

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	12
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
7.3.1 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	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39

8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
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	44
10.8 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安创业板 50ETF
场内简称	创业板 50
基金主代码	159949
交易代码	159949
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2016 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
报告期末基金份额总额	14,485,785,113.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	创业板 50 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	北京市西城区闹市口大街1号

	世纪大道8号国金中心二期31 —32层	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、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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	1,134,710,153.13
本期利润	2,041,213,159.83
加权平均基金份额本期利润	0.1273
本期加权平均净值利润率	24.68%
本期基金份额净值增长率	20.94%
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	-6,831,733,928.21
期末可供分配基金份额利润	-0.4716
期末基金资产净值	7,654,051,184.79
期末基金份额净值	0.5284
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	-47.16%

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	4.28%	1.48%	3.70%	1.51%	0.58%	-0.03%
过去三个月	-10.30%	1.97%	-10.96%	1.98%	0.66%	-0.01%
过去六个月	20.94%	2.04%	20.57%	2.05%	0.37%	-0.01%
过去一年	-10.29%	1.99%	-10.48%	2.01%	0.19%	-0.02%
过去三年	-47.16%	1.64%	-42.47%	1.65%	-4.69%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-47.16%	1.64%	-41.68%	1.65%	-5.48%	-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

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 6 月 30 日至 2019 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2016-06-30	-	15 年	理学博士，15 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任

					华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任本基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围

内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，国内经济总体运行平稳，二季度 GDP 同比增长 6.2%，增速较一季度放缓 0.2 个百分点，显示经济下行压力有所加大。上半年的固定资产投资同比增长 5.8%，增速逐步企稳；在汽车销量推升下，消费数据表现强劲，社零总额增长 8.4%，而出口则延续减速走势。海外方面，主要经济体的制造业 PMI 指数持续创新低，各国央行纷纷开启宽松模式，美联储 6 月的 FOMC 议息会议，基本确认美国降息周期的开启，使得新兴市场资本外流的压力有所缓解。

上半年国内 A 股市场走势先扬后抑，一季度大幅上涨，二季度有所回落，总体而言，上半年 A 股涨幅在全球主要股指中仍位居前列，创业板 50 指数上涨 20.57%。

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，从而控制每日跟踪误差、以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

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 0.5284 元，本报告期份额净值增长率为 20.94%，同期业绩比较基准增长率为 20.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济稳中趋缓的方向未有改变，依然面临内外部的诸多不确定因素的扰动，尤其是制造业及房地产投资，下半年仍将是探底的过程，而全球需求回落及中美谈判尚未达成实质性协议等外部不利因素依然存在，我们预计下半年逆周期的宏观对冲力度会进一步加大，专项债作为重大工程项目资本金将成为拉动基建投资的重要推手，我们认为，下半年市场整体的流动性环境仍将保持宽松，出台降准或定向降准的概率较高。

下半年，随着科创板企业的逐步上市，创业板中信息技术、高端装备、新材料等有业绩支撑的公司估值提振效应将进一步凸显；而证监会修订《上市公司重大资产重组管理办法》使创业板并购重组重获支持；另一方面，G20 峰会后中美重启贸易，华为禁令实质性大部分解除，也将对国内相关科技企业形成利好。而从长期看，境外资金的持仓结构正逐步改变，相较主板，创业板配置比例一直在稳步提升。

因此，我们仍然看好科技成长型公司的后市表现，尤其是大市值的创业板头部公司，创业板 50 指数具备中长期的战略配置价值。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

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	29,365,083.87	62,149,149.90
结算备付金		4,483,800.32	8,693,675.00
存出保证金		333,916.08	385,167.10
交易性金融资产	6.4.7.2	7,626,514,422.02	9,139,471,097.79
其中：股票投资		7,626,514,422.02	9,136,993,226.03
基金投资		-	-
债券投资		-	2,477,871.76
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		1,687,257.91	-
应收利息	6.4.7.5	6,842.41	18,865.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,662,391,322.61	9,210,717,955.39
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		297,320.22	27,196,215.80
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		3,129,345.96	3,876,222.57
应付托管费		625,869.21	775,244.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	2,934,179.82	4,811,755.26
应交税费		-	16.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,353,422.61	1,814,300.12
负债合计		8,340,137.82	38,473,755.13
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.8	14,485,785,113.00	20,995,285,113.00
未分配利润	6.4.7.9	-6,831,733,928.21	-11,823,040,912.74
所有者权益合计		7,654,051,184.79	9,172,244,200.26
负债和所有者权益总计		7,662,391,322.61	9,210,717,955.39

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5284 元，基金份额总额 14,485,785,113.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

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		2,072,035,824.35	-793,428,161.85
1.利息收入		308,193.95	473,951.04
其中：存款利息收入	6.4.7.10	303,555.16	473,708.84
债券利息收入		4,638.79	242.20
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）		1,153,818,712.82	-324,053,591.52
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,123,633,110.99	-343,919,300.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,458,416.75	254,051.71
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	26,727,185.08	19,611,656.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	906,503,006.70	-467,526,837.83

填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	11,405,910.88	-2,321,683.54
减: 二、费用		30,822,664.52	12,912,080.48
1. 管理人报酬		20,571,169.16	7,225,355.05
2. 托管费		4,114,233.87	1,445,071.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,720,150.13	3,612,314.41
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		15.29	0.86
7. 其他费用	6.4.7.20	1,417,096.07	629,339.11
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,041,213,159.83	-806,340,242.33
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,041,213,159.83	-806,340,242.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

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)	20,995,285,113.00	-11,823,040,912.74	9,172,244,200.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,041,213,159.83	2,041,213,159.83
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)	-6,509,500,000.00	2,950,093,824.70	-3,559,406,175.30
其中: 1.基金申购款	41,666,500,000.00	-19,203,684,793.51	22,462,815,206.49
2.基金赎回款	-48,176,000,000.00	22,153,778,618.21	-26,022,221,381.79
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)	14,485,785,113.00	-6,831,733,928.21	7,654,051,184.79
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）	288,285,113.00	-86,678,012.66	201,607,100.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-806,340,242.33	-806,340,242.33
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）	9,288,500,000.00	-3,043,517,489.87	6,244,982,510.13
其中：1.基金申购款	27,909,000,000.00	-9,294,073,027.69	18,614,926,972.31
2.基金赎回款	-18,620,500,000.00	6,250,555,537.82	-12,369,944,462.18
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）	9,576,785,113.00	-3,936,535,744.86	5,640,249,368.14

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

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]867 号《关于准予华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 550,247,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 870 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 550,285,113.00 份基金份额，其中网上现金方式认购资金利息折合 38,113.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2016]461 号文审核同意，本基金 550,285,113.00

份基金份额于 2016 年 7 月 22 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为创业板 50 指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；投资范围为标的指数创业板 50 指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、固定收益资产(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：创业板 50 指数收益率。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2018 年 11 月 8 日将华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华安创业板 50ETF 联接基金”)。华安创业板 50ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 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》、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 06 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 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 06 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	29,365,083.87
定期存款	-
其他存款	-
合计	29,365,083.87

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	7,653,090,090.52	7,626,514,422.02	-26,575,668.50
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	7,653,090,090.52	7,626,514,422.02	-26,575,668.50

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,393.83
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	1,313.31
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	135.27
合计	6,842.41

6.4.7.6 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	2,934,179.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,934,179.82

6.4.7.7 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	-
预提审计费	79,343.16
预提信息披露费	64,183.36
指数使用费	577,174.54
预提上市年费	29,752.78
可退替代款	405,985.37
应付替代款	196,983.40
合计	1,353,422.61

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.8 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	20,995,285,113.00	20,995,285,113.00
本期申购	41,666,500,000.00	41,666,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-48,176,000,000.00	-48,176,000,000.00
本期末	14,485,785,113.00	14,485,785,113.00

6.4.7.9 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	-8,800,960,111.02	-3,022,080,801.72	-11,823,040,912.74
本期利润	1,134,710,153.13	906,503,006.70	2,041,213,159.83
本期基金份额交易产生的变动数	2,757,064,896.93	193,028,927.77	2,950,093,824.70

其中：基金申购款	-14,921,999,669.57	-4,281,685,123.94	-19,203,684,793.51
基金赎回款	17,679,064,566.50	4,474,714,051.71	22,153,778,618.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,909,185,060.96	-1,922,548,867.25	-6,831,733,928.21

6.4.7.10 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	130,168.76
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	170,389.12
其他	2,997.28
合计	303,555.16

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-65,547,817.21
股票投资收益——赎回差价收入	1,189,180,928.20
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	1,123,633,110.99

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,342,946,569.61
减：卖出股票成本总额	1,408,494,386.82
买卖股票差价收入	-65,547,817.21

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	26,022,221,381.79
减：现金支付赎回款总额	-1,231,094,087.21
减：赎回股票成本总额	26,064,134,540.80
赎回差价收入	1,189,180,928.20

6.4.7.12 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	29,017,597.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,553,700.00
减：应收利息总额	5,480.63
买卖债券差价收入	3,458,416.75

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 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	26,727,185.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	26,727,185.08

6.4.7.17 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	906,503,006.70
——股票投资	906,436,078.46
——债券投资	66,928.24
——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	906,503,006.70

6.4.7.18 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	-
替代损益	11,405,910.88
合计	11,405,910.88

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

6.4.7.19 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	4,720,150.13
银行间市场交易费用	-
合计	4,720,150.13

6.4.7.20 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	79,343.16
信息披露费	64,183.36
银行汇划费用	9,186.62
上市年费	29,752.78
帐户维护费	360.00
指数使用费	1,234,270.15

合计	1,417,096.07
----	--------------

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	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
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东
华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	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

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	2,631,417,231.63	77.95%	-	-

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	2,398,013.81	77.95%	2,398,013.81	81.73%
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	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	20,571,169.16	7,225,355.05
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 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	4,114,233.87	1,445,071.05

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华安创业板 50ETF 联接基金	301,184,400.00	2.08%	27,291,000.00	0.13%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	29,365,083.87	130,168.76	113,401,724.62	355,376.88

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票基金，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。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，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、监察稽核部和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的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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

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

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	29,365,083.87	-	-	-	29,365,083.87
结算备付金	4,483,800.32	-	-	-	4,483,800.32
存出保证金	333,916.08	-	-	-	333,916.08
交易性金融资产	-	-	-	7,626,514,422.02	7,626,514,422.02
应收证券清算款	-	-	-	1,687,257.91	1,687,257.91
应收利息	-	-	-	6,842.41	6,842.41
资产总计	34,182,800.27	-	-	7,628,208,522.34	7,662,391,322.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	297,320.22	297,320.22
应付管理人报酬	-	-	-	3,129,345.96	3,129,345.96
应付托管费	-	-	-	625,869.21	625,869.21
应付交易费用	-	-	-	2,934,179.82	2,934,179.82
其他负债	-	-	-	1,353,422.61	1,353,422.61
负债总计	-	-	-	8,340,137.82	8,340,137.82
利率敏感度缺口	34,182,800.27	-	-	7,619,868,384.52	7,654,051,184.79
上年度末 2018 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	62,149,149.90	-	-	-	62,149,149.90
结算备付金	8,693,675.00	-	-	-	8,693,675.00
存出保证金	385,167.10	-	-	-	385,167.10
交易性金融资产	-	-	2,477,871.76	9,136,993,226.03	9,139,471,097.79
应收利息	-	-	-	18,865.60	18,865.60
资产总计	71,227,992.00	-	2,477,871.76	9,137,012,091.63	9,210,717,955.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	27,196,215.80	27,196,215.80
应付管理人报酬	-	-	-	3,876,222.57	3,876,222.57
应付托管费	-	-	-	775,244.52	775,244.52
应付交易费用	-	-	-	4,811,755.26	4,811,755.26
应交税费	-	-	-	16.86	16.86
其他负债	-	-	-	1,814,300.12	1,814,300.12
负债总计	-	-	-	38,473,755.13	38,473,755.13
利率敏感度缺口	71,227,992.00	-	2,477,871.76	9,098,538,336.50	9,172,244,200.26

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，本基金未持有的交易性债券投资。（2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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。本基金投资组合中，投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时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	7,626,514,422.02	99.64	9,136,993,226.03	99.62
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	7,626,514,422.02	99.64	9,136,993,226.03	99.62

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	上年度末
		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 37,997	增加约 45,633
	业绩比较基准下降 5%	减少约 37,997	减少约 45,633

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	7,626,514,422.02	99.53
	其中：股票	7,626,514,422.02	99.53
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	33,848,884.19	0.44
8	其他各项资产	2,028,016.40	0.03
9	合计	7,662,391,322.61	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,145,806,001.43	54.16
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	2,242,151,414.17	29.29
J	金融业	-	-
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	99,222,563.04	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	140,035,891.14	1.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	670,652,161.63	8.76
R	文化、体育和娱乐业	328,666,941.41	4.29
S	综合	-	-
	合计	7,626,534,972.82	99.64

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 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	300059	东方财富	53,582,429	726,041,912.95	9.49
2	300750	宁德时代	7,831,326	539,421,734.88	7.05
3	300015	爱尔眼科	12,692,449	393,085,145.53	5.14
4	300142	沃森生物	13,344,347	378,445,680.92	4.94
5	300347	泰格医药	3,600,091	277,567,016.10	3.63
6	300003	乐普医疗	11,969,827	275,545,417.54	3.60
7	300124	汇川技术	11,500,628	263,479,387.48	3.44
8	300760	迈瑞医疗	1,367,007	223,095,542.40	2.91
9	300408	三环集团	11,165,224	217,163,606.80	2.84
10	300017	网宿科技	19,732,481	212,716,145.18	2.78
11	300136	信维通信	8,561,974	209,340,264.30	2.74
12	300122	智飞生物	4,840,015	208,604,646.50	2.73
13	300033	同花顺	2,048,368	201,477,476.48	2.63
14	300024	机器人	12,591,661	191,770,997.03	2.51
15	300253	卫宁健康	12,278,872	174,114,404.96	2.27
16	300383	光环新网	10,247,740	171,854,599.80	2.25
17	300450	先导智能	4,886,008	164,169,868.80	2.14
18	300014	亿纬锂能	5,294,132	161,259,260.72	2.11
19	300146	汤臣倍健	7,913,196	153,516,002.40	2.01
20	300601	康泰生物	2,892,264	151,843,860.00	1.98
21	300070	碧水源	17,976,366	140,035,891.14	1.83
22	300168	万达信息	9,296,606	120,576,979.82	1.58
23	300009	安科生物	6,668,253	106,025,222.70	1.39
24	300088	长信科技	20,042,608	101,415,596.48	1.32
25	300170	汉得信息	7,361,934	100,048,683.06	1.31
26	300072	三聚环保	12,544,211	99,475,593.23	1.30
27	300676	华大基因	1,739,526	99,222,563.04	1.30
28	300098	高新兴	12,376,880	98,767,502.40	1.29
29	300413	芒果超媒	2,298,930	94,371,076.50	1.23
30	300274	阳光电源	9,883,061	92,406,620.35	1.21
31	300315	掌趣科技	26,543,587	91,575,375.15	1.20
32	300027	华谊兄弟	17,812,141	87,457,612.31	1.14
33	300073	当升科技	3,655,484	83,966,467.48	1.10
34	300316	晶盛机电	6,369,275	80,826,099.75	1.06
35	300182	捷成股份	18,051,500	79,607,115.00	1.04

36	300418	昆仑万维	5,865,307	75,486,501.09	0.99
37	300113	顺网科技	4,597,868	72,094,570.24	0.94
38	300038	数知科技	7,687,407	71,954,129.52	0.94
39	300496	中科创达	2,456,990	71,449,269.20	0.93
40	300251	光线传媒	9,886,932	67,231,137.60	0.88
41	300115	长盈精密	5,826,938	61,124,579.62	0.80
42	300078	思创医惠	5,629,036	57,472,457.56	0.75
43	300433	蓝思科技	8,212,635	57,242,065.95	0.75
44	300618	寒锐钴业	933,983	56,038,980.00	0.73
45	300068	南都电源	4,916,400	55,555,320.00	0.73
46	300377	赢时胜	4,769,776	53,993,864.32	0.71
47	300308	中际旭创	1,405,020	47,756,629.80	0.62
48	300747	锐科激光	328,306	45,966,123.06	0.60
49	300666	江丰电子	964,054	36,556,927.68	0.48
50	300748	金力永磁	438,100	26,321,048.00	0.34

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

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	300750	宁德时代	372,020,447.70	4.06
2	300142	沃森生物	341,664,555.33	3.72
3	300747	锐科激光	117,266,051.88	1.28
4	300059	东方财富	105,203,777.76	1.15
5	300182	捷成股份	83,625,012.90	0.91
6	300760	迈瑞医疗	78,989,599.29	0.86
7	300124	汇川技术	74,488,407.38	0.81
8	300454	深信服	69,698,263.95	0.76
9	300033	同花顺	63,205,101.34	0.69
10	300068	南都电源	58,868,354.89	0.64
11	300017	网宿科技	54,113,508.85	0.59
12	300618	寒锐钴业	51,210,283.03	0.56
13	300308	中际旭创	47,680,535.53	0.52
14	300676	华大基因	41,212,636.66	0.45
15	300748	金力永磁	32,008,207.00	0.35
16	300015	爱尔眼科	29,991,538.17	0.33
17	300122	智飞生物	24,056,288.64	0.26

18	300170	汉得信息	23,184,462.79	0.25
19	300699	光威复材	23,171,829.26	0.25
20	300666	江丰电子	20,031,276.30	0.22

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	300059	东方财富	97,991,958.14	1.07
2	300699	光威复材	97,148,307.63	1.06
3	300454	深信服	76,223,139.02	0.83
4	300355	蒙草生态	62,858,870.53	0.69
5	300287	飞利信	62,304,696.21	0.68
6	300136	信维通信	53,080,229.75	0.58
7	300747	锐科激光	51,098,331.47	0.56
8	300124	汇川技术	48,361,078.92	0.53
9	300347	泰格医药	47,371,352.80	0.52
10	300408	三环集团	39,945,952.61	0.44
11	300033	同花顺	39,341,605.72	0.43
12	300024	机器人	38,324,296.18	0.42
13	300760	迈瑞医疗	38,319,166.04	0.42
14	300122	智飞生物	31,441,189.71	0.34
15	300146	汤臣倍健	29,809,184.59	0.32
16	300253	卫宁健康	28,776,360.54	0.31
17	300601	康泰生物	28,432,262.79	0.31
18	300014	亿纬锂能	25,427,113.97	0.28
19	300015	爱尔眼科	21,664,935.74	0.24
20	300676	华大基因	21,555,957.21	0.24

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,033,021,508.29
卖出股票的收入（成交）总额	1,342,946,569.61

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	333,916.08
2	应收证券清算款	1,687,257.91
3	应收股利	-
4	应收利息	6,842.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,028,016.40

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

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

			比例		比例
80,146	180,742.46	7,348,013,846.00	50.73%	7,137,771,267.00	49.27%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	1,596,080,868.00	11.04%
2	中国人寿保险股份有限公司	1,251,367,232.00	8.66%
3	华夏基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	331,800,000.00	2.30%
4	中国人寿保险（集团）公司	322,114,853.00	2.23%
5	建信基金—招商银行—建信乾元安享特定多个客户资产管理计划	221,257,800.00	1.53%
6	华夏人寿保险股份有限公司—万能保险产品	185,141,700.00	1.28%
7	光大兴陇信托有限责任公司—光大信托—瑞富宝集合资金信托计划	172,411,100.00	1.19%
8	建信基金公司—建行—中国建设银行股份有限公司	171,513,800.00	1.19%
9	上海人寿保险股份有限公司—传统产品 1	130,000,000.00	0.90%
10	中国人寿财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	118,963,800.00	0.82%
-	中国建设银行股份有限公司—华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	301,184,400.00	2.08%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研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（2016 年 6 月 30 日）基金份额总额	550,285,113.00
本报告期期初基金份额总额	20,995,285,113.00
本报告期基金总申购份额	41,666,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	48,176,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,485,785,113.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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	
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国泰君安	1	2,631,417,231.63	77.95%	2,398,013.81	77.95%	-
长江证券	2	560,783,230.33	16.61%	511,042.19	16.61%	-
申万宏源	3	156,198,395.80	4.63%	142,343.67	4.63%	-
光大证券	2	27,569,220.14	0.82%	25,123.82	0.82%	-

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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	15,841,375.45	54.59%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
光大证券	13,176,221.93	45.41%	-	-	-	-

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	关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-22
2	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-24
3	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申赎单位	《证券时报》和公司网站	2019-03-09
4	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
5	关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-11
6	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-15

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 www.huaan.com.cn 上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20190101-20190630	27,291,000.00	303,510,000.00	29,616,600.00	301,184,400.00	2.08%
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、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇一九年八月二十八日