华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：上海证券交易所
上市时间：2019年3月29日
公告日期：2019年3月26日

一、重要声明与提示

华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2018年12月3日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及华安基金管理有限公司网站(www.huaan.com.cn)上的《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金。
2、基金类型：股票型证券投资基金
3、运作方式：交易型开放式
4、基金存续期限：不定期
5、基金简称：华安沪深300低波ETF。
6、基金二级市场交易简称及交易代码：300低波，交易代码：512270。
7、基金申购、赎回简称及代码：300低波，代码：512271。
8、基金份额总额：截至2019年3月22日，本基金的基金份额总额为375,576,750份。
9、基金份额净值：截至2019年3月22日，本基金的基金份额净值为1.0050元。
10、本次上市交易的基金份额总额：截至2019年3月22日，本次上市交易的基金份额总额为375,576,750份。
11、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
12、上市交易日期：2019年3月29日。
13、基金管理人：华安基金管理有限公司。
14、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
15、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。
16、申购赎回代办券商（简称“一级交易商”）：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、天风证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

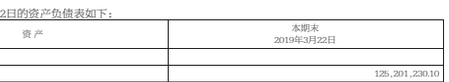
（一）本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2018】963号文。
2、基金合同生效日：2019年3月7日。
3、基金运作方式：交易型、开放式。
4、基金合同期限：不定期。
5、发售日期：本基金自2018年12月6日至2019年2月28日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。其中，网上现金认购的日期为2019年2月26日至2019年2月28日；通过基金管理人进行网下现金认购和网下股票认购的日期为2018年12月6日至2019年2月28日；通过发售代理机构进行的网下现金认购和网下股票认购的日期为2018年12月6日至2019年2月28日。
6、发售价格：1.00 元人民币。
7、发售期限：网下现金认购和网下股票认购发售5个工作日，网上现金认购发售3个工作日。
8、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
9、发售机构
（1）网下现金发售和网下股票发售直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金和网下股票认购。
（2）网下现金发售和网下股票发售代理机构
本基金网下现金发售代理机构包括：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司。
本基金网下股票发售代理机构包括：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司。
（3）网上现金发售代理机构
本基金网上现金认购代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券承销保荐有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东亚前海证券有限责任公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华菁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、J.千前海证券有限责任公司、江海证券有限责任公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申港证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天国富证券有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中邮券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。
（二）基金的同生效
本基金自2018年12月6日起向社会公开募集，截至2019年2月28日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，此次募集的有效净认购金额为人民币375,576,750元，认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币0元。本次募集认购资金及其产生的利息已于2019年3月6日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购户数为3298户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集的基金份额共计375,576,750份，已全部计入本基金基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2019年3月7日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。
（三）基金份额折算
本基金不进行基金份额折算。
（四）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2019]40号。
2、上市交易日期：2019年3月29日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
4、基金二级市场交易简称：300低波。
5、基金二级市场交易代码：512270。
6、基金申购、赎回简称：300低波。
7、基金申购、赎回代码：512271。本基金申购赎回业务的办理机构为经上海证券交易所确认的一级交易商，投资者应当在本基金的一级交易商办理本基金的申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购、赎回。目前本基金的一级交易商包括：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司。
（3）网上现金发售代理机构
本基金网上现金认购代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券承销保荐有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东亚前海证券有限责任公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华菁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、J.千前海证券有限责任公司、江海证券有限责任公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申港证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天国富证券有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中邮券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。
（二）基金的同生效
本基金自2018年12月6日起向社会公开募集，截至2019年2月28日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，此次募集的有效净认购金额为人民币375,576,750元，认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币0元。本次募集认购资金及其产生的利息已于2019年3月6日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购户数为3298户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集的基金份额共计375,576,750份，已全部计入本基金基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2019年3月7日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。
（三）基金份额折算
本基金不进行基金份额折算。
（四）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2019]40号。
2、上市交易日期：2019年3月29日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
4、基金二级市场交易简称：300低波。
5、基金二级市场交易代码：512270。
6、基金申购、赎回简称：300低波。
7、基金申购、赎回代码：512271。本基金申购赎回业务的办理机构为经上海证券交易所确认的一级交易商，投资者应当在本基金的一级交易商办理本基金的申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购、赎回。目前本基金的一级交易商包括：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司。
8、本次上市交易的基金份额总额：375,576,750份（截至2019年3月22日）。
9、头上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在头上市交易的基金份额。
10、本基金将以2019年3月28日的基金份额净值作为上市首日（即2019年3月29日）的开盘参考价。
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人
（一）持有人户数
截至2019年3月22日，本基金份额持有人户数为3,298户，平均每户持有的基金份额为113,880.15份。
（二）持有人结构
截至2019年3月22日，本基金份额持有人结构如下：
机构投资者持有的基金份额为13份，占基金总份额的2.07%；个人投资者持有的基金份额为3,285份，占基金总份额的97.93%。
（三）前十名基金份额持有人的情况
截至2019年3月22日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	李敬慧	7,000,000.00	1.86%
2	马国雅	4,300,000.00	1.14%
3	王君杰	2,030,000.00	0.54%
4	常州市德速机械有限公司	2,000,000.00	0.53%
5	张黎黎	2,000,000.00	0.53%
6	侯建华	2,000,000.00	0.53%
7	李怡欣	2,000,000.00	0.53%
8	邹芸秋	2,000,000.00	0.53%
9	吴佳润	2,000,000.00	0.53%
10	张志清	2,000,000.00	0.53%

（四）截止到2019年3月22日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况
本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为0份，占该基金总份额的比例为0%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0份。
五、基金主要当事人简介
（一）基金管理人
1、名称：华安基金管理有限公司
2、法定代表人：朱学华
3、总经理：童威
4、注册资本：15亿元人民币
5、住所：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
6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071
8、经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。
9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

10、内部组织结构及职能
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。
董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由八名董事组成，其中，每一股东各推荐一名，总经理为公司董事，另两名为独立董事。董事会为股东会的执行机构，并对股东会负责。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。
监事会由三名监事组成，其中两名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。
公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。
公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，设有投资研究、市场营销、运营及后台、合规风控四大板块以及两个子公司（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）。公司组织架构如下图所示：



11、人员情况：
截至2018年12月31日，公司目前共有员工358人（不含香港公司），其中57%具有硕士及以上学位，92%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。
12、信息披露负责人：陆莹
电话：（021）38969727
13、基金管理业务情况简介：
截至2018年12月31日，华安基金管理有限公司旗下共管理108只开放式基金，资产规模达2766.1亿元人民币。旗下管理的基金包括：华安创新、华安MSCI中国A股指数增强、华安现金富利、华安宝利配置、华安上证180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安稳定收益、华安核心优选、华安强化收益、华安上证180ETF联接、华安动态灵活配置、华安行业轮动、华安善利、华安精选、华安上证龙头ETF联接、华安上证龙头ETF、华安升级主题、华安大中华升级、华安可转债、华安量化多因子、华安信用四季红、华安科技动力、华安标普全球石油、华安月月鑫、华安季季鑫、华安月安鑫、华安沪深300、华安逆向策略、华安安心收益、华安日日鑫、华安添益债、华安纯债、华安债券、华安双债添利、华安黄金ETF、华安纳斯达克100美元现钞、华安易富黄金ETF联接、华安沪深300量化增强、华安年年丰收、华安中证细分医药ETF、华安新活力、华安大国新经济、华安安顺、华安汇财通、华安德国30(DAX)ETF、华安德国30(DAX)ETF联接、华安中证细分医药ETF联接、华安安享、华安年年盈、华安物联网主题、华安新动力、华安新丝路主题、华安智能装备主题、华安媒体互联网、华安新能源主题、华安新机遇、华安中证全指证券、华安中证银行、华安添顺、华安国企改革、华安创业板50、华安新乐享、华安安益、华安定康、华安安悦、华安沪港深外延增长、华安稳健回报、华安美元货币、华安美元现汇、华安安享灵活、华安全球美元票息A美元现汇、华安创业板50ETF、华安安进灵活配置、华安聚利18个月、华安智增精选、华安睿享定期开放、华安惠丰、华安新瑞利、华安新恒利、华安新泰利、华安事件驱动量化策略、华安新丰利、华安沪港深通精选、华安现金宝、华安睿享、华安沪港深机会、华安文体健康主题、华安文大安全、华安幸福生活、华安惠瑞定期开放、华安红利精选、华安悦悦、华安研究精选、华安安逸半年定开、华安睿明两年定开、华安CES港股通精选100ETF、华安CES港股通精选100ETF联接、华安全球稳健配置、华安安禧、华安MSCI中国A股国际ETF、华安MSCI中国A股国际ETF联接、华安鼎益、华安创业板50ETF联接、华安中证500ETF业中性低波动ETF、华安制造先锋等108只开放式基金。
14、本基金基金经理
苏卿云先生，注册金融分析师（CFA）。伦敦商学院金融硕士，厦门大学会计学硕士。曾任职于上海证券交易所，从事基金研究发展工作。2016 年 7 月加入华安基金，任职于指数与量化投资事业总部。2016年12月起担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017年6月起担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金的基金经理。2017年10月起担任华安沪深300指数分级证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及联接基金的基金经理，2017年12月起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。2018年9月起任华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2019年1月起任华安中证500行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
（二）基金托管人
1、名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
2、住所：北京市西城区金融大街25号
3、办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
4、法定代表人：田国立
5、成立时间：2004年09月17日
6、组织形式：股份有限公司
7、注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万肆千肆佰捌拾陆元整
8、存续期间：持续经营
9、基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
10、联系人：田青
11、联系电话：(010)6759 5096
12、基金托管业务经营情况：
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末，中国建设银行已托管857只证券投资基金，中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。
（三）一级交易商
目前，本基金一级交易商名单如下：
中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、天风证券股份有限公司。
（四）基金验资机构
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318 号星展银行大厦6楼
办公地址：中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
联系电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
联系人：魏佳亮
经办会计师：单峰、魏佳亮
六、基金问题题
基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。
七、基础务状况
（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
本基金截至2019年3月22日的资产负债表如下：

资 产	本期末 2019年3月22日
资 产：	
银行存款	125,201,230.10
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	252,581,187.00
其中：股票投资	252,093,187.00
基金投资	
债券投资	488,000.00
资产支持证券投资	
商品现货合约投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	3,137.64
应收股利	
应收申购款	
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	377,785,554.74
负债和所有者权益	
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	77,225.87
应付托管费	15,445.19
应付销售服务费	
应付交易费用	229,939.63
应交税费	
应付利息	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	13,166.82
负债合计	335,777.51
所有者权益：	
实收基金	375,576,750.00
未分配利润	1,873,027.23
所有者权益合计	377,449,777.23
负债和所有者权益总计	377,785,554.74

注：报告截止日2019年3月22日，基金份额净值 1.0050元，基金份额总额375,576,750.00份。
八、基金投资组合
截至2019年3月22日，本基金的投资组合情况如下：
（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	252,093,187.00	66.73
	其中：股票	252,093,187.00	66.73
2	固定收益投资	488,000.00	0.13
	其中：债券	488,000.00	0.13
	资产支持证券	-	-
3	商品期货合约投资		
	其中：股票		
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	125,201,230.10	33.14
7	其他各项资产	3,137.64	0.00
8	合计	377,785,554.74	100

（二）期末按行业分类的股票投资组合
1、权益投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有权益投资股票。
2、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,287,878.00	2.2
C	制造业	89,075,109.00	23.6
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,869,944.00	1.82
E	建筑业	10,682,641.00	2.83
F	批发和零售业	11,169,564.00	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	8,596,418.00	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,259,574.00	3.51
J	金融业	92,876,899.00	24.61
K	房地产业	7,105,644.00	1.88
L	租赁和商务服务业	1,836,552.00	0.49
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	2,342,964.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	252,093,187.00	66.79

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000876	新 希 望	706,400	8,773,488.00	2.32
2	601328	交通银行	810,500	5,179,095.00	1.37
3	601169	北京银行	809,600	5,076,192.00	1.34
4	600919	江苏银行	713,900	5,054,412.00	1.34
5	601166	兴业银行	258,700	4,682,470.00	1.24
6	000166	申万宏源	817,200	4,625,352.00	1.23
7	600519	贵州茅台	5,800	4,606,200.00	1.22
8	601988	中国银行	1,207,900	4,590,020.00	1.22
9	600016	民生银行	691,500	4,439,430.00	1.18
10	600000	浦发银行	373,600	4,255,304.00	1.13

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前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
（四）期末按券种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	488,000.00	0.13
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	488,000.00	0.13

（五）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110063	苏银转债	4,880	488,000.00	0.13

（六）投资组合报告附注
1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	3,137.64
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	3,137.64

4 报告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。
5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
九、重大事件揭示
本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。
十、基金管理人承诺
基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。
十一、基金托管人承诺
基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金支付和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正，基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。
十二、备查文件目录
（一）中国证监会准予华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金注册的文件
（二）《华安沪深300行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
（三）《华安沪深300行业中性低波动交易型开