	-
债券投资		-	41,000.00
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		9,225.93	-
应收利息	6.4.7.5	3,569.86	2,682.54
应收股利		-	-
应收申购款		20,885.70	29,839.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		291,402,280.40	226,804,718.22

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		49.56	-
应付赎回款		138,964.41	22,174.46
应付管理人报酬	6.4.10.2	231,900.38	198,523.97
应付托管费	6.4.10.2	51,018.08	43,675.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	35,989.95	29,694.90
应交税费		-	0.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	171,547.78	278,071.00
负债合计		629,470.16	572,139.91
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	183,065,115.37	180,619,990.95
未分配利润	6.4.7.10	107,707,694.87	45,612,587.36
所有者权益合计		290,772,810.24	226,232,578.31
负债和所有者权益总计		291,402,280.40	226,804,718.22

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3489 元，基金份额总额 215,561,680.96 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		62,885,553.59	-30,016,964.88
1.利息收入		61,524.05	60,423.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,362.59	60,358.97
债券利息收入		161.46	64.06
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）		2,164,440.38	2,896,005.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-837,725.68	337,398.03

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	109,020.75	43,166.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,893,145.31	2,515,441.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	60,619,585.82	-32,998,621.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	40,003.34	25,227.47
减：二、费用		1,929,844.79	2,001,050.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,349,974.79	1,386,409.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	296,994.48	305,010.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	60,789.80	64,954.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.26	0.23
7. 其他费用	6.4.7.19	222,085.46	244,676.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,955,708.80	-32,018,015.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,955,708.80	-32,018,015.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	180,619,990.95	45,612,587.36	226,232,578.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,955,708.80	60,955,708.80
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）	2,445,124.42	1,139,398.71	3,584,523.13
其中：1.基金申购款	14,973,301.22	7,921,697.76	22,894,998.98
2.基金赎回款	-12,528,176.80	-6,782,299.05	-19,310,475.85
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）	183,065,115.37	107,707,694.87	290,772,810.24
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	174,669,601.28	106,043,090.05	280,712,691.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,018,015.58	-32,018,015.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,804,653.35	2,279,599.14	6,084,252.49
其中：1.基金申购款	14,991,963.71	9,090,651.94	24,082,615.65
2.基金赎回款	-11,187,310.36	-6,811,052.80	-17,998,363.16
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）	178,474,254.63	76,304,673.61	254,778,928.24

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

华安沪深 300 指数分级证券投资基金(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[2012]第 278 号《关于核准华安沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》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《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,221,793.60 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(2012)第 201 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

607,313,857.99 份，其中认购资金利息折合 92,064.39 份，场外认购的全部份额确认为华安沪深 300 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“华安沪深 300 份额”)212,734,025.99 份，场内认购部分按照基金合同约定的 1:1 比例份额确认为华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“华安沪深 300A 份额”)197,289,916.00 份和华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“华安沪深 300B 份额”)197,289,916.00 份。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。

根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金合同生效后，基金管理人将根据基金合同的约定办理华安沪深 300 份额与华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额之间的份额配对转换业务，基金管理人按照基金合同的约定在基金份额折算日对所有基金份额进行折算并对折算后的华安沪深 300 份额的场内份额按照 1:1 的比例拆分为预期收益与风险不同的两个份额类别，即低风险且预期收益相对稳定的基金份额(即“华安沪深 300A 份额”)和高风险且预期收益相对较高的基金份额(即“华安沪深 300B 份额”)，两类基金份额的基金资产合并运作。本基金 1 份华安沪深 300A 份额与 1 份华安沪深 300B 份额构成一对份额组合，一对华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的份额组合的份额参考净值之和将等于 2 份华安沪深 300 份额的净值。华安沪深 300A 份额的约定收益率为“同期银行人民币一年期定期存款利率(税后)+3.5%”。华安沪深 300B 份额的份额参考净值根据华安沪深 300 份额的份额净值、华安沪深 300A 份额的份额参考净值以及华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的份额净值关系计算。每个会计年度的第一个工作日，在满足一定条件的情况下，本基金的基金管理人将根据基金合同约定，对华安沪深 300A 份额和华安沪深 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算，华安沪深 300 份额持有人持有的每 2 份华安沪深 300 份额将获得按照 1 份华安沪深 300A 份额分配的新增华安沪深 300 份额；当华安 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元或华安 300B 份额的参考净值小于或等于 0.300 元，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的比例为 1:1，份额折算后华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。具体基金份额折算政策请参见本基金合同的相关章节。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]第 235 号文审核同意，本基金 394,579,832.00 份基金份额于 2012 年 7 月 23 日在深圳证券交易所挂牌交易(其中华安沪深 300A 份额为 197,289,916.00 份，华安沪深 300B 份额为 197,289,916.00 份)。华安沪深 300 份额开放场内和场外申购、赎回，上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或

赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，可按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额上市交易但不可单独申购、赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；本基金投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。本基金力求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%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)。

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 2019 年 8 月 26 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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

本会计期间不存在差错更正。

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，

按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	20,014,267.83
定期存款	-
其他存款	-
合计	20,014,267.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		236,682,337.23	271,339,885.09	34,657,547.86
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		236,682,337.23	271,339,885.09	34,657,547.86

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,563.18
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	4.68
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	0.83
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.17
合计	3,569.86

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 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	35,989.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	35,989.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	489.57
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	61,552.65
指数使用费	50,000.00
预提上市年费	29,752.78
合计	171,547.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	207,736,296.85	180,619,990.95
本期申购	8,362.18	7,270.40
本期赎回（以“-”号填列）	-93,732.78	-81,494.76
-基金拆分/份额折算前	207,650,926.25	180,545,766.59
基金拆分/份额折算调整	4,944,131.80	—
本期申购	17,622,795.93	14,966,030.82
本期赎回（以“-”号填列）	-14,656,173.02	-12,446,682.04
本期末	215,561,680.96	183,065,115.37

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	184,740,387.95	-139,127,800.59	45,612,587.36
本期利润	336,122.98	60,619,585.82	60,955,708.80
本期基金份额交易产生的变动数	2,507,203.45	-1,367,804.74	1,139,398.71
其中：基金申购款	15,320,577.72	-7,398,879.96	7,921,697.76
基金赎回款	-12,813,374.27	6,031,075.22	-6,782,299.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,583,714.38	-79,876,019.51	107,707,694.87

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	61,067.31
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	232.64
其他	62.64
合计	61,362.59

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,321,776.18
减：卖出股票成本总额	22,159,501.86
买卖股票差价收入	-837,725.68

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,067,287.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	958,100.00
减：应收利息总额	166.32
买卖债券差价收入	109,020.75

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,893,145.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,893,145.31

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	60,619,585.82
——股票投资	60,619,585.82
——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	60,619,585.82

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	40,003.34
合计	40,003.34

注：本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	60,789.80
银行间市场交易费用	-
合计	60,789.80

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	61,552.65
银行汇划费用	1,027.25
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
合计	222,085.46

注：根据《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之

日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.02% / 当年天数。

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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.9.2 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(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
国泰君安证券股份有限公司	16,623,850.72	42.58%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	15,149.37	42.09%	15,149.37	42.09%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,349,974.79	1,386,409.74
其中：支付销售机构的客户维护费	42,925.86	27,067.01

注：支付基金管理人 华安基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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 × 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	296,994.48	305,010.22

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 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

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	20,014,267.83	61,067.31	17,412,363.40	59,889.51

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

在存续期内，本基金(包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额)不进行收益分配。

6.4.12 期末（2019 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下中签	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下中签	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST 信威	2016-12-26	重大事项停牌	6.28	2019-07-12	13.86	5,131.00	96,443.60	32,222.68	-

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

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。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。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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建设银行，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。

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上市公司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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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 2019 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	20,014,267.83	-	-	-	20,014,267.83
结算备付金	11,549.80	-	-	-	11,549.80
存出保证金	2,896.19	-	-	-	2,896.19
交易性金融资产	-	-	-	271,339,885.09	271,339,885.09
应收证券清算款	-	-	-	9,225.93	9,225.93
应收利息	-	-	-	3,569.86	3,569.86
应收申购款	1,038.75	-	-	19,846.95	20,885.70
资产总计	20,029,752.57	-	-	271,372,527.83	291,402,280.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	49.56	49.56
应付赎回款	-	-	-	138,964.41	138,964.41
应付管理人报酬	-	-	-	231,900.38	231,900.38
应付托管费	-	-	-	51,018.08	51,018.08
应付交易费用	-	-	-	35,989.95	35,989.95
其他负债	-	-	-	171,547.78	171,547.78
负债总计	-	-	-	629,470.16	629,470.16
利率敏感度缺口	20,029,752.57	-	-	270,743,057.67	290,772,810.24
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	13,612,712.94	-	-	-	13,612,712.94
结算备付金	65,349.80	-	-	-	65,349.80
存出保证金	4,349.73	-	-	-	4,349.73
交易性金融资产	-	-	41,000.00	213,048,783.27	213,089,783.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,682.54	2,682.54
应收申购款	39.95	-	-	29,799.99	29,839.94
资产总计	13,682,452.42	-	41,000.00	213,081,265.80	226,804,718.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,174.46	22,174.46
应付管理人报酬	-	-	-	198,523.97	198,523.97
应付托管费	-	-	-	43,675.28	43,675.28
应付交易费用	-	-	-	29,694.90	29,694.90
其他负债	-	-	-	278,071.00	278,071.00
应付税费	-	-	-	0.30	0.30
负债总计	-	-	-	572,139.91	572,139.91
利率敏感度缺口	13,682,452.42	-	41,000.00	212,509,125.89	226,232,578.31

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%。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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	271,339,885.09	93.32	213,048,783.27	94.17
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	271,339,885.09	93.32	213,048,783.27	94.17

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,440	增加约 1,114
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,440	减少约 1,114

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	271,339,885.09	93.12
	其中：股票	271,339,885.09	93.12
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	20,025,817.63	6.87
8	其他各项资产	36,577.68	0.01
9	合计	291,402,280.40	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	3,992,509.40	1.37
B	采矿业	8,724,192.36	3.00
C	制造业	107,808,904.47	37.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,150,951.74	2.12
E	建筑业	8,232,095.23	2.83
F	批发和零售业	3,698,930.27	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	8,311,197.54	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,817,990.35	3.38
J	金融业	95,066,486.43	32.69
K	房地产业	12,442,113.53	4.28
L	租赁和商务服务业	3,816,437.66	1.31
M	科学研究和技术服务业	199,364.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	321,727.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,349,605.73	0.46
R	文化、体育和娱乐业	1,278,576.40	0.44
S	综合	-	-
	合计	271,211,082.11	93.27

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,222.68	0.01
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	-	-
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	39,603.76	0.01
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	128,802.98	0.04

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	601318	中国平安	236,931	20,994,455.91	7.22
2	600519	贵州茅台	11,033	10,856,472.00	3.73
3	600036	招商银行	225,603	8,117,195.94	2.79
4	601166	兴业银行	318,124	5,818,487.96	2.00
5	000651	格力电器	105,252	5,788,860.00	1.99
6	000333	美的集团	101,153	5,245,794.58	1.80
7	000858	五 粮 液	42,421	5,003,556.95	1.72
8	600276	恒瑞医药	67,752	4,471,632.00	1.54
9	600887	伊利股份	133,321	4,454,254.61	1.53
10	600030	中信证券	172,131	4,098,439.11	1.41
11	601328	交通银行	600,948	3,677,801.76	1.26
12	600016	民生银行	542,967	3,447,840.45	1.19
13	601288	农业银行	838,009	3,016,832.40	1.04
14	600000	浦发银行	256,839	2,999,879.52	1.03
15	000002	万 科 A	106,395	2,958,844.95	1.02
16	300498	温氏股份	81,400	2,919,004.00	1.00
17	601398	工商银行	471,745	2,778,578.05	0.96
18	601668	中国建筑	460,180	2,646,035.00	0.91
19	000001	平安银行	187,821	2,588,173.38	0.89
20	600900	长江电力	144,335	2,583,596.50	0.89
21	600837	海通证券	176,956	2,511,005.64	0.86
22	601601	中国太保	68,763	2,510,537.13	0.86
23	002415	海康威视	81,798	2,255,988.84	0.78
24	600048	保利地产	156,100	1,991,836.00	0.69
25	600104	上汽集团	76,693	1,955,671.50	0.67
26	601169	北京银行	323,722	1,913,197.02	0.66
27	601888	中国国旅	21,450	1,901,542.50	0.65
28	603288	海天味业	17,800	1,869,000.00	0.64
29	600585	海螺水泥	43,716	1,814,214.00	0.62
30	601211	国泰君安	98,600	1,809,310.00	0.62
31	000725	京东方 A	518,484	1,783,584.96	0.61
32	600009	上海机场	21,066	1,764,909.48	0.61
33	601988	中国银行	462,010	1,727,917.40	0.59
34	601766	中国中车	213,329	1,725,831.61	0.59
35	000063	中兴通讯	52,069	1,693,804.57	0.58
36	600031	三一重工	128,235	1,677,313.80	0.58
37	002304	洋河股份	13,500	1,641,060.00	0.56
38	600028	中国石化	292,641	1,600,746.27	0.55
39	601688	华泰证券	71,579	1,597,643.28	0.55
40	300059	东方财富	117,554	1,592,856.70	0.55
41	601088	中国神华	72,153	1,470,478.14	0.51
42	600309	万华化学	34,326	1,468,809.54	0.51
43	601229	上海银行	119,560	1,416,786.00	0.49
44	600690	青岛海尔	80,022	1,383,580.38	0.48

45	002142	宁波银行	56,952	1,380,516.48	0.47
46	002475	立讯精密	53,977	1,338,089.83	0.46
47	601818	光大银行	349,128	1,330,177.68	0.46
48	000568	泸州老窖	16,069	1,298,857.27	0.45
49	000338	潍柴动力	104,816	1,288,188.64	0.44
50	600340	华夏幸福	39,416	1,283,779.12	0.44
51	601012	隆基股份	55,534	1,283,390.74	0.44
52	600019	宝钢股份	194,917	1,266,960.50	0.44
53	600050	中国联通	203,741	1,255,044.56	0.43
54	601857	中国石油	177,514	1,221,296.32	0.42
55	002027	分众传媒	224,752	1,188,938.08	0.41
56	601989	中国重工	200,603	1,115,352.68	0.38
57	600919	江苏银行	151,500	1,099,890.00	0.38
58	601939	建设银行	147,200	1,095,168.00	0.38
59	001979	招商蛇口	51,899	1,084,689.10	0.37
60	002714	牧原股份	18,260	1,073,505.40	0.37
61	601009	南京银行	129,900	1,072,974.00	0.37
62	600999	招商证券	62,587	1,069,611.83	0.37
63	002230	科大讯飞	32,061	1,065,707.64	0.37
64	601390	中国中铁	163,085	1,063,314.20	0.37
65	601006	大秦铁路	130,073	1,052,290.57	0.36
66	600015	华夏银行	134,580	1,036,266.00	0.36
67	601628	中国人寿	36,530	1,034,529.60	0.36
68	000661	长春高新	3,000	1,014,000.00	0.35
69	002594	比亚迪	19,873	1,007,958.56	0.35
70	601336	新华保险	18,235	1,003,472.05	0.35
71	601186	中国铁建	100,597	1,000,940.15	0.34
72	601899	紫金矿业	265,411	1,000,599.47	0.34
73	000166	申万宏源	197,160	987,771.60	0.34
74	600570	恒生电子	14,017	955,258.55	0.33
75	000538	云南白药	11,429	953,407.18	0.33
76	002024	苏宁易购	81,426	934,770.48	0.32
77	600352	浙江龙盛	56,910	897,470.70	0.31
78	000776	广发证券	64,695	888,909.30	0.31
79	601669	中国电建	167,678	887,016.62	0.31
80	601933	永辉超市	83,912	856,741.52	0.29
81	300015	爱尔眼科	27,109	839,565.73	0.29
82	600958	东方证券	78,300	836,244.00	0.29
83	601225	陕西煤业	87,512	808,610.88	0.28
84	000876	新 希 望	46,060	800,062.20	0.28
85	000100	TCL 集团	237,102	789,549.66	0.27
86	601155	新城控股	19,700	784,257.00	0.27
87	300142	沃森生物	26,900	762,884.00	0.26
88	600436	片仔癀	6,600	760,320.00	0.26

89	600406	国电南瑞	40,403	753,111.92	0.26
90	002202	金风科技	60,357	750,237.51	0.26
91	600741	华域汽车	34,530	745,848.00	0.26
92	600588	用友网络	27,214	731,512.32	0.25
93	002736	国信证券	53,800	708,008.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	30,709	698,015.57	0.24
95	601377	兴业证券	102,489	690,775.86	0.24
96	000157	中联重科	112,329	675,097.29	0.23
97	600010	包钢股份	398,870	674,090.30	0.23
98	600547	山东黄金	16,205	667,159.85	0.23
99	000783	长江证券	84,676	661,319.56	0.23
100	600795	国电电力	257,932	655,147.28	0.23
101	601901	方正证券	90,227	641,513.97	0.22
102	002008	大族激光	18,628	640,430.64	0.22
103	600705	中航资本	117,774	638,335.08	0.22
104	601111	中国国航	65,414	626,011.98	0.22
105	000069	华侨城 A	89,709	623,477.55	0.21
106	603993	洛阳钼业	154,858	613,237.68	0.21
107	600111	北方稀土	47,709	612,583.56	0.21
108	601108	财通证券	55,000	603,900.00	0.21
109	600703	三安光电	53,514	603,637.92	0.21
110	600011	华能国际	96,200	599,326.00	0.21
111	600438	通威股份	42,500	597,550.00	0.21
112	600383	金地集团	49,403	589,377.79	0.20
113	600089	特变电工	81,218	588,830.50	0.20
114	601800	中国交建	51,531	583,330.92	0.20
115	600029	南方航空	75,228	580,760.16	0.20
116	600886	国投电力	74,246	576,891.42	0.20
117	002236	大华股份	39,297	570,592.44	0.20
118	601985	中国核电	102,400	569,344.00	0.20
119	600271	航天信息	24,486	564,402.30	0.19
120	002007	华兰生物	18,446	562,418.54	0.19
121	002422	科伦药业	18,900	561,897.00	0.19
122	601600	中国铝业	143,077	560,861.84	0.19
123	600196	复星医药	21,959	555,562.70	0.19
124	600606	绿地控股	79,800	545,034.00	0.19
125	002001	新 和 成	28,200	543,978.00	0.19
126	002311	海大集团	17,500	540,750.00	0.19
127	000895	双汇发展	21,669	539,341.41	0.19
128	300003	乐普医疗	23,400	538,668.00	0.19
129	601555	东吴证券	52,502	538,145.50	0.19
130	600115	东方航空	85,786	537,878.22	0.18
131	600061	国投资本	37,000	518,370.00	0.18
132	600109	国金证券	52,949	514,664.28	0.18

133	601997	贵阳银行	59,220	512,253.00	0.18
134	600221	海航控股	251,621	510,790.63	0.18
135	002044	美年健康	41,000	510,040.00	0.18
136	600332	白云山	12,279	503,070.63	0.17
137	300124	汇川技术	21,762	498,567.42	0.17
138	000963	华东医药	19,149	497,108.04	0.17
139	000413	东旭光电	95,946	493,162.44	0.17
140	600522	中天科技	53,700	492,429.00	0.17
141	601788	光大证券	42,800	488,776.00	0.17
142	600487	亨通光电	29,100	487,716.00	0.17
143	600177	雅戈尔	76,804	487,705.40	0.17
144	002410	广联达	14,800	486,772.00	0.17
145	603019	中科曙光	13,800	484,380.00	0.17
146	600018	上港集团	70,926	483,715.32	0.17
147	000768	中航飞机	30,290	477,067.50	0.16
148	601618	中国中冶	156,571	475,975.84	0.16
149	600637	东方明珠	45,016	474,468.64	0.16
150	600100	同方股份	51,908	469,767.40	0.16
151	000425	徐工机械	104,147	464,495.62	0.16
152	300033	同花顺	4,700	462,292.00	0.16
153	601607	上海医药	25,285	458,922.75	0.16
154	300017	网宿科技	42,565	458,850.70	0.16
155	002352	顺丰控股	13,500	458,460.00	0.16
156	300122	智飞生物	10,500	452,550.00	0.16
157	600893	航发动力	19,693	447,228.03	0.15
158	300408	三环集团	22,900	445,405.00	0.15
159	002271	东方雨虹	19,600	444,136.00	0.15
160	600176	中国巨石	46,000	438,380.00	0.15
161	601877	正泰电器	18,900	436,401.00	0.15
162	600516	方大炭素	35,313	433,996.77	0.15
163	600498	烽火通信	15,300	426,258.00	0.15
164	601919	中远海控	84,900	426,198.00	0.15
165	300136	信维通信	17,100	418,095.00	0.14
166	601727	上海电气	77,300	415,874.00	0.14
167	600004	白云机场	22,600	411,320.00	0.14
168	600867	通化东宝	26,700	411,180.00	0.14
169	000728	国元证券	44,170	405,038.90	0.14
170	601998	中信银行	67,215	401,273.55	0.14
171	002460	赣锋锂业	17,100	400,653.00	0.14
172	000423	东阿阿胶	10,005	398,399.10	0.14
173	600023	浙能电力	89,217	394,339.14	0.14
174	600809	山西汾酒	5,700	393,585.00	0.14
175	600489	中金黄金	37,765	387,846.55	0.13
176	002673	西部证券	38,296	386,023.68	0.13

177	002466	天齐锂业	15,010	379,452.80	0.13
178	601018	宁波港	86,422	379,392.58	0.13
179	002241	歌尔股份	42,560	378,358.40	0.13
180	600066	宇通客车	29,029	377,957.58	0.13
181	600068	葛洲坝	60,445	376,572.35	0.13
182	002179	中航光电	11,200	374,752.00	0.13
183	600926	杭州银行	44,860	373,683.80	0.13
184	300144	宋城演艺	15,900	367,926.00	0.13
185	600170	上海建工	97,417	366,287.92	0.13
186	300024	机器人	23,856	363,326.88	0.12
187	002081	金螳螂	35,089	361,767.59	0.12
188	601021	春秋航空	8,000	360,000.00	0.12
189	601198	东兴证券	30,200	358,776.00	0.12
190	600362	江西铜业	22,688	357,109.12	0.12
191	002146	荣盛发展	38,006	356,876.34	0.12
192	600398	海澜之家	39,300	356,451.00	0.12
193	600219	南山铝业	156,820	354,413.20	0.12
194	600482	中国动力	15,000	354,300.00	0.12
195	002602	世纪华通	32,396	353,764.32	0.12
196	000961	中南建设	40,600	351,596.00	0.12
197	601838	成都银行	39,600	349,668.00	0.12
198	600085	同仁堂	11,997	347,913.00	0.12
199	601881	中国银河	28,300	346,675.00	0.12
200	603156	养元饮品	9,260	343,360.80	0.12
201	600674	川投能源	38,556	343,148.40	0.12
202	000703	恒逸石化	24,900	340,134.00	0.12
203	000630	铜陵有色	138,155	339,861.30	0.12
204	002739	万达电影	18,200	335,608.00	0.12
205	000786	北新建材	18,500	335,405.00	0.12
206	002493	荣盛石化	27,500	331,650.00	0.11
207	600535	天士力	19,893	329,229.15	0.11
208	002456	欧菲光	41,577	325,963.68	0.11
209	300070	碧水源	41,300	321,727.00	0.11
210	603986	兆易创新	3,700	320,790.00	0.11
211	600297	广汇汽车	71,650	319,559.00	0.11
212	002050	三花智控	30,200	318,610.00	0.11
213	000629	攀钢钒钛	93,900	318,321.00	0.11
214	002555	三七互娱	23,200	314,360.00	0.11
215	601138	工业富联	26,000	313,300.00	0.11
216	600369	西南证券	61,754	305,064.76	0.10
217	300296	利亚德	38,900	304,587.00	0.10
218	603799	华友钴业	14,186	302,303.66	0.10
219	603833	欧派家居	2,800	301,336.00	0.10
220	600663	陆家嘴	19,200	297,600.00	0.10

221	002624	完美世界	11,500	296,815.00	0.10
222	000596	古井贡酒	2,500	296,275.00	0.10
223	600208	新湖中宝	94,004	295,172.56	0.10
224	600118	中国卫星	12,964	292,338.20	0.10
225	002065	东华软件	40,868	285,667.32	0.10
226	000625	长安汽车	42,683	282,988.29	0.10
227	002508	老板电器	10,400	282,256.00	0.10
228	000656	金科股份	46,700	281,601.00	0.10
229	600346	恒力石化	23,080	280,652.80	0.10
230	000627	天茂集团	43,200	280,368.00	0.10
231	000709	河钢股份	92,872	277,687.28	0.10
232	603160	汇顶科技	2,000	277,600.00	0.10
233	600153	建发股份	31,021	275,466.48	0.09
234	601992	金隅集团	73,158	275,074.08	0.09
235	002032	苏 泊 尔	3,600	272,988.00	0.09
236	601878	浙商证券	29,200	271,560.00	0.09
237	600583	海油工程	48,354	270,782.40	0.09
238	600027	华电国际	71,300	268,801.00	0.09
239	600760	中航沈飞	9,200	267,076.00	0.09
240	600038	中直股份	6,442	264,250.84	0.09
241	601117	中国化学	43,132	259,654.64	0.09
242	600977	中国电影	16,300	255,258.00	0.09
243	002153	石基信息	7,000	253,330.00	0.09
244	603858	步长制药	9,750	251,257.50	0.09
245	600688	上海石化	48,075	248,067.00	0.09
246	600415	小商品城	59,534	245,280.08	0.08
247	601216	君正集团	73,820	242,867.80	0.08
248	002558	巨人网络	13,300	241,661.00	0.08
249	600816	安信信托	47,820	241,491.00	0.08
250	000671	阳 光 城	35,400	229,392.00	0.08
251	002252	上海莱士	32,660	226,987.00	0.08
252	601238	广汽集团	20,300	221,879.00	0.08
253	601319	中国人保	23,300	221,117.00	0.08
254	601633	长城汽车	26,467	218,882.09	0.08
255	002010	传化智联	28,500	214,605.00	0.07
256	600566	济川药业	7,100	213,781.00	0.07
257	600188	兖州煤业	19,440	211,312.80	0.07
258	002310	东方园林	35,200	211,200.00	0.07
259	601066	中信建投	9,800	206,584.00	0.07
260	002294	信立泰	9,200	205,896.00	0.07
261	000402	金 融 街	26,133	204,882.72	0.07
262	600704	物产中大	37,700	204,334.00	0.07
263	300072	三聚环保	25,730	204,038.90	0.07
264	603259	药明康德	2,300	199,364.00	0.07

265	000898	鞍钢股份	52,520	199,050.80	0.07
266	002601	龙蟠佰利	13,300	197,239.00	0.07
267	002120	韵达股份	6,330	195,090.60	0.07
268	601898	中煤能源	40,100	192,480.00	0.07
269	601360	三六零	8,900	190,282.00	0.07
270	300413	芒果超媒	4,600	188,830.00	0.06
271	002773	康弘药业	5,730	188,631.60	0.06
272	002411	延安必康	10,051	174,887.40	0.06
273	600372	中航电子	11,536	171,194.24	0.06
274	000938	紫光股份	6,268	170,803.00	0.06
275	601228	广州港	40,600	169,708.00	0.06
276	002468	申通快递	6,700	167,098.00	0.06
277	002938	鹏鼎控股	5,600	164,416.00	0.06
278	600025	华能水电	39,400	160,358.00	0.06
279	000415	渤海租赁	40,600	159,152.00	0.05
280	600339	中油工程	36,600	154,452.00	0.05
281	600998	九州通	12,300	152,028.00	0.05
282	300251	光线传媒	19,258	130,954.40	0.05
283	601808	中海油服	13,000	125,190.00	0.04
284	002939	长城证券	7,500	125,175.00	0.04
285	601162	天风证券	11,300	122,492.00	0.04
286	300433	蓝思科技	17,199	119,877.03	0.04
287	002925	盈趣科技	3,000	117,030.00	0.04
288	002945	华林证券	5,900	109,150.00	0.04
289	600390	五矿资本	11,500	108,445.00	0.04
290	000408	藏格控股	13,100	108,337.00	0.04
291	000553	安道麦 A	10,000	107,200.00	0.04
292	601828	美凯龙	8,800	106,920.00	0.04
293	603260	合盛硅业	2,200	103,532.00	0.04
294	600233	圆通速递	8,000	98,640.00	0.03
295	601298	青岛港	10,600	88,934.00	0.03
296	002625	光启技术	9,400	87,326.00	0.03
297	601212	白银有色	18,900	82,971.00	0.03
298	601577	长沙银行	8,200	78,228.00	0.03
299	600733	北汽蓝谷	9,200	75,992.00	0.03
300	600299	安迪苏	6,500	67,405.00	0.02

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

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	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01

2	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
3	600485	*ST 信威	5,131	32,222.68	0.01
4	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

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	300498	温氏股份	3,294,705.00	1.46
2	601166	兴业银行	696,826.00	0.31
3	601088	中国神华	556,515.00	0.25
4	603019	中科曙光	543,148.00	0.24
5	601108	财通证券	527,437.00	0.23
6	600276	恒瑞医药	493,533.00	0.22
7	002410	广联达	432,573.00	0.19
8	002739	万达电影	352,043.00	0.16
9	002027	分众传媒	334,626.00	0.15
10	000629	攀钢钒钛	330,654.00	0.15
11	601318	中国平安	321,274.00	0.14
12	300059	东方财富	313,787.00	0.14
13	600663	陆家嘴	309,969.20	0.14
14	000656	金科股份	290,814.00	0.13
15	002714	牧原股份	278,703.00	0.12
16	000596	古井贡酒	274,056.00	0.12
17	600989	宝丰能源	270,838.72	0.12
18	601838	成都银行	269,570.00	0.12
19	603156	养元饮品	269,206.00	0.12
20	600061	国投资本	266,842.00	0.12

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	601318	中国平安	966,978.00	0.43
2	600518	ST 康美	469,786.08	0.21
3	600519	贵州茅台	464,744.00	0.21
4	600036	招商银行	440,494.00	0.19

5	000540	中天金融	395,376.00	0.17
6	600739	辽宁成大	381,123.39	0.17
7	600989	宝丰能源	373,448.48	0.17
8	600549	厦门钨业	307,930.65	0.14
9	002797	第一创业	294,483.00	0.13
10	000503	国新健康	282,924.94	0.13
11	002572	索菲亚	273,072.00	0.12
12	002007	华兰生物	271,842.50	0.12
13	000839	中信国安	265,610.00	0.12
14	600909	华安证券	257,771.00	0.11
15	601333	广深铁路	250,591.25	0.11
16	000651	格力电器	243,689.00	0.11
17	600157	永泰能源	239,924.40	0.11
18	000858	五 粮 液	239,433.54	0.11
19	000333	美的集团	224,183.00	0.10
20	000983	西山煤电	223,322.68	0.10

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,831,017.86
卖出股票的收入（成交）总额	21,321,776.18

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。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

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	2,896.19
2	应收证券清算款	9,225.93
3	应收股利	-
4	应收利息	3,569.86

5	应收申购款	20,885.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,577.68

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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

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 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.01	网下中签未上市
2	600485	*ST 信威	32,222.68	0.01	重大事项停牌
3	300788	中信出版	23,106.60	0.01	网下中签未上市

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

份额级别	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

华安沪深 300 指数分级 A	113	12,204.91	0.00	0.00%	1,379,155.00	100.00%
华安沪深 300 指数分级 B	208	6,630.55	0.00	0.00%	1,379,155.00	100.00%
华安沪深 300 指数分级	4,239	50,201.31	193,104,148.99	90.74%	19,699,221.97	9.26%
合计	4,560	47,272.30	193,104,148.99	89.58%	22,457,531.97	10.42%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华安沪深 300 指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	解咏梅	867,058.00	62.87%
2	刘洋	81,500.00	5.91%
3	周敬	50,003.00	3.63%
4	黄晖	44,399.00	3.22%
5	罗广斌	42,139.00	3.06%
6	程竞姣	41,099.00	2.98%
7	张凤贤	38,093.00	2.76%
8	曹耀华	28,256.00	2.05%
9	方菊华	25,310.00	1.84%
10	黄赛菊	25,002.00	1.81%

华安沪深300指数分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴为军	151,000.00	10.95%
2	孙芹	100,000.00	7.25%
3	陈志伟	91,070.00	6.60%
4	黄美菊	84,000.00	6.09%
5	马志海	78,442.00	5.69%
6	李政	64,099.00	4.65%
7	胡伟	60,000.00	4.35%
8	关玉意	47,700.00	3.46%
9	张欣	33,400.00	2.42%
10	朱松枝	30,303.00	2.20%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华安沪深 300 指数分级 A	867,058.00	62.87%
	华安沪深 300 指数分级 B	0.00	0.00%
	华安沪深 300 指数分级	2,249.48	0.00%
	合计	869,307.48	0.40%

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

项目	华安沪深 300 指数 分级 A	华安沪深 300 指数 分级 B	华安沪深 300 指数 分级
基金合同生效日（2012 年 6 月 25 日）基金份额总额	197,289,916.00	197,289,916.00	212,734,025.99
本报告期期初基金份额总额	1,485,760.00	1,485,760.00	204,764,776.85
本报告期基金总申购份额	-	-	17,631,158.11
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	14,749,905.80
本报告期基金拆分变动份额	-106,605.00	-106,605.00	5,157,341.80
本报告期期末基金份额总额	1,379,155.00	1,379,155.00	212,803,370.96

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。

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：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
联讯证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	18,397,024.95	47.13%	17,133.40	47.61%	-
国泰君安	1	16,623,850.72	42.58%	15,149.37	42.09%	-
中信建投	1	1,320,402.23	3.38%	1,229.81	3.42%	-
方正证券	1	1,183,511.49	3.03%	1,078.56	3.00%	-
招商证券	3	989,579.05	2.53%	921.60	2.56%	-
天风证券	2	523,689.84	1.34%	477.21	1.33%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2019 年 2 月完成租用托管在建行的深交所新时代证券 007691 交易单元。

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	
	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
联讯证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	618,371.00	57.94%	-	-	-	-
国泰君安	10,098.20	0.95%	-	-	-	-
中信建投	55,453.90	5.20%	-	-	-	-
方正证券	335,721.97	31.46%	-	-	-	-
招商证券	47,642.00	4.46%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间华安沪深 300A 份额停复牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-03
2	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金之华安沪深 300A 份额 2019 年度约定年基准收益率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-03
3	关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-04
4	关于华安沪深 300A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-04
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-05
6	关于旗下部分基金参加基煜基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-15
7	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及定期定额投资的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-26
8	华安基金关于参加国泰君安证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-27
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长春高新”股票估值调整的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-28
10	华安基金关于旗下基金参加国信证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-05
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“信威集团”股票估值调整的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-06
12	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 指数分级证券投资基金调整场内大额申购、定投及转换转入业务和恢复场外大额申购、定投及转换转入业务并暂停跨系统转托管(场外转场内)业务的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-09
13	华安基金关于旗下基金参加中国中投证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-27
14	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
15	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-30

16	华安基金关于旗下基金参加方正证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-02
17	华安基金关于旗下基金参加民族证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-02
18	华安基金关于旗下基金参加中金公司优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-08
19	华安基金关于旗下基金参加植信基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-12
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“隆基股份”股票估值调整的公告(ETF 除外)	《证券时报》和公司网站	2019-04-17
21	关于旗下部分基金增加玄元保险为销售机构的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-17
22	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-08
23	华安基金关于旗下基金参加民生银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-14
24	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-15
25	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-18
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“云南白药”股票估值调整的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-23
27	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-23
28	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-28
29	华安基金关于旗下基金参加海银基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-28
30	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-31
31	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-05
32	华安沪深 300 指数分级证券投资基金之 HS300B 溢价风险提示公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-11
33	华安基金关于参加长城国瑞证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-17
34	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-21
35	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
36	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《证券时报》和公司网站

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	188,613,298.60	4,490,850.39	0.00	193,104,148.99	89.58%
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、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 指数分级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

二〇一九年八月二十八日