

# 上证龙头企业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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	9
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
<b>5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
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	37
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	43
<b>10 重大事件揭示</b> .....	43
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	44
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....	45
10.9 其他重大事件 .....	45
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	46
<b>12 备查文件目录</b> .....	46
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 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
基金简称	华安上证龙头 ETF
基金主代码	510190
交易代码	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	27,650,796.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 1 月 10 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，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 负责人	姓名	陆滢	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	luying@huan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

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	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	陈四清

## 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	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	146,748.53
本期利润	15,533,989.12
加权平均基金份额本期利润	0.5461
本期加权平均净值利润率	16.95%
本期基金份额净值增长率	19.19%
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	18,856,783.38
期末可供分配基金份额利润	0.6820
期末基金资产净值	91,014,013.84
期末基金份额净值	3.292
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	26.13%

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

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

3、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	4.24%	1.16%	3.85%	1.18%	0.39%	-0.02%
过去三个月	-5.43%	1.55%	-6.26%	1.58%	0.83%	-0.03%
过去六个月	19.19%	1.56%	20.02%	1.59%	-0.83%	-0.03%
过去一年	2.11%	1.54%	1.91%	1.58%	0.20%	-0.04%
过去三年	10.73%	1.11%	8.64%	1.13%	2.09%	-0.02%
自基金合同生效起至今	26.13%	1.43%	18.49%	1.45%	7.64%	-0.02%

#### 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

上证龙头企业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  
 （2010年11月18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	2017-12-2	-	11 年	硕士研究生，11 年证券行业从业

	<p>经理、指数与 量化投资部助 理总监</p>	<p>5</p>		<p>经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，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 月起，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本基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任本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。</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，经济下行压力均有所加大，制造业景气度维持疲弱。受益于减税降费等政策利好，今年上半年非制造业景气度均维持在 54% 以上，非制造业经济扩张保持良好势头。2019 年二季度 GDP 同比增长 6.2%，较一季度回落 0.2%，上半年 GDP 累计同比增长 6.3%，在预期增长目标范围内。市场方面，一季度 A 股市场显著上涨，二季度市场有所调整。

本基金所跟踪的上证龙头企业指数由沪市 A 股各二级行业中规模大、市场占有率高的龙头公司股票组成，用以反映沪市 A 股各行业龙头公司股票的整体表现。截至 2019 年 6 月底，上证龙头指数动态市盈率 (P/E) 12.25 倍，市净率 (P/B) 1.5 倍，处于历史估值中枢下方。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.292 元，本报告期份额净值增长率为 19.19%，同期业绩比较基准增长率为 20.02%。

#### 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，在经济下行趋势压力下，货币政策与财政政策有望发力，在一定程度上缓解经济下行压力。中国经济经过几十年高速增长后，进入重质量的发展阶段，近年来第三产业在 GDP 中的贡献率持续高于第二产业，产业结构优化持续。各行业公司分化加大，产业集中度提升，优质企业通过扩大市占率抢占市场，盈利韧性较强。以上证龙头成分股为代表的 A 股核心龙头公司在市场竞争中将会处于有利地位。

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

本报告期内，本基金托管人在对上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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，上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公  
司在上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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。本报告期内，上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基

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的真实、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上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金 2019 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：上证龙头企业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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,975,611.25	2,030,912.42
结算备付金		4,004.84	-
存出保证金		1,015.42	3,882.54
交易性金融资产	6.4.7.2	89,252,137.41	78,837,806.44
其中：股票投资		89,252,137.41	78,795,806.44
基金投资		-	-
债券投资		-	42,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	480.28	239.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>91,233,249.20</b>	<b>80,872,840.69</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付管理人报酬		36,035.00	35,480.09
应付托管费		7,207.03	7,096.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,062.92	30,781.03
应交税费		-	0.14
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	150,930.41	278,000.00
<b>负债合计</b>		<b>219,235.36</b>	<b>351,357.28</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	72,157,230.46	76,071,614.89
未分配利润	6.4.7.10	18,856,783.38	4,449,868.52
<b>所有者权益合计</b>		<b>91,014,013.84</b>	<b>80,521,483.41</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>91,233,249.20</b>	<b>80,872,840.69</b>

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.292 元，基金份额总额 27,650,796.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证龙头企业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
<b>一、收入</b>		<b>16,051,566.70</b>	<b>-15,215,095.27</b>
1.利息收入		6,160.49	5,037.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,993.34	5,037.36
债券利息收入		167.15	-
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）		665,822.95	1,859,489.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-349,422.09	672,530.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	62,251.47	-
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	952,993.57	1,186,959.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,387,240.59	-17,081,728.37
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	-7,657.33	2,106.24
<b>减：二、费用</b>		<b>517,577.58</b>	<b>647,019.15</b>
1. 管理人报酬		226,319.67	273,821.68
2. 托管费		45,264.00	54,764.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	44,926.96	74,521.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.54	-
7. 其他费用	6.4.7.19	201,066.41	243,911.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>15,533,989.12</b>	<b>-15,862,114.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>15,533,989.12</b>	<b>-15,862,114.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证龙头企业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）	76,071,614.89	4,449,868.52	80,521,483.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,533,989.12	15,533,989.12
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）	-3,914,384.43	-1,127,074.26	-5,041,458.69
其中：1.基金申购款	19,571,922.21	5,497,004.83	25,068,927.04
2.基金赎回款	-23,486,306.64	-6,624,079.09	-30,110,385.73
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	72,157,230.46	18,856,783.38	91,014,013.84

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）	79,985,999.36	34,805,350.43	114,791,349.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,862,114.42	-15,862,114.42
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）	-5,219,179.28	-1,340,617.30	-6,559,796.58
其中：1.基金申购款	11,743,153.31	5,757,686.15	17,500,839.46
2.基金赎回款	-16,962,332.59	-7,098,303.45	-24,060,636.04
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）	74,766,820.08	17,602,618.71	92,369,438.79

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

上证龙头企业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[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《上证龙头企业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 1,130,323,223.00 元(含募集股票市值)，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 293 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,345,823.00 份基金份额，其中直销网下认购资金利息折合 22,600.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与上证龙头企业指数进行对比，根据《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，华安基金管理有限公司确定 2010 年 12 月 17 日为本基金的基金份额折算日。当日上证龙头企业指数收盘值为 2,626.685 点，本基金资产净值为 1,137,752,523.50 元，折算前基金份额总额为 1,130,345,823.00 份，折算前基金份额净值为 1.007 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.38320263，折算后基金份额总额为 433,150,796.00 份，折算后基金份额净值为 2.627 元。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2010 年 12 月 10 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]1 号文审核同意，本基金 433,150,796.00 份基金份额于 2011 年 1 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数上证龙头企业指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证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；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于部分非成份股、新股、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：上证龙头企业指数。

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 2010 年 11 月 18 日募集成立了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“上证龙头企业 ETF 联接基金”)。上证龙头企业 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的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	1,975,611.25
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,975,611.25

#### 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	88,767,079.26	89,252,137.41	485,058.15
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	88,767,079.26	89,252,137.41	485,058.15

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本报告期末无买入返售金融资产。

#### 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	478.21
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	1.62
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	0.45
合计	480.28

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末无其他资产。

#### 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	25,062.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,062.92

#### 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	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	41,424.85
指数使用费	50,000.00
预提上市年费	29,752.78
合计	150,930.41

#### 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	29,150,796.00	76,071,614.89
本期申购	7,500,000.00	19,571,922.21
本期赎回（以“-”号填列）	-9,000,000.00	-23,486,306.64
本期末	27,650,796.00	72,157,230.46

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,114,355.41	-39,664,486.89	4,449,868.52
本期利润	146,748.53	15,387,240.59	15,533,989.12
本期基金份额交易产生的变动数	-2,290,434.47	1,163,360.21	-1,127,074.26
其中：基金申购款	11,251,400.37	-5,754,395.54	5,497,004.83
基金赎回款	-13,541,834.84	6,917,755.75	-6,624,079.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,970,669.47	-23,113,886.09	18,856,783.38

#### 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	5,627.60
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	357.04
其他	8.70
合计	5,993.34

#### 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 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	-1,109,309.77
股票投资收益——赎回差价收入	759,887.68
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-349,422.09

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,821,567.94
减：卖出股票成本总额	17,930,877.71
买卖股票差价收入	-1,109,309.77

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	30,110,385.73
减：现金支付赎回款总额	451,205.73
减：赎回股票成本总额	28,899,292.32
赎回差价收入	759,887.68

#### 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	612,426.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	550,000.00
减：应收利息总额	174.73
买卖债券差价收入	62,251.47

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内无衍生工具收益。

#### 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	952,993.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	952,993.57

#### 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	15,387,240.59
——股票投资	15,387,240.59
——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	15,387,240.59

#### 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	-
替代损益	-7,657.33
合计	-7,657.33

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。

#### 6.4.7.18 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	44,926.96
银行间市场交易费用	-
合计	44,926.96

#### 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	41,424.85
银行汇划费用	136.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
合计	201,066.41

注：根据《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及《上证指数使用许可协议》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支。指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，收取下限为每季 5 万元。逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 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”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
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(“华安上证龙头 ETF 联接”)	本基金的联接基金
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

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	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
国泰君安	34,272,713.35	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	612,426.20	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 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	25,062.92	100.00%	25,062.92	100.00%
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	-	-	-	-

#### 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	226,319.67	273,821.68
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 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	45,264.00	54,764.29

注：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 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

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
华安上证龙头 ETF 联接	22,339,350.00	80.79%	23,921,250.00	82.06%

##### 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
中国工商银行股份有限公司	1,975,611.25	5,627.60	1,615,907.53	4,736.61

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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期末进行收益分配。

#### 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

本报告期末无受限证券。

##### 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	2018-02-08	重大资产重组	6.28	2019-07-12	13.86	86,438.00	1,825,855.29	542,830.64	-

注：本基金截至 2019 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停牌的股票，该类股票在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准于 2019 年 7 月 12 日复牌。

##### 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

本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

本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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,975,611.25	-	-	-	1,975,611.25
结算备付金	4,004.84	-	-	-	4,004.84
存出保证金	1,015.42	-	-	-	1,015.42
交易性金融资产	-	-	-	89,252,137.41	89,252,137.41
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	480.28	480.28
资产总计	1,980,631.51	-	-	89,252,617.69	91,233,249.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,035.00	36,035.00
应付托管费	-	-	-	7,207.03	7,207.03
应付交易费用	-	-	-	25,062.92	25,062.92
其他负债	-	-	-	150,930.41	150,930.41
负债总计	-	-	-	219,235.36	219,235.36
利率敏感度缺口	1,980,631.51	-	-	89,033,382.33	91,014,013.84
上年度末 2018 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	2,030,912.42	-	-	-	2,030,912.42
存出保证金	3,882.54	-	-	-	3,882.54
交易性金融资产	-	-	42,000.00	78,795,806.44	78,837,806.44
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	239.29	239.29
资产总计	2,034,794.96	-	42,000.00	78,796,045.73	80,872,840.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,480.09	35,480.09
应付托管费	-	-	-	7,096.02	7,096.02
应付交易费用	-	-	-	30,781.03	30,781.03
应交税费	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	278,000.00	278,000.00
负债总计	-	-	-	351,357.28	351,357.28
利率敏感度缺口	2,034,794.96	-	42,000.00	78,444,688.45	80,521,483.41

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，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。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。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，上证龙头企业指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。权证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		上年度末	
	2019 年 6 月 30 日		2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产	公允价值	占基金资产

		产净值比 例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	89,252,137.41	98.06	78,795,806.44	97.86
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	89,252,137.41	98.06	78,795,806.44	97.86

#### 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 445	增加约 396
	业绩比较基准下降 5%	减少约 445	减少约 396

#### 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	89,252,137.41	97.83
	其中: 股票	89,252,137.41	97.83
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	1,979,616.09	2.17
8	其他各项资产	1,495.70	0.00
9	合计	91,233,249.20	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	3,543,276.06	3.89
C	制造业	30,506,705.84	33.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,431,967.00	3.77
E	建筑业	3,577,265.50	3.93
F	批发和零售业	8,606,988.42	9.46
G	交通运输、仓储和邮政业	3,666,745.62	4.03
H	住宿和餐饮业	2,614,664.00	2.87
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,477,786.48	8.22
J	金融业	15,519,243.73	17.05
K	房地产业	3,590,248.12	3.94
L	租赁和商务服务业	2,493,225.00	2.74
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	1,266,837.00	1.39
R	文化、体育和娱乐业	2,414,354.00	2.65
S	综合	-	-
	合计	88,709,306.77	97.47

### 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	542,830.64	0.60
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	-	-
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	-	-
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	542,830.64	0.60

### 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	601688	华泰证券	72,100	1,609,272.00	1.77
2	603160	汇顶科技	10,200	1,415,760.00	1.56
3	600816	安信信托	280,172	1,414,868.60	1.55
4	600588	用友网络	51,730	1,390,502.40	1.53
5	600030	中信证券	57,852	1,377,456.12	1.51
6	600837	海通证券	95,400	1,353,726.00	1.49
7	601888	中国国旅	15,200	1,347,480.00	1.48
8	600570	恒生电子	19,600	1,335,740.00	1.47
9	600519	贵州茅台	1,355	1,333,320.00	1.46
10	600258	首旅酒店	73,200	1,316,136.00	1.45
11	600309	万华化学	30,600	1,309,374.00	1.44
12	600276	恒瑞医药	19,700	1,300,200.00	1.43
13	601318	中国平安	14,670	1,299,908.70	1.43
14	600739	辽宁成大	89,400	1,299,876.00	1.43
15	600754	锦江股份	52,700	1,298,528.00	1.43
16	601111	中国国航	135,387	1,295,653.59	1.42
17	600703	三安光电	113,680	1,282,310.40	1.41
18	601319	中国人保	134,700	1,278,303.00	1.40
19	600196	复星医药	50,100	1,267,530.00	1.39
20	600763	通策医疗	14,300	1,266,837.00	1.39
21	600655	豫园股份	154,500	1,265,355.00	1.39
22	600029	南方航空	163,500	1,262,220.00	1.39
23	603986	兆易创新	14,500	1,257,150.00	1.38
24	603708	家家悦	54,819	1,250,969.58	1.37
25	600887	伊利股份	37,356	1,248,063.96	1.37
26	600729	重庆百货	41,266	1,247,883.84	1.37
27	600340	华夏幸福	38,300	1,247,431.00	1.37
28	600332	白云山	30,400	1,245,488.00	1.37
29	600690	青岛海尔	71,742	1,240,419.18	1.36
30	601628	中国人寿	43,664	1,236,564.48	1.36
31	600705	中航资本	227,034	1,230,524.28	1.35
32	600487	亨通光电	73,420	1,230,519.20	1.35
33	600315	上海家化	39,500	1,230,425.00	1.35
34	601088	中国神华	60,294	1,228,791.72	1.35
35	600585	海螺水泥	29,600	1,228,400.00	1.35

36	600637	东方明珠	116,516	1,228,078.64	1.35
37	600977	中国电影	78,300	1,226,178.00	1.35
38	600036	招商银行	34,000	1,223,320.00	1.34
39	600390	五矿资本	128,800	1,214,584.00	1.33
40	601186	中国铁建	121,200	1,205,940.00	1.33
41	601360	三六零	56,400	1,205,832.00	1.32
42	600398	海澜之家	132,900	1,205,403.00	1.32
43	600271	航天信息	52,094	1,200,766.70	1.32
44	600104	上汽集团	46,926	1,196,613.00	1.31
45	601933	永辉超市	117,100	1,195,591.00	1.31
46	600755	厦门国贸	138,400	1,194,392.00	1.31
47	600019	宝钢股份	183,262	1,191,203.00	1.31
48	601668	中国建筑	206,826	1,189,249.50	1.31
49	600028	中国石化	217,366	1,188,992.02	1.31
50	600373	中文传媒	94,600	1,188,176.00	1.31
51	601985	中国核电	213,000	1,184,280.00	1.30
52	601390	中国中铁	181,300	1,182,076.00	1.30
53	601238	广汽集团	108,100	1,181,533.00	1.30
54	600741	华域汽车	54,700	1,181,520.00	1.30
55	601138	工业富联	98,000	1,180,900.00	1.30
56	600606	绿地控股	172,100	1,175,443.00	1.29
57	601398	工商银行	199,395	1,174,436.55	1.29
58	600048	保利地产	91,487	1,167,374.12	1.28
59	600522	中天科技	127,065	1,165,186.05	1.28
60	600804	鹏博士	154,866	1,164,592.32	1.28
61	600050	中国联通	187,182	1,153,041.12	1.27
62	600859	王府井	75,900	1,152,921.00	1.27
63	600438	通威股份	81,600	1,147,296.00	1.26
64	601828	美凯龙	94,300	1,145,745.00	1.26
65	600900	长江电力	64,000	1,145,600.00	1.26
66	603833	欧派家居	10,500	1,130,010.00	1.24
67	601857	中国石油	163,589	1,125,492.32	1.24
68	601006	大秦铁路	137,067	1,108,872.03	1.22
69	601288	农业银行	307,300	1,106,280.00	1.22
70	600011	华能国际	176,900	1,102,087.00	1.21
71	603019	中科曙光	31,000	1,088,100.00	1.20
72	600584	长电科技	81,651	1,049,215.35	1.15

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	600485	ST 信威	86,438	542,830.64	0.60
---	--------	-------	--------	------------	------

#### 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	600570	恒生电子	1,246,479.20	1.55
2	601319	中国人保	1,235,204.00	1.53
3	600837	海通证券	1,234,800.00	1.53
4	600655	豫园股份	1,227,722.00	1.52
5	600739	辽宁成大	1,222,027.11	1.52
6	603019	中科曙光	1,218,789.60	1.51
7	600258	首旅酒店	1,181,321.04	1.47
8	601390	中国中铁	1,179,227.00	1.46
9	600332	白云山	1,172,621.00	1.46
10	600703	三安光电	450,474.19	0.56
11	600816	安信信托	321,421.00	0.40
12	601186	中国铁建	284,652.00	0.35
13	601688	华泰证券	246,222.00	0.31
14	600196	复星医药	229,025.00	0.28
15	600487	亨通光电	228,586.00	0.28
16	600011	华能国际	211,622.00	0.26
17	600028	中国石化	210,956.00	0.26
18	600019	宝钢股份	202,850.00	0.25
19	600729	重庆百货	195,451.65	0.24
20	601857	中国石油	182,367.00	0.23

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	601601	中国太保	1,270,940.02	1.58
2	601231	环旭电子	1,248,849.00	1.55
3	600718	东软集团	1,194,903.00	1.48
4	600682	南京新百	1,100,280.64	1.37
5	601211	国泰君安	1,093,774.00	1.36
6	600787	中储股份	1,058,661.33	1.31

7	600138	中青旅	999,277.92	1.24
8	601766	中国中车	950,728.00	1.18
9	600519	贵州茅台	621,638.00	0.77
10	600438	通威股份	585,396.00	0.73
11	600763	通策医疗	527,905.00	0.66
12	603160	汇顶科技	454,216.00	0.56
13	603833	欧派家居	416,939.39	0.52
14	600584	长电科技	354,554.00	0.44
15	600887	伊利股份	336,812.00	0.42
16	600518	ST 康美	316,159.90	0.39
17	603708	家家悦	310,616.60	0.39
18	601888	中国国旅	253,410.00	0.31
19	601933	永辉超市	243,820.00	0.30
20	600588	用友网络	242,163.00	0.30

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,451,145.41
卖出股票的收入（成交）总额	16,821,567.94

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。

#### 7.5 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 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	1,015.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	480.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,495.70

### 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

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	600485	ST 信威	542,830.64	0.60	重大资产重组

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
783	35,313.92	22,937,232.00	82.95%	4,713,564.00	17.05%

### 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	招商证券股份有限公司	587,882.00	2.13%
2	崔爱红	290,989.00	1.05%
3	郭思含	130,000.00	0.47%
4	李丽	120,000.00	0.43%

5	刘丽辉	118,000.00	0.43%
6	易继武	100,000.00	0.36%
7	钟文毫	99,000.00	0.36%
8	傅可卉	91,216.00	0.33%
9	刘长盛	80,000.00	0.29%
10	卜立桃	76,641.00	0.28%
-	中国工商银行股份有限公司—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	22,339,350.00	80.79%

### 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（2010 年 11 月 18 日）基金份额总额	1,130,345,823.00
本报告期期初基金份额总额	29,150,796.00
本报告期基金总申购份额	7,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,650,796.00

## 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：

无。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

## 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	34,272,713.35	100.00%	25,062.92	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：

无。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	612,426.20	100.00%	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安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
2	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
3	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	2019-03-29

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	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
5	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 [www.huaan.com.cn](http://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	23,921,250.00	400,000.00	1,981,900.00	22,339,350.00	80.79%
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。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金合同》
- 2、《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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

### 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