

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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合规守信情况的说明	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	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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	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	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44

8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	46
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
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	48
10.8 其他重大事件	48
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证 180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006 年 4 月 13 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	5,579,057,679.00 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	2006 年 5 月 18 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	采取抽样复制的指数跟踪方法，即根据定量化的选股指标，选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合，并通过优化模型确定投资组合中个股的权重，以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	上证 180 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险中等、收益中等的产品。

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	薛珍	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	168,947,358.10
本期利润	-385,301,725.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0686
本期加权平均净值利润率	-2.05%
本期基金份额净值增长率	-1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	13,416,224,586.50
期末可供分配基金份额利润	2.4047
期末基金资产净值	19,404,216,423.36
期末基金份额净值	3.4780
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	291.37%

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	5.92%	0.84%	5.26%	0.84%	0.66%	0.00%
过去三个月	10.11%	0.84%	9.20%	0.83%	0.91%	0.01%
过去六个月	-1.97%	1.42%	-2.67%	1.42%	0.70%	0.00%
过去一年	2.43%	1.14%	0.71%	1.14%	1.72%	0.00%
过去三年	15.03%	1.19%	9.37%	1.20%	5.66%	-0.01%
自基金合同生效起至今	291.37%	1.71%	238.60%	1.74%	52.77%	-0.03%

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 180 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

（2006 年 4 月 13 日至 2020 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、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 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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	2009-09-05	-	16 年	理学博士，16 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 月起同时担任上证 180 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。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 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式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中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

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

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，突如其来的疫情给全球宏观经济带来较大的打击，疫情前全球经济本来增长相对疲弱。国内疫情在 2 月底得到较好控制后，全球疫情加速蔓延，特别是美国、巴西、印度等国家。全球来看，目前还没有看到疫情得到明显控制，期待疫苗尽快上市以降低和控制疫情的影响。

全球央行在 3 月初开启了新一轮的降息和量化宽松，以更好救助中小企业，进一步刺激受到疫情影响的“停摆”的经济活动。国内也采取了比较积极的财政措施，降低疫情对中小企业的影响和对就业的冲击。全球宏观经济大概率上 2020 年出现 3-5% 的负增长，出现一定的技术性衰退。

国内疫情后，特别是两会后政策继续加力，加大六稳六保的推动力度。通过财政等措施保障就业和中小企业的生存。从宏观数据来看，包括零售数据、工业企业数据、发电量、PMI 等都出现较快的修复和上行。全年来看，国内很可能获得 2-3% 的正增长。

上半年，第一季度上证 180 指数下跌约 10%，二季度有所修复，但上半年依然略微有所下跌 2.67%。在此期间，本基金采用了全复制策略，顺利平稳完成了相关投资运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.4780 元，本报告期份额净值增长率为-1.97%，同期业绩比较基准增长率为-2.67%。本基金日跟踪误差为万分之 0.32。

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，疫情的反复依然是下半年制约宏观经济增长最大的因素。我们预期，美联储、欧洲央行等还将进一步扩大量化宽松的货币和财政政策。国内宏观经济下半年将继续修复，三、四季度很可能逐步回到潜在经济增长率水平。我们继续保持大类资产配置的观点不变，在当前的宏观状态、利率环境、通胀预期和流动性背景下，应该继续加大权益类资产以及黄金的配置。国内 A 股，特别是以上证 180 指数为代表的核心蓝筹指数，其估值仍处于全球几乎最低水平，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。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	81,496,959.01	31,699,345.08
结算备付金		1,194,555.14	7,612.26
存出保证金		53,784.73	267,526.43
交易性金融资产	6.4.7.2	19,362,697,118.15	19,927,316,393.26
其中：股票投资		19,362,697,118.15	19,926,573,393.26
基金投资		-	-
债券投资		-	743,000.00
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		465,595.22	9,962,459.56
应收利息	6.4.7.5	15,234.27	6,443.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		19,445,923,246.52	19,969,259,779.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		29,661,725.45	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,790,735.90	8,211,392.65
应付托管费		1,558,147.20	1,642,278.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,513,571.88	2,915,666.57
应交税费		-	3.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	182,642.73	285,127.35
负债合计		41,706,823.16	13,054,468.49
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	5,987,991,836.86	6,036,826,899.07
未分配利润	6.4.7.10	13,416,224,586.50	13,919,378,412.43
所有者权益合计		19,404,216,423.36	19,956,205,311.50
负债和所有者权益总计		19,445,923,246.52	19,969,259,779.99

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.4780 元，基金份额总额 5,579,057,679.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-324,935,459.21	4,302,599,024.41
1.利息收入		159,993.12	183,638.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	159,179.81	174,148.40
债券利息收入		813.31	9,490.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		229,147,818.35	212,034,587.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,696,164.85	-15,828,564.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,064,251.92	6,409,463.93
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	205,387,401.58	221,453,687.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-554,249,083.61	4,090,177,916.56
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	5,812.93	202,881.94
减：二、费用		60,366,266.30	58,172,841.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	46,837,332.93	45,885,364.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,367,466.65	9,177,072.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,016,178.29	2,926,716.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		1.49	17.27
7. 其他费用	6.4.7.19	145,286.94	183,670.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-385,301,725.51	4,244,426,183.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-385,301,725.51	4,244,426,183.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,036,826,899.07	13,919,378,412.43	19,956,205,311.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-385,301,725.51	-385,301,725.51
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）	-48,835,062.21	-117,852,100.42	-166,687,162.63
其中：1.基金申购款	288,717,180.56	597,536,761.30	886,253,941.86
2.基金赎回款	-337,552,242.77	-715,388,861.72	-1,052,941,104.49
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）	5,987,991,836.86	13,416,224,586.50	19,404,216,423.36
项目	上年度可比期间 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）	6,169,379,210.72	9,755,387,264.94	15,924,766,475.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,244,426,183.12	4,244,426,183.12
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）	-116,452,840.58	-230,304,678.34	-346,757,518.92
其中：1.基金申购款	631,099,264.83	1,300,993,065.55	1,932,092,330.38
2.基金赎回款	-747,552,105.41	-1,531,297,743.89	-2,278,849,849.30
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）	6,052,926,370.14	13,769,508,769.72	19,822,435,139.86

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 180 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”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数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《上证 180 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 1,072,807,826.00 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(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,279.00 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。

为了与上证 180 指数进行对比,根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 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 2006 年 5 月 10 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2,919.214 点,本基金资产净值为 1,167,168,017.51 元,折算前基金份额总额为 1,072,822,105.00 份,折算前基金份额净值为 1.088 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.37268313,折算后基金份额总额为 399,822,674.00 份,折算后基金份额净值为 2.919 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 2006 年 5 月 11 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[2006]第 39 号文审核同意,本基金 399,822,674.00 份基金份额于 2006 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于华安上证 180ETF 实施份额拆分和修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于 2009 年 5 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 10:1,并于 2009 年 5 月 19 日进行了变更登记。

根据《关于上证 180ETF 基金份额合并结果及恢复交易和申购、赎回的公告》的有关规定,中国证券登记结算有限责任公司按合并比例 0.25 对 2013 年 12 月 19 日(权益登记日)登记在册的本基金的基金份额实施合并,减少基金份额持有人持有的基金份额数,并于 2013 年 12 月 20 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 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 180 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 95%;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:上证 180 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 2009 年 9 月 29 日募集成立了华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 180ETF 联接基金”)。上证 180ETF 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 2020 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年度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[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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	81,496,959.01
定期存款	-
其他存款	-
合计	81,496,959.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		16,686,818,564.71	19,362,697,118.15	2,675,878,553.44
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		16,686,818,564.71	19,362,697,118.15	2,675,878,553.44

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,728.74
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	483.75
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	21.78
合计	15,234.27

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,513,571.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,513,571.88

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	84,535.36
应付替代款	38,435.03
合计	182,642.73

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。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,624,557,679.00	6,036,826,899.07
本期申购	269,000,000.00	288,717,180.56
本期赎回（以“-”号填列）	-314,500,000.00	-337,552,242.77
本期末	5,579,057,679.00	5,987,991,836.86

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	19,702,879,731.88	-5,783,501,319.45	13,919,378,412.43
本期利润	168,947,358.10	-554,249,083.61	-385,301,725.51
本期基金份额交易产生的变动数	-160,131,928.45	42,279,828.03	-117,852,100.42
其中：基金申购款	944,563,800.33	-347,027,039.03	597,536,761.30
基金赎回款	-1,104,695,728.78	389,306,867.06	-715,388,861.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,711,695,161.53	-6,295,470,575.03	13,416,224,586.50

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	143,168.08
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	14,615.64
其他	1,396.09
合计	159,179.81

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-108,788,031.18
股票投资收益——赎回差价收入	131,484,196.03
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	22,696,164.85

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,263,131,944.38
减：卖出股票成本总额	1,371,919,975.56
买卖股票差价收入	-108,788,031.18

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,052,941,104.49
减：现金支付赎回款总额	-43,024,652.51
减：赎回股票成本总额	964,481,560.97
赎回差价收入	131,484,196.03

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未持有债券投资。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,840,181.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,775,000.00
减：应收利息总额	929.88
买卖债券差价收入	1,064,251.92

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	205,387,401.58
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	205,387,401.58

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-554,249,083.61
——股票投资	-554,249,083.61
——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	-554,249,083.61

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	5,812.93
合计	5,812.93

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,016,178.29
银行间市场交易费用	-
合计	4,016,178.29

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	84,535.36
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,079.24
合计	145,286.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	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
华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 （“上证 180ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,710,850,955.97	100.00%	1,985,831,787.03	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	13,872,181.80	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	2,513,571.88	100.00%	2,513,571.88	100.00%

限公司				
关联方名称	上年度可比期间 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	1,849,395.42	100.00%	1,849,395.42	100.00%

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,837,332.93	45,885,364.18
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管理有限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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,367,466.65	9,177,072.83

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 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	67,379,400.00	1.21%	80,823,600.00	1.44%

注：于本报告期末，上证 180ETF 联接基金持有本基金份额为一级市场申购和二级市场买入的份额。

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	81,496,959.01	143,168.08	62,265,248.80	151,486.71

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，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 2020 年 6 月 30 日止，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

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。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，追求尽可能贴近目标指数的表现。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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 2020 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	81,496,959.01	-	-	-	81,496,959.01
结算备付金	1,194,555.14	-	-	-	1,194,555.14
存出保证金	53,784.73	-	-	-	53,784.73
交易性金融资产	-	-	-	19,362,697,118.15	19,362,697,118.15
应收证券清算款	-	-	-	465,595.22	465,595.22
应收利息	-	-	-	15,234.27	15,234.27
资产总计	82,745,298.88	-	-	19,363,177,947.64	19,445,923,246.52
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	29,661,725.45	29,661,725.45
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	7,790,735.90	7,790,735.90
应付托管费	-	-	-	1,558,147.20	1,558,147.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,513,571.88	2,513,571.88
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	182,642.73	182,642.73
负债总计	-	-	-	41,706,823.16	41,706,823.16
利率敏感度缺口	82,745,298.88	-	-	19,321,471,124.48	19,404,216,423.36
上年度末 2019 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	31,699,345.08	-	-	-	31,699,345.08
结算备付金	7,612.26	-	-	-	7,612.26
存出保证金	267,526.43	-	-	-	267,526.43
交易性金融资产	-	-	743,000.00	19,926,573,393.26	19,927,316,393.26
应收证券清算款	-	-	-	9,962,459.56	9,962,459.56
应收利息	-	-	-	6,443.40	6,443.40
资产总计	31,974,483.77	-	743,000.00	19,936,542,296.22	19,969,259,779.99
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,211,392.65	8,211,392.65
应付托管费	-	-	-	1,642,278.52	1,642,278.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,915,666.57	2,915,666.57
应交税费	-	-	-	3.40	3.40
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	285,127.35	285,127.35
负债总计	-	-	-	13,054,468.49	13,054,468.49
利率敏感度缺口	31,974,483.77	-	743,000.00	19,923,487,827.73	19,956,205,311.50

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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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 0.004%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无

重大影响(2019 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。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 180 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 95%，新股、债券及及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	19,362,697,118.15	99.79	19,926,573,393.26	99.85
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	19,362,697,118 .15	99.79	19,926,573,39 3.26	99.85

注：其他为可退替代款估值增值。

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 97,020	增加约 99,392
	业绩比较基准下降 5%	减少约 97,020	减少约 99,392

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	19,362,697,118.15	99.57
	其中：股票	19,362,697,118.15	99.57
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	82,691,514.15	0.43
8	其他各项资产	534,614.22	0.00
9	合计	19,445,923,246.52	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	24,003,490.00	0.12
B	采矿业	680,690,380.80	3.51
C	制造业	7,406,314,647.24	38.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	545,930,336.31	2.81
E	建筑业	557,532,945.00	2.87
F	批发和零售业	119,657,203.74	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	514,503,777.57	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	653,157,425.18	3.37
J	金融业	7,697,600,474.23	39.67
K	房地产业	551,123,792.63	2.84
L	租赁和商务服务业	314,816,988.04	1.62
M	科学研究和技术服务业	209,663,827.80	1.08
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	67,141,602.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	20,560,227.61	0.11

S	综合	-	-
	合计	19,362,697,118.15	99.79

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	22,691,499	1,620,173,028.60	8.35
2	600519	贵州茅台	1,051,942	1,538,864,912.96	7.93
3	600036	招商银行	21,604,557	728,505,662.04	3.75
4	600276	恒瑞医药	7,782,234	718,300,198.20	3.70
5	600030	中信证券	17,843,119	430,197,599.09	2.22
6	601166	兴业银行	26,105,532	411,945,294.96	2.12
7	600887	伊利股份	12,705,704	395,528,565.52	2.04
8	601398	工商银行	73,462,106	365,841,287.88	1.89
9	600900	长江电力	18,432,111	349,104,182.34	1.80
10	601888	中国中免	2,043,868	314,816,988.04	1.62
11	601328	交通银行	57,548,749	295,225,082.37	1.52
12	600585	海螺水泥	5,026,524	265,953,384.84	1.37
13	600000	浦发银行	24,594,262	260,207,291.96	1.34
14	603288	海天味业	2,036,068	253,286,859.20	1.31
15	600016	民生银行	44,555,837	252,631,595.79	1.30
16	600031	三一重工	12,370,976	232,079,509.76	1.20
17	601688	华泰证券	12,334,801	231,894,258.80	1.20
18	601012	隆基股份	5,530,804	225,269,646.92	1.16
19	600048	保利地产	14,998,562	221,678,746.36	1.14
20	600837	海通证券	16,948,372	213,210,519.76	1.10
21	603259	药明康德	2,170,433	209,663,827.80	1.08
22	601668	中国建筑	43,938,490	209,586,597.30	1.08
23	601288	农业银行	60,144,215	203,287,446.70	1.05
24	600570	恒生电子	1,747,584	188,214,796.80	0.97
25	601601	中国太保	6,585,983	179,468,036.75	0.92
26	601229	上海银行	20,839,320	172,966,356.00	0.89
27	600309	万华化学	3,287,800	164,357,122.00	0.85
28	601211	国泰君安	9,446,480	163,046,244.80	0.84
29	603986	兆易创新	688,097	162,328,963.27	0.84
30	601988	中国银行	44,134,738	153,588,888.24	0.79

31	601169	北京银行	30,996,207	151,881,414.30	0.78
32	600588	用友网络	3,401,177	149,991,905.70	0.77
33	600009	上海机场	2,017,175	145,377,802.25	0.75
34	601766	中国中车	25,479,412	141,920,324.84	0.73
35	600690	海尔智家	7,928,836	140,340,397.20	0.72
36	600999	招商证券	5,989,304	131,465,222.80	0.68
37	600703	三安光电	5,124,303	128,107,575.00	0.66
38	601899	紫金矿业	28,795,860	126,701,784.00	0.65
39	600104	上汽集团	7,339,254	124,693,925.46	0.64
40	601818	光大银行	33,354,676	119,409,740.08	0.62
41	600745	闻泰科技	943,200	118,796,040.00	0.61
42	600919	江苏银行	19,345,926	109,691,400.42	0.57
43	600028	中国石化	28,017,771	109,549,484.61	0.56
44	600436	片仔癀	629,775	107,219,193.75	0.55
45	600547	山东黄金	2,724,784	99,781,590.08	0.51
46	601088	中国神华	6,910,664	99,237,135.04	0.51
47	600406	国电南瑞	4,842,561	98,061,860.25	0.51
48	601628	中国人寿	3,490,497	94,976,423.37	0.49
49	600050	中国联通	19,497,337	94,367,111.08	0.49
50	600438	通威股份	5,388,850	93,658,213.00	0.48
51	601009	南京银行	12,577,639	92,194,093.87	0.48
52	601939	建设银行	14,060,585	88,722,291.35	0.46
53	601006	大秦铁路	12,454,894	87,682,453.76	0.45
54	601390	中国中铁	17,054,140	85,611,782.80	0.44
55	600196	复星医药	2,527,811	85,566,402.35	0.44
56	601857	中国石油	20,348,698	85,261,044.62	0.44
57	600019	宝钢股份	18,661,778	85,097,707.68	0.44
58	603160	汇顶科技	379,100	84,501,390.00	0.44
59	603019	中科曙光	2,181,666	83,775,974.40	0.43
60	601186	中国铁建	9,633,081	80,725,218.78	0.42
61	600809	山西汾酒	545,000	79,025,000.00	0.41
62	600015	华夏银行	12,891,168	78,893,948.16	0.41
63	601336	新华保险	1,745,288	77,281,352.64	0.40
64	601989	中国重工	19,098,921	76,395,684.00	0.39
65	601933	永辉超市	8,019,986	75,227,468.68	0.39
66	603501	韦尔股份	360,200	72,742,390.00	0.37
67	600958	东方证券	7,498,637	71,162,065.13	0.37
68	600183	生益科技	2,384,930	69,806,901.10	0.36
69	600352	浙江龙盛	5,452,100	69,732,359.00	0.36
70	600741	华域汽车	3,302,082	68,650,284.78	0.35
71	600872	中炬高新	1,168,347	68,383,349.91	0.35
72	601377	兴业证券	9,819,444	67,263,191.40	0.35
73	600763	通策医疗	402,600	67,141,602.00	0.35
74	600201	生物股份	2,359,300	65,682,912.00	0.34

75	601788	光大证券	4,089,297	65,674,109.82	0.34
76	600383	金地集团	4,729,857	64,799,040.90	0.33
77	601138	工业富联	4,163,800	63,081,570.00	0.33
78	600346	恒力石化	4,424,064	61,936,896.00	0.32
79	600660	福耀玻璃	2,934,683	61,246,834.21	0.32
80	601901	方正证券	8,611,937	60,972,513.96	0.31
81	601225	陕西煤业	8,374,135	60,377,513.35	0.31
82	601877	正泰电器	2,251,087	59,316,142.45	0.31
83	601155	新城控股	1,889,790	59,037,039.60	0.30
84	600522	中天科技	5,136,119	58,808,562.55	0.30
85	600109	国金证券	5,066,792	57,812,096.72	0.30
86	600340	华夏幸福	2,525,690	57,737,273.40	0.30
87	603799	华友钴业	1,435,452	55,781,664.72	0.29
88	600600	青岛啤酒	727,423	55,647,859.50	0.29
89	601669	中国电建	16,022,761	55,438,753.06	0.29
90	603993	洛阳钼业	14,800,620	54,318,275.40	0.28
91	601800	中国交建	7,383,744	54,196,680.96	0.28
92	601108	财通证券	5,261,800	53,933,450.00	0.28
93	601985	中国核电	13,034,434	53,310,835.06	0.27
94	601555	东吴证券	6,500,257	53,042,097.12	0.27
95	600089	特变电工	7,779,246	52,665,495.42	0.27
96	603369	今世缘	1,314,972	52,322,735.88	0.27
97	600867	通化东宝	2,980,285	51,946,367.55	0.27
98	600521	华海药业	1,526,838	51,805,613.34	0.27
99	600010	包钢股份	47,743,589	51,563,076.12	0.27
100	600298	安琪酵母	1,035,220	51,222,685.60	0.26
101	601990	南京证券	3,455,203	49,305,746.81	0.25
102	600536	中国软件	621,600	49,230,720.00	0.25
103	600606	绿地控股	7,635,090	47,184,856.20	0.24
104	600487	亨通光电	2,861,792	46,962,006.72	0.24
105	600029	南方航空	9,007,921	46,570,951.57	0.24
106	600795	国电电力	24,695,744	45,687,126.40	0.24
107	601099	太平洋	14,277,207	45,258,746.19	0.23
108	603517	绝味食品	637,600	45,103,824.00	0.23
109	600061	国投资本	3,542,741	45,099,092.93	0.23
110	600705	中航资本	11,281,936	44,676,466.56	0.23
111	600886	国投电力	5,682,189	44,662,005.54	0.23
112	601100	恒立液压	554,200	44,446,840.00	0.23
113	601607	上海医药	2,417,287	44,429,735.06	0.23
114	600926	杭州银行	4,968,520	44,319,198.40	0.23
115	600893	航发动力	1,884,071	44,237,987.08	0.23
116	600111	北方稀土	4,565,357	42,549,127.24	0.22
117	601162	天风证券	6,992,150	42,372,429.00	0.22
118	601066	中信建投	1,069,524	42,117,855.12	0.22

119	600637	东方明珠	4,291,039	41,408,526.35	0.21
120	601111	中国国航	6,256,972	41,358,584.92	0.21
121	600176	中国巨石	4,402,000	40,278,300.00	0.21
122	600115	东方航空	9,386,236	39,609,915.92	0.20
123	600011	华能国际	9,213,681	38,881,733.82	0.20
124	601816	京沪高铁	6,181,345	38,509,779.35	0.20
125	603589	口子窖	752,123	38,283,060.70	0.20
126	600118	中国卫星	1,238,863	38,194,146.29	0.20
127	600332	白云山	1,178,008	38,084,998.64	0.20
128	600271	航天信息	2,341,865	38,031,887.60	0.20
129	601618	中国中冶	14,954,035	37,534,627.85	0.19
130	600699	均胜电子	1,555,238	37,030,216.78	0.19
131	600489	中金黄金	3,889,355	35,548,704.70	0.18
132	600177	雅戈尔	5,817,300	34,671,108.00	0.18
133	600068	葛洲坝	5,788,115	34,439,284.25	0.18
134	600066	宇通客车	2,781,310	33,931,982.00	0.17
135	600801	华新水泥	1,429,559	33,894,843.89	0.17
136	601998	中信银行	6,418,206	33,053,760.90	0.17
137	600895	张江高科	1,622,200	33,044,214.00	0.17
138	600004	白云机场	2,167,200	33,028,128.00	0.17
139	601198	东兴证券	2,886,878	31,466,970.20	0.16
140	600085	同仁堂	1,149,682	31,179,375.84	0.16
141	601881	中国银河	2,700,700	30,977,029.00	0.16
142	600150	中国船舶	1,766,997	30,816,427.68	0.16
143	600155	华创阳安	2,553,509	30,616,572.91	0.16
144	600018	上港集团	7,275,594	30,557,494.80	0.16
145	603833	欧派家居	261,213	30,274,586.70	0.16
146	600516	方大炭素	4,784,292	30,045,353.76	0.15
147	601233	桐昆股份	2,323,400	29,646,584.00	0.15
148	600362	江西铜业	2,173,393	29,253,869.78	0.15
149	600760	中航沈飞	879,351	28,860,299.82	0.15
150	601319	中国人保	4,465,700	28,759,108.00	0.15
151	601878	浙商证券	2,792,447	27,673,149.77	0.14
152	601021	春秋航空	768,300	27,074,892.00	0.14
153	600848	上海临港	1,253,823	26,919,579.81	0.14
154	600208	新潮中宝	9,008,132	26,844,233.36	0.14
155	600909	华安证券	3,792,500	25,902,775.00	0.13
156	601658	邮储银行	5,631,400	25,735,498.00	0.13
157	600779	水井坊	408,366	25,490,205.72	0.13
158	600038	中直股份	614,924	25,254,928.68	0.13
159	601872	招商轮船	4,242,500	24,733,775.00	0.13
160	600598	北大荒	1,490,900	24,003,490.00	0.12
161	600733	北汽蓝谷	3,660,300	23,535,729.00	0.12
162	600572	康恩贝	3,908,800	21,498,400.00	0.11

163	600875	东方电气	2,328,200	20,604,570.00	0.11
164	600977	中国电影	1,565,897	20,560,227.61	0.11
165	601633	长城汽车	2,546,322	19,657,605.84	0.10
166	601916	浙商银行	4,558,100	17,958,914.00	0.09
167	601238	广汽集团	1,942,321	17,480,889.00	0.09
168	600737	中粮糖业	2,244,200	17,459,876.00	0.09
169	600621	华鑫股份	891,100	17,198,230.00	0.09
170	601519	大智慧	2,085,600	16,809,936.00	0.09
171	601860	紫金银行	3,840,400	16,244,892.00	0.08
172	601236	红塔证券	835,800	16,214,520.00	0.08
173	601698	中国卫通	836,900	15,072,569.00	0.08
174	600928	西安银行	2,793,856	14,695,682.56	0.08
175	600025	华能水电	3,768,985	14,284,453.15	0.07
176	600989	宝丰能源	1,688,000	14,212,960.00	0.07
177	600604	市北高新	1,474,900	13,878,809.00	0.07
178	601077	渝农商行	2,413,100	11,389,832.00	0.06
179	600968	海油发展	4,255,300	9,914,849.00	0.05
180	603983	丸美股份	92,200	7,931,966.00	0.04

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	601398	工商银行	144,122,934.00	0.72
2	600745	闻泰科技	105,005,086.62	0.53
3	603501	韦尔股份	69,290,917.40	0.35
4	600763	通策医疗	59,317,679.95	0.30
5	601688	华泰证券	52,205,454.18	0.26
6	600536	中国软件	49,026,090.76	0.25
7	600521	华海药业	48,191,511.86	0.24
8	601229	上海银行	46,498,972.59	0.23
9	600585	海螺水泥	42,185,527.43	0.21
10	601100	恒立液压	42,102,275.11	0.21
11	603517	绝味食品	41,548,024.38	0.21
12	601816	京沪高铁	40,627,009.45	0.20
13	600801	华新水泥	35,015,829.74	0.18
14	600030	中信证券	34,827,283.00	0.17
15	601162	天风证券	34,513,755.41	0.17
16	601021	春秋航空	29,705,168.60	0.15
17	601658	邮储银行	26,973,901.00	0.14

18	601766	中国中车	26,969,028.00	0.14
19	603986	兆易创新	26,620,397.16	0.13
20	601872	招商轮船	25,340,864.57	0.13

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	601166	兴业银行	88,614,727.01	0.44
2	601288	农业银行	78,620,123.00	0.39
3	601318	中国平安	67,873,546.40	0.34
4	600519	贵州茅台	58,362,607.12	0.29
5	600016	民生银行	54,249,610.00	0.27
6	600426	华鲁恒升	46,301,920.95	0.23
7	601997	贵阳银行	42,880,257.36	0.21
8	601600	中国铝业	39,769,993.80	0.20
9	601727	上海电气	38,375,908.43	0.19
10	601838	成都银行	30,701,930.26	0.15
11	600036	招商银行	30,046,474.36	0.15
12	600535	天士力	28,776,662.32	0.14
13	600276	恒瑞医药	26,170,685.64	0.13
14	600297	广汇汽车	24,577,756.40	0.12
15	600528	中铁工业	22,238,573.51	0.11
16	600635	大众公用	18,201,711.82	0.09
17	600398	海澜之家	17,888,577.26	0.09
18	601577	长沙银行	17,319,344.00	0.09
19	600643	爱建集团	16,628,174.65	0.08
20	600188	兖州煤业	16,612,254.35	0.08

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	1,447,719,011.59
卖出股票的收入（成交）总额	1,263,131,944.38

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。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

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

7.12.12020 年 4 月 20 日，工商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监

罚决字〔2020〕7 号）给予罚款合计 270 万元的行政处罚。

报告期内，本基金投资的前十名其他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	53,784.73
2	应收证券清算款	465,595.22
3	应收股利	-
4	应收利息	15,234.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,614.22

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中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

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
17,519	318,457.54	5,350,746,028.00	95.91%	228,311,651.00	4.09%

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	中央汇金投资有限责任公司	5,231,571,046.00	93.77%
2	三菱日联国际资产管理公司—MAXIS 华安中国股票（上证 180 指数）ETF	15,102,800.00	0.27%
3	孙晓燕	7,940,000.00	0.14%
4	招商证券股份有限公司	4,670,217.00	0.08%
5	中信证券股份有限公司	4,532,697.00	0.08%
6	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公司	4,500,000.00	0.08%
7	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	4,397,450.00	0.08%
8	华泰证券股份有限公司	3,204,550.00	0.06%
9	中国银河证券股份有限公司	2,826,940.00	0.05%
10	吴振桦	2,606,800.00	0.05%
11	中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	67,379,400.00	1.21%

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（2006 年 4 月 13 日）基金份额总额	1,072,822,105.00
本报告期期初基金份额总额	5,624,557,679.00
本报告期基金总申购份额	269,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	314,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,579,057,679.00

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	4	2,710,850,955.97	100.00%	2,513,571.88	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。

10.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	13,872,181.80	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
3	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（更新）	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
4	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（更新）	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
5	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
6	华安基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-12
7	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
8	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25

9	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增一级交易商的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-22
11	华安基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-20
12	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
13	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》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
机构	1	20200101-20200630	5,231,571.04	0.00	0.00	5,231,571.04	93.77%
联接基金	1	20200101-20200630	80,823,600.00	0.00	13,444,200.00	67,379,400.00	1.21%
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、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》；

- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《上证 180 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 180 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》；
- 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

二〇二〇年八月二十八日