

华安中证全指证券公司指数型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十日

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 2021 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 2021 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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	45
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.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50

8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3	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.....	52
9	开放式基金份额变动	52
10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4	基金投资策略的改变.....	53
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	53
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
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.....	55
10.9	其他重大事件.....	56
11	备查文件目录	57
11.1	备查文件目录.....	57
11.2	存放地点.....	57
11.3	查阅方式.....	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金
基金简称	华安中证证券公司
基金主代码	160419
交易代码	160419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 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	540,501,380.10 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证全指证券公司指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	杨牧云	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 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	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（2021年1月1日（基金合同生效日）至 2021年6月30日）
本期已实现收益	14,972,345.59
本期利润	-34,575,445.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0672
本期加权平均净值利润率	-6.12%
本期基金份额净值增长率	-7.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-319,118,964.18
期末可供分配基金份额利润	-0.5904
期末基金资产净值	606,937,495.53
期末基金份额净值	1.1229
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-7.35%

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：封闭式基金交易佣金、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

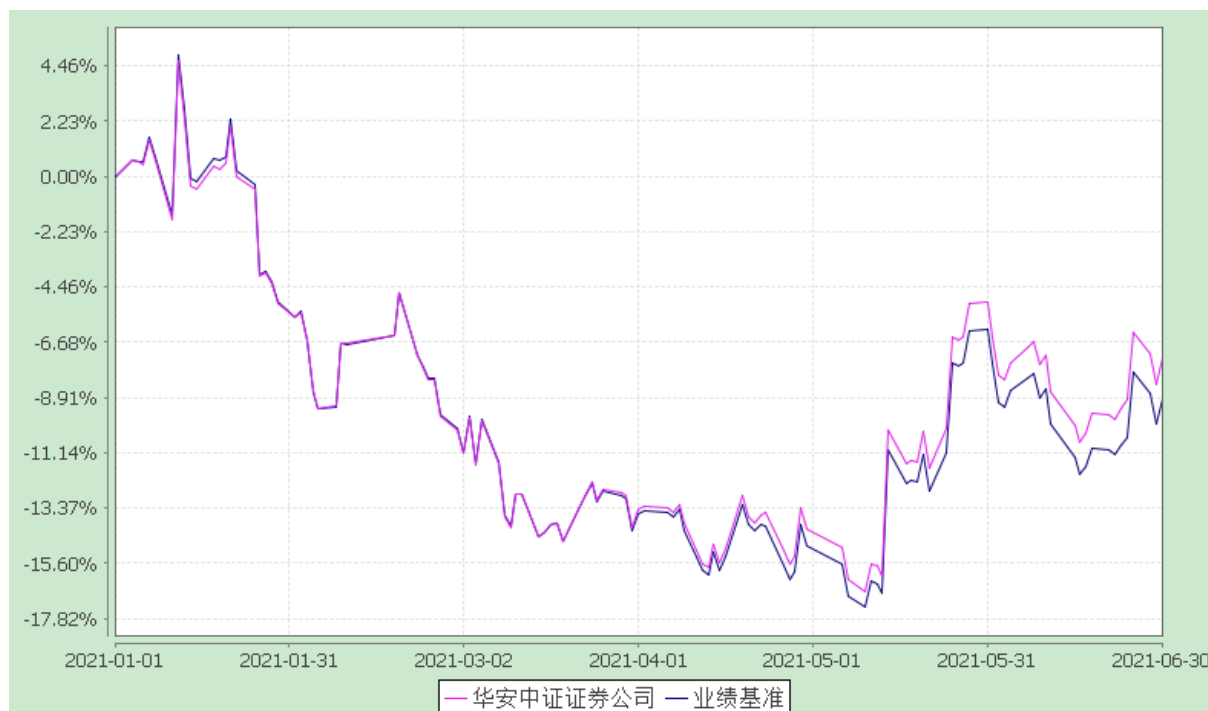
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.41%	1.15%	-3.06%	1.14%	0.65%	0.01%
过去三个月	7.94%	1.51%	6.23%	1.52%	1.71%	-0.01%
过去六个月	-7.35%	1.55%	-9.01%	1.57%	1.66%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.35%	1.55%	-9.01%	1.57%	1.66%	-0.02%

3.2.2 自基金转型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

华安中证全指证券公司指数型证券投资基金

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

（2021 年 1 月 1 日至 2021 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。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 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 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 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		
倪斌	本基金的基金	2021-01-1	-	10 年	硕士研究生，10 年基金行业从业

	经理	8			<p>经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金 (LOF)、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金、华安国际龙头 (DAX) 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安 CES 港股通精选 100 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。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
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	2015-06-09	2021-01-18	17 年	<p>理学博士，17 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</p>

				<p>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 月至 2021 年 1 月，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金）、华安中证银行指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安中证银行指数型证券投资基金）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月，担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安创业板 50 指数型证券投资基金）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</p>
--	--	--	--	---

					的基金经理。2020 年 8 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发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月起，同时担任华安中证电子 50 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遵规守信情况的说明

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

2021 年上半年，中国在全球疫情不断反复的背景下展现了供应优势，叠加发达经济体刺激政策，“外循环”推动了国内生产扩张以及制造业景气。在供需两端的作用下，我国上半年国内生产持续修复。地产投资和出口是拉动经济的主要动力，房地产业在政策抑制下表现出较强韧性。消费端有所改善，但对经济增长贡献仍有限。上半年，资本市场流动性相对充裕，两市成交活跃，推动券商基本面持续向好，行业政策利好不断释放，包括市场化转融资业务、基金投顾业务试点等。但券商板块整体估值承压。

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 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1229 元，本报告期份额净值增长率为-7.35%，同期业绩比较基准增长率-9.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，虽然全球疫情仍有反复，但主要经济体逐渐复苏的格局基本已经确定。疫苗接种范围不断扩大也将推动全球经济恢复。随着我国经济步入平稳阶段，经济增长动力将逐步切换至以消费为主要动力的内需。对于证券行业，我们认为，三季度货币流动性预计仍保持适度宽松，外资有望持续流入，当前证券行业估值仍然低于历史中枢，具备一定的安全边际，中长期来看，伴随居民资产结构配置调整，券商财富管理转型持续推进，券商业绩周期属性将有所减弱，行业估值中枢有望逐步抬升。

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：华安中证全指证券公司指数型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	35,404,920.07
结算备付金		120,540.84
存出保证金		101,801.42
交易性金融资产	6.4.7.2	571,344,967.40
其中：股票投资		571,344,967.40
基金投资		-

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		706,138.92
应收利息	6.4.7.5	3,337.85
应收股利		-
应收申购款		5,628,849.21
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		613,310,555.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日
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		5,218,509.85
应付管理人报酬		479,562.30
应付托管费		105,503.70
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.6	406,033.12
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	163,451.21
负债合计		6,373,060.18
所有者权益:		-
实收基金	6.4.7.8	802,619,828.18
未分配利润	6.4.7.9	-195,682,332.65
所有者权益合计		606,937,495.53
负债和所有者权益总计		613,310,555.71

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1229 元，基金份额总额 540,501,380.10 份。

6.2 利润表

会计主体：华安中证全指证券公司指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-30,215,968.45
1.利息收入		74,554.62
其中：存款利息收入	6.4.7.10	74,189.48
债券利息收入		365.14
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）		18,423,044.75
其中：股票投资收益	6.4.7.11	16,037,068.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	1,258,744.81
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	1,127,231.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-49,547,791.02
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	834,223.20
减：二、费用		4,359,476.98
1. 管理人报酬		2,808,765.39
2. 托管费		617,928.42
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	734,988.41
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		1.32
7. 其他费用	6.4.7.20	197,793.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-34,575,445.43
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-34,575,445.43

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中证全指证券公司指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 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）	747,459,879.41	-137,372,008.00	610,087,871.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,575,445.43	-34,575,445.43
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）	55,159,948.77	-23,734,879.22	31,425,069.55
其中：1.基金申购款	803,436,035.48	-196,080,228.20	607,355,807.28
2.基金赎回款	-748,276,086.71	172,345,348.98	-575,930,737.73
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（基金净值）	802,619,828.18	-195,682,332.65	606,937,495.53

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：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金终止分级运作转型而成，华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金系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[2015]911号《关于准予华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2015年6月9日生效，首次设立募集规模为249,384,967.95份基金份额。根据基金管理人于2020年12月2日发布的《关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之华安中证证券A份额和华安中证证券B份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于2020年12月31日进行基金份额折算，《华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金合同》于2021年1月1日生效，《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。根据基金管理人于2021年1月5日发布的《关于华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之华安中证证券A份额和华安中证证券B份额基金份额折算结果的公

告》，折算前华安中证证券份额为 488,271,125.44 份，华安中证证券 A 份额为 7,542,842.00 份，华安中证证券 B 份额为 7,542,842.00 份；折算后华安中证证券份额为 503,356,808.44 份，华安中证证券 A 份额为 0.00 份，华安中证证券 B 份额为 0.00 份。华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金自 2021 年 1 月 1 日起转型并更名为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证全指证券公司指数的成分股（含存托凭证）及其备选成分股（含存托凭证）、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、存托凭证）、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、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（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本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%，投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证全指证券公司指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率}$ （税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年

度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的

则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金（包括华安中证证券份额、华安中证证券 A 份额、华安中证证券 B 份额）不进行收益分配。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1） 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2） 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通

知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	35,404,920.07
定期存款	-
其他存款	-
合计	35,404,920.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	589,855,898.77	571,344,967.40	-18,510,931.37
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	589,855,898.77	571,344,967.40	-18,510,931.37

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,195.73
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	48.87
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	52.03
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	41.22
合计	3,337.85

6.4.7.6 其他资产

本基金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
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	406,033.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	406,033.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,231.66
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	34,712.18
指数使用费	50,000.00
合计	163,451.21

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	503,356,808.44	747,459,879.41
本期申购	541,049,988.63	803,436,035.48
本期赎回（以“-”号填列）	-503,905,416.97	-748,276,086.71
本期末	540,501,380.10	802,619,828.18

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
基金合同生效日	-312,948,741.22	175,576,733.22	-137,372,008.00
本期利润	14,972,345.59	-49,547,791.02	-34,575,445.43
本期基金份额交易产生的变动数	-21,142,568.55	-2,592,310.67	-23,734,879.22
其中：基金申购款	-325,154,389.37	129,074,161.17	-196,080,228.20
基金赎回款	304,011,820.82	-131,666,471.84	172,345,348.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-319,118,964.18	123,436,631.53	-195,682,332.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	66,254.63
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	3,728.26
其他	4,206.59
合计	74,189.48

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	230,702,920.58
减：卖出股票成本总额	214,665,851.89
买卖股票差价收入	16,037,068.69

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,549,420.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,290,300.00
减：应收利息总额	376.14
买卖债券差价收入	1,258,744.81

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,127,231.25
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	1,127,231.25

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-49,547,791.02
——股票投资	-49,547,791.02
——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	-49,547,791.02

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	834,223.20
合计	834,223.20

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

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

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	734,988.41
银行间市场交易费用	-
合计	734,988.41

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行汇划费	3,573.89
合计	197,793.44

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**

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

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、基金销售机构
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 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	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	62,827,101.41	13.01%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	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	4,290,300.00	43.60%

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 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021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	57,255.18	12.84%	17,357.14	4.27%

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
	2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,808,765.39
其中：支付销售机构的客户维护费	1,028,360.89

注：注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	617,928.42

注：注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未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

份额单位：份

项目	本期
	2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金合同生效日（2021年1月1日）持有	22,860,940.00

的基金份额	
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	22,860,940.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.23%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	35,404,920.07	66,254.63

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日（基金合同生效日）至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,164.00	115,586.46
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34

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（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688538	和辉光电	2021-05-20	2021-11-29	新股限售	2.65	3.38	110,295.00	292,281.75	372,797.10	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股限售	17.71	84.01	1,452.00	25,714.92	121,982.52	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	349.00	16,518.17	87,934.04	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	518.00	17,207.96	45,325.00	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	新股限售	6.50	10.46	3,671.00	23,861.50	38,398.66	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	15.95	22.37	1,627.00	25,950.65	36,395.99	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	291.00	8,229.48	33,671.61	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	236.00	11,467.24	21,332.04	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-

30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 限售	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 限售	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	-
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 限售	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	-
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 限售	8.24	31.54	286.00	2,356. 64	9,020. 44	-
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 限售	8.48	22.07	394.00	3,341. 12	8,695. 58	-
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 限售	8.41	39.13	219.00	1,841. 79	8,569. 47	-
30095 8	建工 修复	2021-0 3-18	2021-0 9-29	新股 限售	8.53	27.22	300.00	2,559. 00	8,166. 00	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 限售	14.79	30.57	264.00	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 限售	6.79	26.81	301.00	2,043. 79	8,069. 81	-
30097 8	东箭 科技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 限售	8.42	13.60	593.00	4,993. 06	8,064. 80	-
30099 3	玉马 遮阳	2021-0 5-17	2021-1 1-24	新股 限售	12.10	19.29	410.00	4,961. 00	7,908. 90	-
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 限售	24.90	24.81	295.00	7,345. 50	7,318. 95	-
30100 4	嘉益 股份	2021-0 6-18	2021-1 2-27	新股 限售	7.81	21.94	312.00	2,436. 72	6,845. 28	-
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股 限售	8.29	8.29	782.00	6,482. 78	6,482. 78	-
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 限售	5.48	13.03	492.00	2,696. 16	6,410. 76	-
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 限售	12.13	22.49	283.00	3,432. 79	6,364. 67	-
30101 1	华立 科技	2021-0 6-09	2021-1 2-17	新股 限售	14.20	33.84	175.00	2,485. 00	5,922. 00	-
30096 7	晓鸣 股份	2021-0 4-02	2021-1 0-13	新股 限售	4.54	11.54	507.00	2,301. 78	5,850. 78	-
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 限售	7.19	12.65	430.00	3,091. 70	5,439. 50	-
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 限售	12.08	23.06	234.00	2,826. 72	5,396. 04	-
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股 限售	8.86	8.86	555.00	4,917. 30	4,917. 30	-
30102 0	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 限售	10.64	10.64	421.00	4,479. 44	4,479. 44	-

300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-

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，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，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。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	35,404,920.07	-	-	-	35,404,920.07
结算备付金	120,540.84	-	-	-	120,540.84
存出保证金	101,801.42	-	-	-	101,801.42

交易性金融资产	-	-	-	571,344,967.40	571,344,967.40
应收证券清算款	-	-	-	706,138.92	706,138.92
应收利息	-	-	-	3,337.85	3,337.85
应收申购款	136,445.10	-	-	5,492,404.11	5,628,849.21
资产总计	35,763,707.43	-	-	577,546,848.28	613,310,555.71
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	-	-	-	5,218,509.85	5,218,509.85
应付管理人报酬	-	-	-	479,562.30	479,562.30
应付托管费	-	-	-	105,503.70	105,503.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	406,033.12	406,033.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	163,451.21	163,451.21
负债总计	-	-	-	6,373,060.18	6,373,060.18
利率敏感度缺口	35,763,707.43	-	-	571,173,788.10	606,937,495.53

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

本基金于 2021 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	571,344,967.40	94.14
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	-	-
合计	571,344,967.40	94.14

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 2021年6月30日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,009
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,009

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本财务报表已于 2021 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

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	571,344,967.40	93.16
	其中：股票	571,344,967.40	93.16
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	35,525,460.91	5.79
8	其他各项资产	6,440,127.40	1.05
9	合计	613,310,555.71	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	-	-
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	569,241,655.72	93.79
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	569,241,655.72	93.79

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,651,584.76	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	306,699.54	0.05
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	30,477.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
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	2,103,311.68	0.35

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	2,757,280	90,411,211.20	14.90
2	600030	中信证券	2,884,764	71,946,014.16	11.85
3	600837	海通证券	3,269,358	37,597,617.00	6.19
4	601688	华泰证券	1,743,874	27,553,209.20	4.54
5	601211	国泰君安	1,527,266	26,177,339.24	4.31
6	600999	招商证券	1,256,484	23,898,325.68	3.94
7	601377	兴业证券	1,813,973	17,522,979.18	2.89
8	000776	广发证券	1,002,087	15,171,597.18	2.50
9	000166	申万宏源	3,052,211	14,284,347.48	2.35
10	600958	东方证券	1,414,106	14,126,918.94	2.33
11	601901	方正证券	1,393,590	13,044,002.40	2.15
12	601788	光大证券	661,133	11,827,669.37	1.95
13	002736	国信证券	976,331	10,495,558.25	1.73

14	600109	国金证券	819,159	10,395,127.71	1.71
15	601066	中信建投	329,522	10,356,876.46	1.71
16	000783	长江证券	1,310,579	9,593,438.28	1.58
17	601108	财通证券	850,400	8,920,696.00	1.47
18	601555	东吴证券	1,051,100	8,766,174.00	1.44
19	000728	国元证券	1,033,963	8,240,685.11	1.36
20	002797	第一创业	1,138,218	8,126,876.52	1.34
21	601099	太平洋	2,307,650	7,822,933.50	1.29
22	600061	国投资本	869,865	7,385,153.85	1.22
23	601162	天风证券	1,466,880	7,129,036.80	1.17
24	601878	浙商证券	525,127	6,868,661.16	1.13
25	601990	南京证券	623,928	6,563,722.56	1.08
26	600909	华安证券	1,176,829	6,554,937.53	1.08
27	601696	中银证券	279,600	5,756,964.00	0.95
28	600369	西南证券	1,124,661	5,477,099.07	0.90
29	000750	国海证券	1,290,286	5,470,812.64	0.90
30	601995	中金公司	88,700	5,455,050.00	0.90
31	002926	华西证券	533,017	5,132,953.71	0.85
32	601198	东兴证券	466,621	5,100,167.53	0.84
33	002673	西部证券	605,226	4,993,114.50	0.82
34	002500	山西证券	729,066	4,892,032.86	0.81
35	601881	中国银河	436,245	4,702,721.10	0.77
36	002670	国盛金控	392,845	4,474,504.55	0.74
37	600155	华创阳安	412,111	4,409,587.70	0.73
38	000686	东北证券	475,182	4,015,287.90	0.66
39	002939	长城证券	314,900	3,504,837.00	0.58
40	601375	中原证券	700,088	3,409,428.56	0.56
41	601236	红塔证券	245,900	3,334,404.00	0.55
42	601456	国联证券	196,300	3,023,020.00	0.50
43	600621	华鑫股份	179,208	2,845,823.04	0.47
44	600918	中泰证券	258,900	2,801,298.00	0.46
45	000712	锦龙股份	151,474	2,605,352.80	0.43
46	600095	湘财股份	181,200	2,121,852.00	0.35
47	600864	哈投股份	351,700	2,117,234.00	0.35
48	002945	华林证券	91,100	1,259,002.00	0.21
49	002961	瑞达期货	45,000	959,400.00	0.16
50	603093	南华期货	41,000	598,600.00	0.10

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	688538	和辉光电	110,295.00	372,797.10	0.06
2	688161	威高骨科	3,069.00	325,467.45	0.05
3	301015	百洋医药	4,614.00	251,115.78	0.04
4	688661	和林微纳	1,452.00	121,982.52	0.02
5	301016	雷尔伟	2,747.00	115,711.58	0.02
6	300957	贝泰妮	349.00	87,934.04	0.01
7	301018	申菱环境	7,811.00	64,753.19	0.01
8	688239	航宇科技	4,926.00	56,550.48	0.01
9	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.01
10	301017	漱玉平民	5,550.00	49,173.00	0.01
11	300979	华利集团	518.00	45,325.00	0.01
12	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.01
13	688659	元琛科技	3,671.00	38,398.66	0.01
14	688395	正弦电气	1,627.00	36,395.99	0.01
15	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
16	300973	立高食品	291.00	33,671.61	0.01
17	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.00
18	301009	可靠股份	801.00	22,339.89	0.00
19	300981	中红医疗	236.00	21,332.04	0.00
20	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.00
21	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.00
22	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
23	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.00
24	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
25	300997	欢乐家	928.00	12,110.40	0.00
26	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
27	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
28	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
29	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
30	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
31	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
32	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
33	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
34	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
35	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
36	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
37	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
38	300987	川网传媒	301.00	8,069.81	0.00
39	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
40	300993	玉马遮阳	410.00	7,908.90	0.00
41	300985	致远新能	295.00	7,318.95	0.00
42	301004	嘉益股份	312.00	6,845.28	0.00
43	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
44	300963	中洲特材	283.00	6,364.67	0.00

45	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
46	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
47	300972	万辰生物	430.00	5,439.50	0.00
48	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
49	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
50	300995	奇德新材	191.00	4,454.12	0.00
51	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
52	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
53	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
54	300992	泰福泵业	200.00	4,064.00	0.00
55	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	32,641,707.59	5.38
2	600030	中信证券	31,022,360.67	5.11
3	600837	海通证券	19,615,644.17	3.23
4	601688	华泰证券	13,565,825.00	2.24
5	600999	招商证券	11,282,237.80	1.86
6	601211	国泰君安	10,228,635.00	1.69
7	601066	中信建投	9,218,444.00	1.52
8	601377	兴业证券	6,414,279.00	1.06
9	000776	广发证券	6,362,507.05	1.05
10	000166	申万宏源	5,791,734.91	0.95
11	600958	东方证券	5,567,372.25	0.92
12	601995	中金公司	5,426,140.00	0.89
13	601901	方正证券	5,045,304.52	0.83
14	002736	国信证券	4,659,555.00	0.77
15	600109	国金证券	4,444,909.00	0.73
16	601788	光大证券	4,306,578.65	0.71
17	000783	长江证券	3,918,237.00	0.65
18	600909	华安证券	3,913,011.34	0.64
19	601162	天风证券	3,873,096.00	0.64
20	002797	第一创业	3,869,190.00	0.64

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	30,493,505.45	5.02
2	600030	中信证券	28,474,703.24	4.69
3	601688	华泰证券	16,265,520.67	2.68
4	600837	海通证券	10,602,258.00	1.75
5	600999	招商证券	10,151,915.37	1.67
6	601211	国泰君安	9,301,635.00	1.53
7	601377	兴业证券	5,848,369.00	0.96
8	000776	广发证券	5,635,138.02	0.93
9	000166	申万宏源	5,318,316.00	0.88
10	600958	东方证券	5,193,400.15	0.86
11	601456	国联证券	4,670,776.00	0.77
12	601901	方正证券	4,634,203.00	0.76
13	600109	国金证券	4,318,354.00	0.71
14	002736	国信证券	4,251,713.67	0.70
15	601788	光大证券	4,067,124.00	0.67
16	601878	浙商证券	4,041,122.00	0.67
17	000783	长江证券	3,706,604.00	0.61
18	601108	财通证券	3,473,238.00	0.57
19	601555	东吴证券	3,363,853.20	0.55
20	601099	太平洋	3,032,272.25	0.50

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	257,899,016.43
卖出股票的收入（成交）总额	230,702,920.58

注：注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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	101,801.42
2	应收证券清算款	706,138.92

3	应收股利	-
4	应收利息	3,337.85
5	应收申购款	5,628,849.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,440,127.40

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

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	688538	和辉光电	372,797.10	0.06	处于锁定期
2	688661	和林微纳	121,982.52	0.02	处于锁定期
3	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	处于锁定期
4	301016	雷尔伟	9,069.50	0.00	处于锁定期

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	持有人结构
----------	-------	-------

	基金份额	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
89,744	6,022.70	29,914,318.36	5.53%	510,587,061.74	94.47%

8.2 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	10,774.29	0.00%

8.3 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（2021 年 1 月 1 日）基金份额总额	503,356,808.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	541,049,988.63
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	503,905,416.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	540,501,380.10

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：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

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

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	
中金公司	1	147,516,687.38	30.55%	137,382.33	30.81%	-
方正证券	3	64,205,729.52	13.30%	58,511.07	13.12%	-
国泰君安证券	1	62,827,101.41	13.01%	57,255.18	12.84%	-
华泰证券	1	54,090,126.83	11.20%	49,647.04	11.13%	-
海通证券	1	33,932,460.82	7.03%	31,601.26	7.09%	-
申万宏源	3	24,690,151.58	5.11%	22,500.18	5.05%	-
广发证券	1	24,348,999.87	5.04%	22,676.46	5.09%	-
兴业证券	1	19,774,004.70	4.10%	18,415.40	4.13%	-
上海证券	3	17,381,334.86	3.60%	16,187.36	3.63%	-
国盛证券	1	16,190,707.07	3.35%	15,078.52	3.38%	-
招商证券	3	11,363,030.17	2.35%	10,582.18	2.37%	-
华安证券	1	2,455,231.86	0.51%	2,286.64	0.51%	-
粤开证券	1	2,433,894.74	0.50%	2,266.70	0.51%	-
天风证券	2	1,654,502.27	0.34%	1,540.84	0.35%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

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，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(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：

2021 年 3 月完成租用托管在建设银行的 中信建投证券 上交所 49968 交易单元

2021 年 6 月完成托管在建设银行的 申万宏源 深交所 278300 交易单元退租

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	4,290,300.00	43.60%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	5,549,420.95	56.40%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

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	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-04
2	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-04
3	关于华安中证全指证券公司指数型证券投资基金恢复场内大额申购及大额定期定额投资的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-05
4	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-16
5	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-20
6	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-01-20
7	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-02-06
8	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-09
9	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-24
10	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
11	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
12	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
13	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-03-31
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(味知香)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-04-20
15	华安中证全指证券公司指数型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-04-21

16	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（华生科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-04-21
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-04-22
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-05-31
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-06-09
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2021-06-18

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安中证全指证券公司指数型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中证全指证券公司指数型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中证全指证券公司指数型证券投资基金托管协议》
- 4、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；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

二〇二一年八月三十日