华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

1 重要提示

1.1 重要提示

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

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

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安中证全指证券公司指数分级		
场内简称	证券股基		
基金主代码	160419		
交易代码	160419		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月9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	247,273,355.23份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳		
上市日期	2015年6月18日		
下属分级基金的基金简称	华安中证全指证券公司指数分级A	华安中证全指证券公司指数分级B	华安中证全指证券公司指数分级
下属分级基金的场内简称	证券股A	证券股B	证券股基
下属分级基金的交易代码	150301	150302	160419
报告期末下属分级基金的份额总额	17,414,843.00份	17,414,843.00份	212,443,669.23份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数(本基金的标的指数为中证全指证券公司指数),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%。 为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保投资组合对指数跟踪的效果。
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。 从本基金所分离的两类基金份额来看,华安中证证券A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征;华安中证证券B份额具有高风险、高预期收益的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	-5,297,194.43
本期利润	30,589,130.34
加权平均基金份额本期利润	0.1561
本期基金份额净值增长率	35.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.7968
期末基金资产净值	238,916,761.77
期末基金份额净值	0.9662

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)。

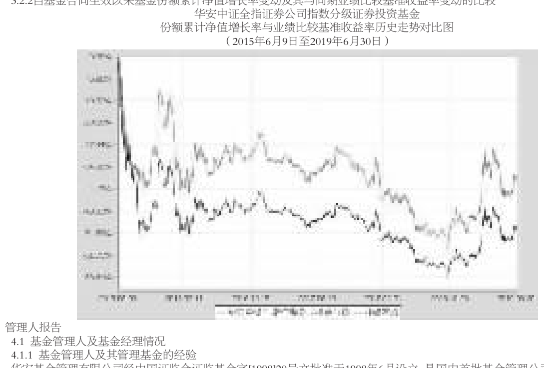
3.2 基金净值表现

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	9.27%	1.96%	9.60%	1.98%	-0.33%	-0.02%
过去三个月	-6.73%	2.23%	-6.71%	2.25%	-0.02%	-0.02%
过去六个月	35.92%	2.59%	36.53%	2.64%	-0.61%	-0.05%
过去一年	31.47%	2.28%	28.98%	2.31%	2.49%	-0.03%
过去三年	-9.18%	1.66%	-11.92%	1.68%	2.74%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-37.63%	2.11%	-53.16%	2.28%	15.53%	-0.17%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月9日至2019年6月30日)



6.1 资产负债表

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	13,651,207.50	5,683,824.43
结算备付金	114,818.15	151,910.96
存出保证金	61,413.92	11,474.49
交易性金融资产	225,497,221.48	100,793,410.36
其中:股票投资	225,497,221.48	100,360,582.36
基金投资	-	-
债券投资	-	432,828.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,370,408.87	842,901.36
应收利息	2,658.68	2,266.61
应收股利	-	-
应收申购款	618,675.81	204,192.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	242,316,404.41	107,689,980.69
负债和所有者权益	**本期末 2019年6月30日**	**上年度末 2018年12月31日**
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,763,760.25	1,130,127.89
应付管理人报酬	192,247.88	96,259.15
应付托管费	42,294.54	21,177.03
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	225,661.70	54,261.22
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	175,678.27	273,959.31
负债合计	3,399,642.64	1,575,784.60
所有者权益:	-	-
实收基金	386,964,896.48	235,620,004.56
未分配利润	-148,048,134.71	-129,505,808.47
所有者权益合计	238,916,761.77	106,114,196.09
负债和所有者权益总计	242,316,404.41	107,689,980.69

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9662元,基金份额总额247,273,355.23份,其中:华安中证证券份额净值0.9662元,基金份额总额212,443,669.23份;华安中证证券A份额参考净值1.0297元,份额总额17,414,843.00份;华安中证证券B份额参考净值0.9027元,份额总额17,414,843.00份。

6.2 利润表

会计主体:华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	32,309,285.55	-25,111,738.47
1.利息收入	56,510.42	26,396.43
其中:存款利息收入	56,459.60	26,182.34
债券利息收入	50.82	214.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-4,400,140.71	-2,132,363.95
其中:股票投资收益	-4,751,284.80	-2,571,584.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	28,321.19	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	322,822.90	439,220.12
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	35,886,324.77	-23,049,716.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	766,591.07	43,945.94
减:二、费用	1,720,155.21	1,000,767.42
1. 管理人报酬	966,605.92	576,363.93
2. 托管费	212,653.29	126,800.03
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	323,396.77	57,899.74
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7. 其他费用	217,499.23	239,703.72
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	30,589,130.34	-26,112,505.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	30,589,130.34	-26,112,505.89

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分级证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	235,620,004.56	-129,505,808.47	106,114,196.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,589,130.34	30,589,130.34
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)	151,344,891.92	-49,131,456.58	102,213,435.34
其中:1.基金申购款	659,838,630.18	-243,599,430.90	416,239,199.28

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	30,845,095.07	12.62%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

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

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	28,109.31	12.41%	28,109.31	12.46%
关联方名称	**上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日**			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	966,605.92	576,363.93
其中:支付销售机构的客户维护费	307,811.88	103,615.10

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×1.00%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	212,653.29	126,800.03

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×1.00%/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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	13,651,207.50	53,427.10	6,011,809.37	25,679.51

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2019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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2019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。

6.4.10 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	225,497,221.48	93.06
	其中:股票	225,497,221.48	93.06
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,766,025.65	5.68
7	其他各项资产	3,053,157.28	1.26
8	合计	242,316,404.41	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	225,497,221.48	94.38
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	-	-

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	61,413.92
2	应收证券清算款	2,370,408.87
3	应收股利	-
4	应收利息	2,658.68
5	应收申购款	618,675.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,053,157.28

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安中证全指证券公司指数分级A	189	92,142.03	3,351,979.00	19.25%	14,062,864.00	80.75%
华安中证全指证券公司指数分级B	1,587	10,973.44	100.00	0.00%	17,414,743.00	100.00%
华安中证全指证券公司指数分级	15,260	13,921.60	460,237.71	0.22%	211,983,431.52	99.78%
合计	17,036	14,514.75	3,812,316.71	1.54%	243,461,038.52	98.46%

8.2 期末上市基金前十名持有人

华安中证全指证券公司指数分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	3,748,234.00	21.52%
2	中意人寿保险有限公司-万能-团体万能	1,693,877.00	9.73%
3	张欣秋	1,201,135.00	6.90%
4	赵峰	1,000,000.00	5.74%
5	黄昱成	698,397.00	4.01%
6	齐静	646,865.00	3.71%
7	王少男	604,742.00	3.47%
8	宁波万坤投资管理合伙企业(有限合伙)-东方点睛6号可转债A私募投资基金	595,108.00	3.42%
9	北京磐沣投资管理合伙企业(有限合伙)-磐沣现金管理私募证券投资基金	522,900.00	3.00%
10	潘若愚	510,600.00	2.93%

华安中证全指证券公司指数分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	3,331,541.00	19.13%
2	钟贵雄	1,972,145.00	11.32%
3	刘玉彬	969,516.00	5.57%
4	李霞	566,530.00	3.25%
5	朱洪宏	476,380.00	2.74%
6	温日高	443,430.00	2.55%
7	许珍华	408,316.00	2.34%
8	柳强	342,111.00	1.96%
9	胡竹兰	302,151.00	1.74%
10	赖国全	299,860.00	1.72%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安中证全指证券公司指数分级A	70,523.00	0.40%
	华安中证全指证券公司指数分级B	0.00	0.00%
	华安中证全指证券公司指数分级	228.07	0.00%
	合计	70,751.07	0.03%

8.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安中证全指证券公司指数分级A	华安中证全指证券公司指数分级B	华安中证全指证券公司指数分级
基金合同生效日(2015年6月9日)基金份额总额	101,534,190.00	101,534,190.00	46,316,587.95
本报告期期初基金份额总额	7,585,765.00	7,585,765.00	79,660,136.69
本报告期基金总申购份额	-	-	455,005,561.33
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	302,563,872.79
本报告期基金拆分变动份额	9,829,078.00	9,829,078.00	-19,658,156.00
本报告期期末基金份额总额	17,414,843.00	17,414,843.00	212,443,669.23

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下:

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下:

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一九年八月二十八日