

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资 基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 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	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56

8.3 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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
8.6 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	82
8.7 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	82
8.8 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	82
8.9 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	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12 投资组合报告附注	83
§ 9 基金份额持有人信息	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 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情况	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	84
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	91
12.1 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	91
§ 13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
13.2 存放地点	91
13.3 查阅方式	91

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称	华安中国 A 股增强指数
基金主代码	040002
前端交易代码	040002
后端交易代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,449,592,847.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金将日均跟踪误差最大容忍值设定为 0.5%。
业绩比较基准	95%*MSCI 中国 A 股指数收益率+5%*金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，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货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	廖林

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-30,363,566.14	-186,798,486.11	-189,377,791.03
本期利润	46,660,207.61	-162,977,550.49	-376,367,866.92
加权平均基金份额本期利润	0.0330	-0.1145	-0.2559
本期加权平均净值利润率	4.83%	-14.49%	-29.02%
本期基金份额净值增长率	4.99%	-14.06%	-22.83%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	628,165,154.93	563,953,885.29	737,758,836.79
期末可供分配基金份额利润	0.4333	0.3984	0.5138

期末基金资产净值	1,069,890,179.42	995,331,283.01	1,175,336,317.49
期末基金份额净值	0.7381	0.7030	0.8180
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	406.71%	382.61%	461.56%

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，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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）。

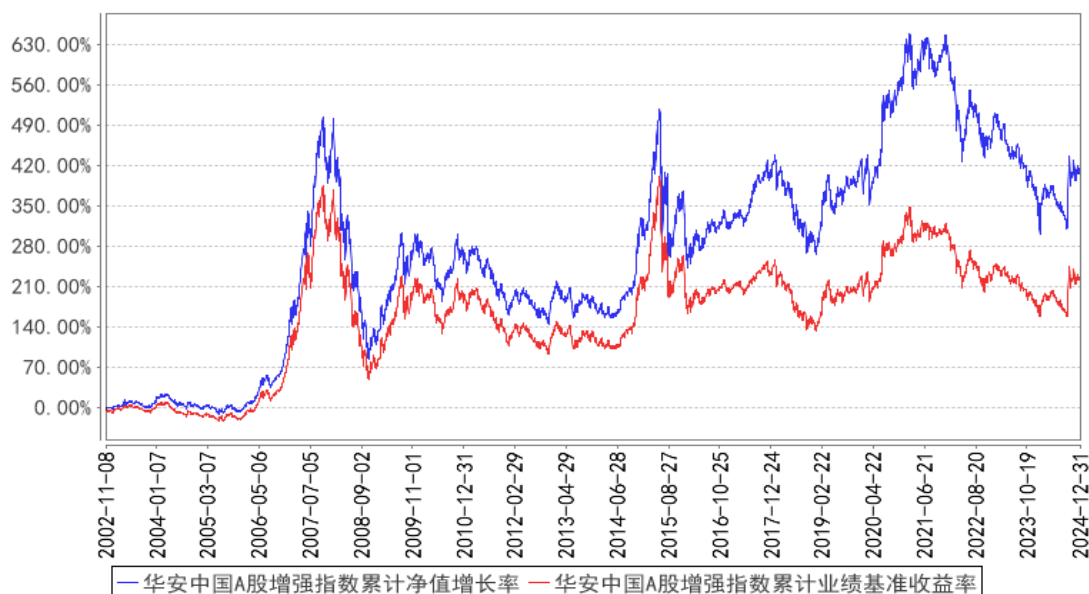
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-0.93%	1.56%	-1.36%	1.69%	0.43%	-0.13%
过去六个月	12.17%	1.51%	13.57%	1.64%	-1.40%	-0.13%
过去一年	4.99%	1.42%	11.50%	1.37%	-6.51%	0.05%
过去三年	-30.37%	1.23%	-21.62%	1.16%	-8.75%	0.07%
过去五年	-1.66%	1.28%	0.36%	1.19%	-2.02%	0.09%
自基金合同生效起至今	406.71%	1.51%	219.61%	1.48%	187.10%	0.03%

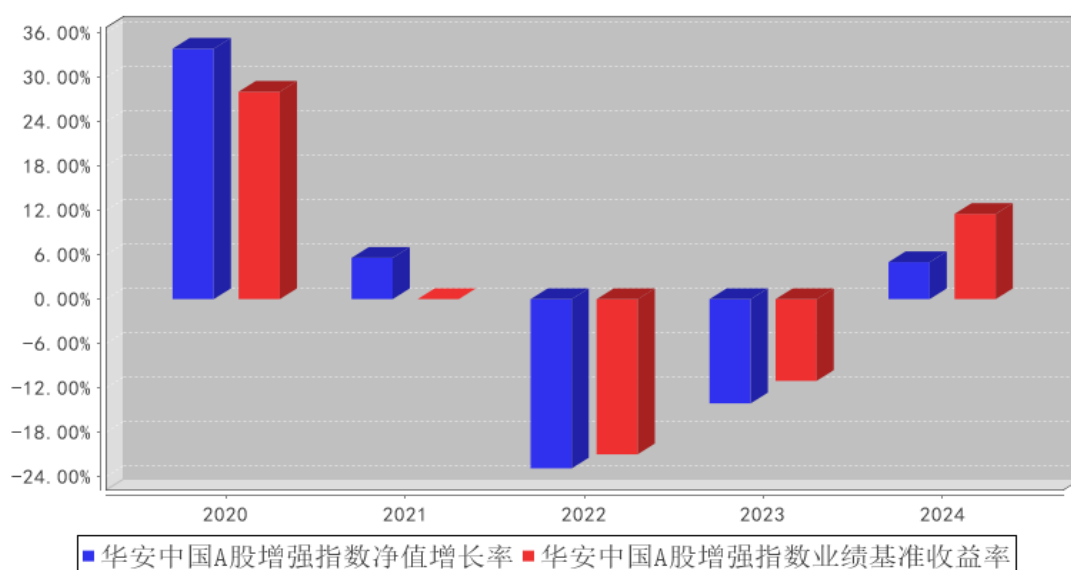
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中国A股增强指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中国A股增强指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 2024 年 12 月 31 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 275 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,931.69 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	首席指数投资官、公司总经理助理、指数与量化投资部高级总监、本基金的基金经理	2017 年 12 月 25 日	-	21 年	理学博士，21 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 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 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）、华安中证银行指数型证券投资基金（由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而

					来)的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金(由华安创业板 50 指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来)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(由华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)转型而来)的基金经理。2019 年 12 月至 2024 年 6 月,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。2020 年 8 月至 2024 年 6 月,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 月至 2024 年 6 月,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。2021 年 10 月至 2023 年 11 月,同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2024 年 6 月,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发起式联接基金的基金经理。2022 年 12 月起,同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 7 月起,同时担任华安深证主板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月起,同时担任华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月至 2024 年 12 月,同时担任华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起,同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(由华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来)的基金经理。2024 年 11 月起,同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
马韬	本基金的基金经理	2018 年 1 月 15 日	-	10 年	硕士研究生,10 年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究

					员。2017 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部数量分析师。2018 年 1 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 2 月，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起，同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安中证 1000 指数增强型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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

2025 年 1 月 4 日，公司发布公告，许之彦先生 2025 年 1 月 6 日起不再担任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
许之彦	公募基金	13	107,918,181,069.22	2009 年 9 月 5 日
	私募资产管理计划	1	72,475,560.80	2023 年 11 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	107,990,656,630.02	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理许之彦先生兼任私募资产管理计划投资经理，其薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

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，由集中交易部对外进行申报。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比例分配原则进行分配。（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。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

在严格执行《基金管理公司公平交易制度指导意见》的基础上，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》，制定了《华安基金管理有限公司基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，进一步完善公司的防范利益冲突机制，健全公平交易控制体系和防范利益冲突的管理措施。

投资研究部负责宏观、策略、行业以及上市公司的研究，研究员在为公司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、投资研究会议讨论、研究报告登录在研究报告管理系统中等方式，确保公募基金基金经理与私募资产管理计划投资经理可以公平享有信息获取机会。

公司实行强制公平交易机制，确保公募基金与私募资产管理计划等各投资组合享有公平的交易执行机会，避免在交易环节出现利益冲突的情况。

同一基金经理同时管理公募基金与私募资产管理计划的情况下，兼任的基金经理保持同一个券（股）投资逻辑与决策、交易过程的一致性与同步性，避免出现风格相似的公募基金与私募资产管理计划在同一年度内业绩偏差较大的情况。

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，并定期对各类投资组合间的同日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合间的隔日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的同向交易价差进行检查与分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。

本报告期内，同一基金经理管理的各投资组合公平交易执行情况良好，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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

宏观方面，2024 年全年顺利实现 5.0% 的经济增长目标，多项经济指标显示宏观经济持续复苏，结构上呈现高质量发展。整体失业率平稳，居民收入稳定增长，制造业景气度提升。企业利润虽略降，但高技术制造业增长迅速。

权益市场在全年表现为先抑后扬，年初小微盘股迅速下跌，并在此之后呈现出一个低位震荡的格局，随后在“9.24”政策组合拳的推动下迎来了一轮“V”型反转，主要投资者的风险偏好迅速提升，开始呈现出行业轮动加速、主题投资活跃等特点。行业层面，科技领衔，相关主题层出不穷；风格层面，中小盘股票活跃度提升明显，相对表现也明显强于前三季度。从市场的成交情况也能看到，全 A 日均成交额稳定在万亿以上。

主流的量化策略在过去这一年面临了两次较大挑战，这在历史上也是较为罕见的。一次是在春节前后小微盘流动性危机导致，另一次是在 9.24 之后市场在短期极致的反弹期间，针对此问题

我们加强了在组合构建及风险控制方面的深入研究，预期在未来能更好的面对危机时刻。本基金在基本配置上仍然兼顾均衡，选择基本面较好且与技术面发生共振的优质股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7381 元，本报告期份额净值增长率为 4.99%，同期业绩比较基准增长率为 11.50%。

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 2025 年，仍然设定了 5%左右的稳定增长目标，维持经济的平稳过渡和持续发展，积极应对外部冲击，加大宏观调控，着眼长期规划，平衡供给需求等将成为政策的主要目标。在此背景下，权益市场仍然会有较强的稳定支撑力量，随时市场风险偏好的提升，市场交易活跃度的增强，我们对资本市场保持着长期乐观的态度。

作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作。

公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程合规与风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。通过持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

公司定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平有效提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，不断提高合规与风险管理水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配每年至少一次；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

本基金本报告期不满足强制分红条件，不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净

值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501490 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错

	报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排

	和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	虞京京	朱伊俐
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	60,380,909.05	59,194,773.80
结算备付金		9,920,381.26	5,174,344.83
存出保证金		340,342.98	119,320.18
交易性金融资产	7.4.7.2	1,006,510,265.58	935,925,635.53
其中：股票投资		1,006,509,508.38	935,925,635.53
基金投资		—	—
债券投资		757.20	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		665,235.90	8,800,515.56
应收股利		—	—
应收申购款		136,217.35	233,044.63
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		1,077,953,352.12	1,009,447,634.53
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,386,561.42	6,823,094.76
应付赎回款		2,356,092.38	776,535.33
应付管理人报酬		917,533.21	841,203.40
应付托管费		183,506.65	168,240.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	3,219,479.04	5,507,277.34
负债合计		8,063,172.70	14,116,351.52
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	441,725,024.49	431,377,397.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	628,165,154.93	563,953,885.29
净资产合计		1,069,890,179.42	995,331,283.01
负债和净资产总计		1,077,953,352.12	1,009,447,634.53

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7381 元，基金份额总额 1,449,592,847.71 份。

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		58,429,271.70	-149,213,193.04
1. 利息收入		319,814.43	272,739.99
其中：存款利息收入	7.4.7.9	319,814.43	272,739.99
债券利息收入		-	-
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）		-18,940,516.50	-173,316,758.98

其中：股票投资收益	7.4.7.10	-43,119,573.71	-193,352,736.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	31,108.61	169,843.16
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	24,147,948.60	19,866,134.33
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.14	77,023,773.75	23,820,935.62
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.15	26,200.02	9,890.33
减：二、营业总支出		11,769,064.09	13,764,357.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,650,406.14	11,271,602.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,930,081.27	2,254,320.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	1.29
8. 其他费用	7.4.7.17	188,576.68	238,433.48
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		46,660,207.61	-162,977,550.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		46,660,207.61	-162,977,550.49
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		46,660,207.61	-162,977,550.49

7.3 净资产变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	10,347,626.77	-	64,211,269.64	74,558,896.41
(一)、综合收益总额	-	-	46,660,207.61	46,660,207.61
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	10,347,626.77	-	17,551,062.03	27,898,688.80
其中：1. 基金申购款	103,099,677.60	-	141,061,829.61	244,161,507.21
2. 基金赎回款	-92,752,050.83	-	- 123,510,767.58	-216,262,818.41
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	441,725,024.49	-	628,165,154.93	1,069,890,179.42
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.4

				9
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,200,082.98	-	-173,804,951.50	-180,005,034.48
(一)、综合收益总额	-	-	-162,977,550.49	-162,977,550.49
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-6,200,082.98	-	-10,827,401.01	-17,027,483.99
其中：1. 基金申购款	51,214,696.83	-	81,428,499.35	132,643,196.18
2. 基金赎回款	-57,414,779.81	-	-92,255,900.36	-149,670,680.17
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>朱学华</u>	<u>朱学华</u>	<u>陈松一</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金,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[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准,由基金管理人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起,并于 2002 年 11 月 8 日募集成立。本基金为契约型开放式,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 3,094,001,258.61 元。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》,并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金,跟踪标的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 3.281806547,并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金资产主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)。

本基金的投资组合比例为:投资于股票(含存托凭证)的目标比例为基金资产净值的 95%,投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%;此外,本基金可参与股票(含存托凭证)一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股,在成份股之外的股票(含存托凭证)投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股指数收益率 $\times$ 95%+金融同业存款利率 $\times$ 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项

金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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）”。

7.4.4.9 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率

计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益以现金形式分配，但投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。如果投资者没有明示选择收益分配方式，则视为选择现金方式；

基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可不分配；

基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

每一基金份额享有同等分配权；

在权益登记日，如投资者的基金账户或基金份额处于冻结状态或者托管转出尚未转入时，其相对应的现金红利自动转购基金份额；

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施

全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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》、财税[2017]2 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	60,380,909.05	59,194,773.80
等于：本金	60,374,794.88	59,189,095.67
加：应计利息	6,114.17	5,678.13
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	60,380,909.05	59,194,773.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		991,294,793.26	-	1,006,509,508.38	15,214,715.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	600.00	0.12	757.20	157.08
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	600.00	0.12	757.20	157.08
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		991,295,393.26	0.12	1,006,510,265.58	15,214,872.20
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		997,734,537.08	-	935,925,635.53	-61,808,901.55
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		997,734,537.08	-	935,925,635.53	-61,808,901.55

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,549,479.04	4,787,277.34
其中：交易所市场	2,547,047.85	4,784,846.15
银行间市场	2,431.19	2,431.19
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	100,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	3,219,479.04	5,507,277.34

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,415,635,151.49	431,377,397.72
本期申购	338,337,105.43	103,099,677.60
本期赎回（以“-”号填列）	-304,379,409.21	-92,752,050.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,449,592,847.71	441,725,024.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	700,070,341.70	-136,116,456.41	563,953,885.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	700,070,341.70	-136,116,456.41	563,953,885.29
本期利润	-30,363,566.14	77,023,773.75	46,660,207.61
本期基金份额交易产生的变动数	17,647,149.97	-96,087.94	17,551,062.03

其中：基金申购款	151,463,822.64	-10,401,993.03	141,061,829.61
基金赎回款	-133,816,672.67	10,305,905.09	-123,510,767.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	687,353,925.53	-59,188,770.60	628,165,154.93

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	216,486.09	231,111.53
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	99,721.96	38,834.99
其他	3,606.38	2,793.47
合计	319,814.43	272,739.99

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-43,119,573.71	-193,352,736.47
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	-43,119,573.71	-193,352,736.47

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	10,457,375,631.04	4,323,903,387.35

减：卖出股票成本总额	10,483,911,929.57	4,505,248,939.62
减：交易费用	16,583,275.18	12,007,184.20
买卖股票差价收入	-43,119,573.71	-193,352,736.47

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	3.31	18,547.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	31,105.30	151,295.25
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	31,108.61	169,843.16

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,110.81	27,228,722.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,000.00	26,544,243.95
减：应计利息总额	3.19	533,114.92
减：交易费用	2.32	68.48
买卖债券差价收入	31,105.30	151,295.25

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	24,147,948.60	19,866,134.33
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	24,147,948.60	19,866,134.33

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	77,023,773.75	23,820,935.62
股票投资	77,023,616.67	23,768,652.87
债券投资	157.08	52,282.75
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	77,023,773.75	23,820,935.62

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	23,480.01	7,550.32
基金转换费收入	2,720.01	2,340.01
合计	26,200.02	9,890.33

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	576.68	433.48
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	188,576.68	238,433.48

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	6,676,361,983.48	31.90	3,586,580,678.49	41.64

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	-	-	1,433,077.60	54.38

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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	3,644,509.55	36.40	697,567.51	27.39
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	3,359,772.10	41.80	1,540,504.41	32.20

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均

在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,650,406.14	11,271,602.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,896,459.46	3,333,773.14
应支付基金管理人的净管理费	6,753,946.68	7,937,829.06

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：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,930,081.27	2,254,320.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	60,380,909.05	216,486.09	59,194,773.80	231,111.53

7.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	11,803	191,208.60
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安证券股份有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12

国泰君安证券股份有限公司	301607	富特科技	网下申购	2,567	35,938.00
国泰君安证券股份有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安证券股份有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
国泰君安证券股份有限公司	301571	国科天成	网下申购	3,499	38,978.86
国泰君安证券股份有限公司	301556	托普云农	网下申购	2,663	38,613.50
国泰君安证券股份有限公司	127107	领益转债	老股东配售	6	600.00
国泰君安证券股份有限公司	603194	中力股份	网下申购	2,904	59,009.28
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	601916	浙商银行	老股东配售	30	60.60
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	4,061	154,155.56
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688347	华虹公司	网下申购	39,887	2,074,124.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	9,813	274,764.00
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15

国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	12,630	142,087.50
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	1-6 个月（含）	新股限售	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	1-6 个月（含）	新股限售	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	1-6 个月（含）	新股限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	1-6 个月（含）	新股限售	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	1-6 个月（含）	新股限售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	1-6 个月（含）	新股限售	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝	2024	1-6 个	新股	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-

	宇股份	年 12 月 10 日	月 (含)	限售						
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	1-6 个月 (含)	新股限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	1-6 个月 (含)	新股限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	1-6 个月 (含)	新股限售	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	1-6 个月 (含)	新股限售	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	1-6 个月 (含)	新股限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	1-6 个月 (含)	新股限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	1-6 个月 (含)	新股限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	1-6 个月 (含)	新股限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	新股限售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众	2024	1-6 个	新股	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-

	鑫股份	年 9 月 10 日	月 (含)	限售						
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	1-6 个月 (含)	新股限售	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	1-6 个月 (含)	新股限售	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	1-6 个月 (含)	新股限售	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1-6 个月 (含)	新股限售	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	1-6 个月 (含)	新股限售	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1-6 个月 (含)	新股限售	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	1-6 个月 (含)	新股限售	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	1-6 个月 (含)	新股限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	1-6 个月 (含)	新股限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	1-6 个月 (含)	新股限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙	2024	1-6 个	新股	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

	图光罩	年 7 月 30 日	月（含）	限售						
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	1-6 个月（含）	新股限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	1-6 个月（含）	新股限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	456,400	3,447,457.68	3,295,208.00	-
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事项停牌	0.01	-	-	100	297.00	1.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指

数化投资组合。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，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合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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。

7.4.13.2 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同责任，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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

7.4.13.3 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，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,380,909.05	-	-	-	60,380,909.05
结算备付金	9,920,381.26	-	-	-	9,920,381.26
存出保证金	340,342.98	-	-	-	340,342.98
交易性金融资产	757.20	-	-	1,006,509,508.38	1,006,510,265.58
应收申购款	-	-	-	136,217.35	136,217.35
应收清算款	-	-	-	665,235.90	665,235.90
资产总计	70,642,390.49	-	-	1,007,310,961.63	1,077,953,352.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,356,092.38	2,356,092.38
应付管理人报酬	-	-	-	917,533.21	917,533.21
应付托管费	-	-	-	183,506.65	183,506.65
应付清算款	-	-	-	1,386,561.42	1,386,561.42
其他负债	-	-	-	3,219,479.04	3,219,479.04

负债总计	-	-	-	8,063,172.70	8,063,172.70
利率敏感度缺口	70,642,390.49	-	-	-999,247,788.93	1,069,890,179.42
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	59,194,773.80	-	-	-	59,194,773.80
结算备付金	5,174,344.83	-	-	-	5,174,344.83
存出保证金	119,320.18	-	-	-	119,320.18
交易性金融资产	-	-	-	935,925,635.53	935,925,635.53
应收申购款	-	-	-	233,044.63	233,044.63
应收清算款	-	-	-	8,800,515.56	8,800,515.56
资产总计	64,488,438.81	-	-	944,959,195.72	1,009,447,634.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	776,535.33	776,535.33
应付管理人报酬	-	-	-	841,203.40	841,203.40
应付托管费	-	-	-	168,240.69	168,240.69
应付清算款	-	-	-	6,823,094.76	6,823,094.76
其他负债	-	-	-	5,507,277.34	5,507,277.34
负债总计	-	-	-	14,116,351.52	14,116,351.52
利率敏感度缺口	64,488,438.81	-	-	-930,842,844.20	995,331,283.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 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 0.00007% (2023 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。在多因子量

化增强模型和风险监控模型分析的基础上，根据预期收益、风险预算和交易成本的水平，采用成熟的优化软件对股票投资组合进行优化。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。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)，投资组合中股票(含存托凭证)投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券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。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，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	1,006,509,508.38	94.08	935,925,635.53	94.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	757.20	0.00	—	—
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	1,006,510,265.58	94.08	935,925,635.53	94.03

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31	上年度末（2023 年 12 月

		日)	31 日)
	业绩比较基准上升 5%	53,053,968.91	51,442,476.02
	业绩比较基准下降 5%	-53,053,968.91	-51,442,476.02

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,002,697,997.72	933,963,610.40
第二层次	3,322,945.50	-
第三层次	489,322.36	1,962,025.13
合计	1,006,510,265.58	935,925,635.53

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。
--

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,962,025.13	1,962,025.13
当期购买	-	446,263.13	446,263.13
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,090,361.75	2,090,361.75
当期利得或损失总额	-	171,395.85	171,395.85
其中：计入损益的利得或损失	-	171,395.85	171,395.85
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	489,322.36	489,322.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	299,096.52	299,096.52
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,095,915.92	1,095,915.92
当期购买	-	3,636,396.11	3,636,396.11
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1.00	1.00
转出第三层次	-	8,600,728.71	8,600,728.71
当期利得或损失总额	-	5,830,440.81	5,830,440.81
其中：计入损益的利得或损失	-	5,830,440.81	5,830,440.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,962,025.13	1,962,025.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-208,942.96	-208,942.96

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	3,784,531.36	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,962,024.13	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	14.62%-217.75%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,006,509,508.38	93.37
	其中：股票	1,006,509,508.38	93.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	757.20	0.00
	其中：债券	757.20	0.00
	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	70,301,290.31	6.52
8	其他各项资产	1,141,796.23	0.11
9	合计	1,077,953,352.12	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	9,534,901.00	0.89
B	采矿业	43,561,870.69	4.07
C	制造业	489,546,477.63	45.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,580,663.12	4.45
E	建筑业	25,173,772.00	2.35
F	批发和零售业	5,342,354.22	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	36,853,497.69	3.44
H	住宿和餐饮业	1,520,276.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,178,457.06	3.38
J	金融业	227,201,511.14	21.24
K	房地产业	5,212,205.38	0.49
L	租赁和商务服务业	9,336,112.70	0.87
M	科学研究和技术服务业	6,639,758.04	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	1,322,220.27	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	1,881,207.80	0.18
R	文化、体育和娱乐业	3,287,644.04	0.31
S	综合	7,903.00	—
	合计	950,180,831.78	88.81

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	757,533.00	0.07
B	采矿业	6,159,949.00	0.58
C	制造业	23,071,441.05	2.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,881,205.60	0.74
E	建筑业	1,794,872.00	0.17
F	批发和零售业	2,808,198.38	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	4,482,495.80	0.42
H	住宿和餐饮业	1,016,631.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	648,993.57	0.06
J	金融业	2,970,846.64	0.28
K	房地产业	15,777.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,533,840.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	2,020,224.67	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	43,516.00	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	86,436.89	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,036,716.00	0.10
S	综合	—	—
	合计	56,328,676.60	5.26

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

8.3.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	24,733	37,693,092.00	3.52
2	300750	宁德时代	115,012	30,593,192.00	2.86
3	600036	招商银行	590,900	23,222,370.00	2.17
4	601318	中国平安	436,634	22,988,780.10	2.15
5	000333	美的集团	223,785	16,833,107.70	1.57
6	300059	东方财富	572,098	14,771,570.36	1.38
7	600900	长江电力	487,550	14,407,102.50	1.35
8	601166	兴业银行	724,100	13,873,756.00	1.30
9	600030	中信证券	431,433	12,584,900.61	1.18
10	000858	五粮液	81,944	11,475,437.76	1.07
11	002594	比亚迪	36,600	10,345,356.00	0.97
12	000651	格力电器	220,800	10,035,360.00	0.94
13	600887	伊利股份	327,100	9,871,878.00	0.92
14	600000	浦发银行	909,300	9,356,697.00	0.87
15	601899	紫金矿业	599,683	9,067,206.96	0.85
16	601288	农业银行	1,572,000	8,394,480.00	0.78
17	000725	京东方 A	1,893,700	8,313,343.00	0.78
18	601328	交通银行	1,051,150	8,167,435.50	0.76
19	601398	工商银行	1,171,400	8,106,088.00	0.76
20	002475	立讯精密	187,032	7,623,424.32	0.71
21	688981	中芯国际	80,019	7,571,397.78	0.71
22	600276	恒瑞医药	152,660	7,007,094.00	0.65
23	601816	京沪高铁	1,016,700	6,262,872.00	0.59
24	000776	广发证券	370,845	6,011,397.45	0.56
25	000001	平安银行	505,396	5,913,133.20	0.55
26	601766	中国中车	702,840	5,889,799.20	0.55
27	300760	迈瑞医疗	22,988	5,861,940.00	0.55
28	688256	寒武纪	8,686	5,715,388.00	0.53
29	601169	北京银行	903,075	5,553,911.25	0.52
30	601668	中国建筑	916,540	5,499,240.00	0.51
31	600660	福耀玻璃	88,000	5,491,200.00	0.51
32	000063	中兴通讯	134,900	5,449,960.00	0.51
33	600919	江苏银行	551,200	5,412,784.00	0.51
34	688041	海光信息	32,729	4,902,476.91	0.46
35	600028	中国石化	730,300	4,878,404.00	0.46
36	601919	中远海控	314,000	4,867,000.00	0.45
37	603259	药明康德	87,557	4,819,137.28	0.45
38	601818	光大银行	1,243,300	4,811,571.00	0.45

39	601006	大秦铁路	704,300	4,775,154.00	0.45
40	600690	海尔智家	166,420	4,737,977.40	0.44
41	600309	万华化学	65,420	4,667,717.00	0.44
42	601088	中国神华	107,300	4,665,404.00	0.44
43	002027	分众传媒	653,700	4,595,511.00	0.43
44	601939	建设银行	506,600	4,453,014.00	0.42
45	300308	中际旭创	35,889	4,432,650.39	0.41
46	002714	牧原股份	112,600	4,328,344.00	0.40
47	601988	中国银行	782,620	4,312,236.20	0.40
48	601728	中国电信	589,100	4,253,302.00	0.40
49	002371	北方华创	10,700	4,183,700.00	0.39
50	300274	阳光电源	55,560	4,101,994.80	0.38
51	601857	中国石油	458,300	4,097,202.00	0.38
52	002352	顺丰控股	100,900	4,066,270.00	0.38
53	600941	中国移动	34,400	4,064,704.00	0.38
54	603288	海天味业	87,908	4,034,977.20	0.38
55	600938	中国海油	133,900	3,951,389.00	0.37
56	002415	海康威视	128,600	3,948,020.00	0.37
57	600016	民生银行	951,100	3,928,043.00	0.37
58	600406	国电南瑞	155,264	3,915,758.08	0.37
59	601127	赛力斯	29,300	3,908,327.00	0.37
60	601658	邮储银行	671,900	3,816,392.00	0.36
61	601229	上海银行	411,400	3,764,310.00	0.35
62	300124	汇川技术	63,700	3,731,546.00	0.35
63	601138	工业富联	170,300	3,661,450.00	0.34
64	601601	中国太保	107,000	3,646,560.00	0.34
65	002001	新 和 成	161,400	3,545,958.00	0.33
66	600031	三一重工	212,700	3,505,296.00	0.33
67	000538	云南白药	55,820	3,346,409.00	0.31
68	601669	中国电建	609,100	3,325,686.00	0.31
69	600019	宝钢股份	475,000	3,325,000.00	0.31
70	000100	TCL 科技	655,614	3,297,738.42	0.31
71	002252	上海莱士	456,400	3,295,208.00	0.31
72	601012	隆基绿能	208,291	3,272,251.61	0.31
73	002230	科大讯飞	67,300	3,251,936.00	0.30
74	000568	泸州老窖	25,900	3,242,680.00	0.30
75	601225	陕西煤业	137,600	3,200,576.00	0.30
76	603986	兆易创新	29,900	3,193,320.00	0.30
77	603019	中科曙光	44,000	3,182,080.00	0.30
78	688012	中微公司	16,704	3,159,728.64	0.30
79	600009	上海机场	92,500	3,158,875.00	0.30
80	000895	双汇发展	121,400	3,151,544.00	0.29
81	601916	浙商银行	1,078,330	3,137,940.30	0.29

82	300502	新易盛	26,800	3,097,544.00	0.29
83	600050	中国联通	581,400	3,087,234.00	0.29
84	600346	恒力石化	200,880	3,083,508.00	0.29
85	600150	中国船舶	84,300	3,031,428.00	0.28
86	600809	山西汾酒	16,200	2,984,202.00	0.28
87	601390	中国中铁	466,000	2,977,740.00	0.28
88	002463	沪电股份	74,610	2,958,286.50	0.28
89	300498	温氏股份	176,100	2,907,411.00	0.27
90	601688	华泰证券	164,624	2,895,736.16	0.27
91	601377	兴业证券	458,280	2,868,832.80	0.27
92	603501	韦尔股份	26,600	2,777,306.00	0.26
93	688009	中国通号	441,788	2,765,592.88	0.26
94	300408	三环集团	71,100	2,738,061.00	0.26
95	002966	苏州银行	337,020	2,733,232.20	0.26
96	601985	中国核电	260,800	2,720,144.00	0.25
97	002142	宁波银行	109,810	2,669,481.10	0.25
98	600642	申能股份	276,000	2,619,240.00	0.24
99	600352	浙江龙盛	252,300	2,596,167.00	0.24
100	600008	首创环保	789,500	2,589,560.00	0.24
101	601868	中国能建	1,129,200	2,585,868.00	0.24
102	002007	华兰生物	151,300	2,549,405.00	0.24
103	600018	上港集团	413,400	2,530,008.00	0.24
104	601888	中国中免	37,470	2,510,864.70	0.23
105	002595	豪迈科技	49,240	2,471,355.60	0.23
106	600282	南钢股份	525,300	2,463,657.00	0.23
107	600905	三峡能源	543,300	2,374,221.00	0.22
108	601997	贵阳银行	394,000	2,364,000.00	0.22
109	601186	中国铁建	257,600	2,362,192.00	0.22
110	601991	大唐发电	825,000	2,351,250.00	0.22
111	600219	南山铝业	599,100	2,342,481.00	0.22
112	600111	北方稀土	108,500	2,302,370.00	0.22
113	002028	思源电气	31,600	2,297,320.00	0.21
114	000166	申万宏源	426,327	2,280,849.45	0.21
115	002916	深南电路	18,200	2,275,000.00	0.21
116	600737	中粮糖业	222,100	2,267,641.00	0.21
117	000157	中联重科	310,400	2,244,192.00	0.21
118	600820	隧道股份	311,600	2,240,404.00	0.21
119	000338	潍柴动力	163,367	2,238,127.90	0.21
120	600968	海油发展	522,200	2,229,794.00	0.21
121	600183	生益科技	92,100	2,215,005.00	0.21
122	601866	中远海发	848,600	2,214,846.00	0.21
123	600196	复星医药	89,054	2,212,991.90	0.21
124	600999	招商证券	113,800	2,180,408.00	0.20

125	001965	招商公路	155,347	2,167,090.65	0.20
126	601989	中国重工	446,700	2,148,627.00	0.20
127	600438	通威股份	96,000	2,122,560.00	0.20
128	603799	华友钴业	72,300	2,115,498.00	0.20
129	000425	徐工机械	266,600	2,114,138.00	0.20
130	601000	唐山港	441,852	2,081,122.92	0.19
131	300144	宋城演艺	223,400	2,075,386.00	0.19
132	000598	兴蓉环境	272,218	2,066,134.62	0.19
133	688111	金山办公	7,180	2,056,280.20	0.19
134	600066	宇通客车	77,500	2,044,450.00	0.19
135	688008	澜起科技	29,969	2,034,895.10	0.19
136	600863	内蒙华电	468,200	2,027,306.00	0.19
137	600048	保利发展	226,200	2,004,132.00	0.19
138	600109	国金证券	229,000	1,999,170.00	0.19
139	600021	上海电力	216,800	1,988,056.00	0.19
140	600380	健康元	174,500	1,966,615.00	0.18
141	600704	物产中大	387,900	1,962,774.00	0.18
142	000513	丽珠集团	51,400	1,953,200.00	0.18
143	002241	歌尔股份	75,600	1,951,236.00	0.18
144	002625	光启技术	40,800	1,950,240.00	0.18
145	600926	杭州银行	130,600	1,908,066.00	0.18
146	600886	国投电力	114,800	1,907,976.00	0.18
147	600023	浙能电力	330,800	1,872,328.00	0.18
148	300015	爱尔眼科	141,100	1,869,575.00	0.17
149	000625	长安汽车	138,600	1,851,696.00	0.17
150	300014	亿纬锂能	39,500	1,846,230.00	0.17
151	600918	中泰证券	280,100	1,840,257.00	0.17
152	002236	大华股份	115,010	1,840,160.00	0.17
153	600160	巨化股份	76,200	1,837,944.00	0.17
154	600096	云天化	81,300	1,812,990.00	0.17
155	600989	宝丰能源	107,600	1,811,984.00	0.17
156	002273	水晶光电	81,000	1,799,820.00	0.17
157	601600	中国铝业	241,800	1,777,230.00	0.17
158	300033	同花顺	6,100	1,753,750.00	0.16
159	601009	南京银行	163,724	1,743,660.60	0.16
160	002340	格林美	266,400	1,739,592.00	0.16
161	600298	安琪酵母	48,220	1,738,331.00	0.16
162	600089	特变电工	135,520	1,726,524.80	0.16
163	600027	华电国际	307,300	1,723,953.00	0.16
164	601117	中国化学	207,400	1,719,346.00	0.16
165	600436	片仔癀	8,000	1,716,000.00	0.16
166	600418	江淮汽车	45,500	1,706,250.00	0.16
167	002422	科伦药业	56,700	1,697,031.00	0.16

168	601618	中国中冶	504,000	1,663,200.00	0.16
169	000729	燕京啤酒	137,900	1,660,316.00	0.16
170	600584	长电科技	40,600	1,658,916.00	0.16
171	600795	国电电力	356,900	1,634,602.00	0.15
172	000830	鲁西化工	139,600	1,631,924.00	0.15
173	600177	雅戈尔	182,490	1,624,161.00	0.15
174	600025	华能水电	170,300	1,619,553.00	0.15
175	600004	白云机场	168,700	1,619,520.00	0.15
176	600332	白云山	56,200	1,597,204.00	0.15
177	000977	浪潮信息	30,590	1,587,009.20	0.15
178	000423	东阿阿胶	24,900	1,561,728.00	0.15
179	601666	平煤股份	154,200	1,545,084.00	0.14
180	600803	新奥股份	70,800	1,534,944.00	0.14
181	600583	海油工程	279,200	1,527,224.00	0.14
182	600754	锦江酒店	56,600	1,520,276.00	0.14
183	002984	森麒麟	61,400	1,514,124.00	0.14
184	600153	建发股份	143,500	1,509,620.00	0.14
185	600585	海螺水泥	62,900	1,495,762.00	0.14
186	601319	中国人保	195,900	1,492,758.00	0.14
187	002444	巨星科技	45,700	1,478,395.00	0.14
188	600893	航发动力	35,566	1,474,210.70	0.14
189	600372	中航机载	119,145	1,469,057.85	0.14
190	688396	华润微	31,059	1,465,674.21	0.14
191	601995	中金公司	43,500	1,465,515.00	0.14
192	600141	兴发集团	67,500	1,464,750.00	0.14
193	600637	东方明珠	188,700	1,464,312.00	0.14
194	603993	洛阳钼业	219,300	1,458,345.00	0.14
195	000738	航发控制	65,500	1,456,720.00	0.14
196	600535	天士力	99,300	1,435,878.00	0.13
197	002311	海大集团	29,200	1,432,260.00	0.13
198	000027	深圳能源	220,600	1,429,488.00	0.13
199	601066	中信建投	55,400	1,426,550.00	0.13
200	600132	重庆啤酒	22,500	1,417,950.00	0.13
201	600039	四川路桥	194,300	1,414,504.00	0.13
202	600426	华鲁恒升	65,400	1,413,294.00	0.13
203	603260	合盛硅业	25,300	1,405,668.00	0.13
204	000002	万科 A	193,213	1,402,726.38	0.13
205	002831	裕同科技	51,700	1,401,070.00	0.13
206	002050	三花智控	59,500	1,398,845.00	0.13
207	601577	长沙银行	157,100	1,396,619.00	0.13
208	000938	紫光股份	49,800	1,385,934.00	0.13
209	601800	中国交建	131,700	1,376,265.00	0.13
210	603160	汇顶科技	16,900	1,361,126.00	0.13

211	002128	电投能源	69,100	1,352,978.00	0.13
212	601717	郑煤机	104,200	1,352,516.00	0.13
213	000932	华菱钢铁	316,600	1,323,388.00	0.12
214	603568	伟明环保	61,129	1,322,220.27	0.12
215	002304	洋河股份	15,600	1,303,068.00	0.12
216	600598	北大荒	87,800	1,295,050.00	0.12
217	601021	春秋航空	22,200	1,280,274.00	0.12
218	003816	中国广核	307,900	1,271,627.00	0.12
219	601108	财通证券	152,200	1,243,474.00	0.12
220	000825	太钢不锈	356,100	1,239,228.00	0.12
221	601877	正泰电器	52,600	1,231,366.00	0.12
222	601838	成都银行	70,700	1,209,677.00	0.11
223	603658	安图生物	27,330	1,192,681.20	0.11
224	605117	德业股份	14,000	1,187,200.00	0.11
225	688036	传音控股	12,348	1,173,060.00	0.11
226	600015	华夏银行	146,440	1,172,984.40	0.11
227	600760	中航沈飞	23,000	1,166,560.00	0.11
228	300759	康龙化成	45,000	1,156,500.00	0.11
229	002179	中航光电	29,378	1,154,555.40	0.11
230	000999	华润三九	25,900	1,148,406.00	0.11
231	603816	顾家家居	41,400	1,141,812.00	0.11
232	600570	恒生电子	40,401	1,130,823.99	0.11
233	600745	闻泰科技	29,150	1,130,437.00	0.11
234	600958	东方证券	106,292	1,122,443.52	0.10
235	600104	上汽集团	54,000	1,121,040.00	0.10
236	300476	胜宏科技	26,600	1,119,594.00	0.10
237	000703	恒逸石化	178,000	1,117,840.00	0.10
238	000661	长春高新	11,200	1,113,728.00	0.10
239	601233	桐昆股份	93,800	1,106,840.00	0.10
240	601555	东吴证券	137,860	1,075,308.00	0.10
241	600582	天地科技	172,500	1,066,050.00	0.10
242	601881	中国银河	69,600	1,060,008.00	0.10
243	002049	紫光国微	16,400	1,055,668.00	0.10
244	600486	扬农化工	18,095	1,047,157.65	0.10
245	000629	钒钛股份	359,400	1,035,072.00	0.10
246	603156	养元饮品	45,298	1,034,606.32	0.10
247	002532	天山铝业	130,300	1,025,461.00	0.10
248	300433	蓝思科技	46,600	1,020,540.00	0.10
249	002202	金风科技	98,000	1,012,340.00	0.09
250	601179	中国西电	133,300	1,011,747.00	0.09
251	300628	亿联网络	26,080	1,006,688.00	0.09
252	601118	海南橡胶	185,600	1,004,096.00	0.09
253	600699	均胜电子	63,800	999,746.00	0.09

254	300413	芒果超媒	36,200	973,418.00	0.09
255	000723	美锦能源	215,400	971,454.00	0.09
256	600839	四川长虹	99,300	958,245.00	0.09
257	002555	三七互娱	61,200	957,168.00	0.09
258	300832	新产业	13,500	956,475.00	0.09
259	000050	深天马 A	105,700	954,471.00	0.09
260	002493	荣盛石化	104,250	943,462.50	0.09
261	600546	山煤国际	78,800	932,204.00	0.09
262	601928	凤凰传媒	80,400	927,816.00	0.09
263	600511	国药股份	26,800	917,096.00	0.09
264	603290	斯达半导	10,200	916,164.00	0.09
265	002384	东山精密	31,288	913,609.60	0.09
266	000786	北新建材	30,000	909,300.00	0.08
267	002460	赣锋锂业	25,540	894,155.40	0.08
268	000783	长江证券	129,400	882,508.00	0.08
269	000768	中航西飞	30,800	869,792.00	0.08
270	002353	杰瑞股份	23,419	866,268.81	0.08
271	600161	天坛生物	41,920	859,360.00	0.08
272	688271	联影医疗	6,702	847,132.80	0.08
273	601628	中国人寿	19,800	830,016.00	0.08
274	002466	天齐锂业	25,000	825,000.00	0.08
275	600085	同仁堂	20,300	823,977.00	0.08
276	600398	海澜之家	109,800	823,500.00	0.08
277	000009	中国宝安	88,504	809,811.60	0.08
278	000807	云铝股份	59,500	805,035.00	0.08
279	601966	玲珑轮胎	44,600	804,584.00	0.08
280	601360	三六零	77,300	800,055.00	0.07
281	600079	人福医药	33,700	787,906.00	0.07
282	000683	远兴能源	137,100	766,389.00	0.07
283	600547	山东黄金	33,700	762,631.00	0.07
284	600600	青岛啤酒	9,400	760,648.00	0.07
285	601162	天风证券	169,300	758,464.00	0.07
286	002008	大族激光	30,300	757,500.00	0.07
287	000831	中国稀土	26,800	751,740.00	0.07
288	600837	海通证券	67,200	747,264.00	0.07
289	688223	晶科能源	105,074	747,076.14	0.07
290	600655	豫园股份	115,000	739,450.00	0.07
291	600741	华域汽车	41,500	730,815.00	0.07
292	601689	拓普集团	14,900	730,100.00	0.07
293	300418	昆仑万维	18,900	727,272.00	0.07
294	001979	招商蛇口	71,000	727,040.00	0.07
295	600415	小商品城	53,700	720,117.00	0.07
296	603087	甘李药业	15,800	696,780.00	0.07

297	600487	亨通光电	39,800	685,356.00	0.06
298	601788	光大证券	37,600	680,936.00	0.06
299	002797	第一创业	81,100	677,185.00	0.06
300	002064	华峰化学	82,714	676,600.52	0.06
301	002939	长城证券	81,600	669,120.00	0.06
302	601128	常熟银行	88,040	666,462.80	0.06
303	601901	方正证券	80,000	666,400.00	0.06
304	600566	济川药业	22,800	663,024.00	0.06
305	601016	节能风电	207,800	658,726.00	0.06
306	002372	伟星新材	52,000	656,760.00	0.06
307	601958	金钼股份	65,000	653,900.00	0.06
308	002648	卫星化学	34,700	652,013.00	0.06
309	603369	今世缘	14,400	651,312.00	0.06
310	000039	中集集团	83,050	645,298.50	0.06
311	601111	中国国航	79,932	632,262.12	0.06
312	600515	海南机场	167,200	632,016.00	0.06
313	601607	上海医药	29,450	618,450.00	0.06
314	000708	中信特钢	53,900	614,999.00	0.06
315	605499	东鹏饮料	2,460	611,359.20	0.06
316	601336	新华保险	12,300	611,310.00	0.06
317	600873	梅花生物	60,800	609,824.00	0.06
318	688114	华大智造	12,815	599,613.85	0.06
319	002223	鱼跃医疗	16,400	598,436.00	0.06
320	300394	天孚通信	6,520	595,667.20	0.06
321	300347	泰格医药	10,900	595,358.00	0.06
322	300207	欣旺达	26,600	593,446.00	0.06
323	000988	华工科技	13,400	580,220.00	0.05
324	301236	软通动力	9,800	575,358.00	0.05
325	002281	光迅科技	11,000	573,870.00	0.05
326	000975	山金国际	36,700	564,079.00	0.05
327	601696	中银证券	50,100	559,116.00	0.05
328	000519	中兵红箭	38,400	554,880.00	0.05
329	600369	西南证券	117,900	550,593.00	0.05
330	600674	川投能源	31,700	546,825.00	0.05
331	601231	环旭电子	32,139	530,293.50	0.05
332	002156	通富微电	17,900	528,945.00	0.05
333	601001	晋控煤业	38,400	524,928.00	0.05
334	600489	中金黄金	42,716	513,873.48	0.05
335	688777	中控技术	10,336	513,389.12	0.05
336	002120	韵达股份	67,300	506,096.00	0.05
337	600521	华海药业	28,200	503,934.00	0.05
338	603195	公牛集团	7,143	501,724.32	0.05
339	000066	中国长城	34,300	499,751.00	0.05

340	300122	智飞生物	18,750	493,125.00	0.05
341	603392	万泰生物	6,920	487,583.20	0.05
342	002429	兆驰股份	83,100	480,318.00	0.04
343	601933	永辉超市	75,200	476,768.00	0.04
344	002185	华天科技	40,559	470,889.99	0.04
345	688180	君实生物	16,870	461,057.10	0.04
346	601615	明阳智能	36,400	459,004.00	0.04
347	600118	中国卫星	16,800	458,640.00	0.04
348	688538	和辉光电	195,714	454,056.48	0.04
349	600460	士兰微	17,100	444,942.00	0.04
350	603000	人民网	19,500	429,780.00	0.04
351	002129	TCL 中环	48,250	427,977.50	0.04
352	600062	华润双鹤	21,480	425,304.00	0.04
353	600536	中国软件	9,008	420,583.52	0.04
354	300782	卓胜微	4,611	413,606.70	0.04
355	300661	圣邦股份	5,054	413,316.12	0.04
356	300496	中科创达	6,500	387,140.00	0.04
357	002262	恩华药业	15,600	379,860.00	0.04
358	300487	蓝晓科技	7,900	378,173.00	0.04
359	600390	五矿资本	58,560	377,712.00	0.04
360	000983	山西焦煤	45,500	374,920.00	0.04
361	600348	华阳股份	52,800	374,352.00	0.03
362	002508	老板电器	17,400	372,882.00	0.03
363	002938	鹏鼎控股	10,100	368,448.00	0.03
364	601099	太平洋	85,900	365,934.00	0.03
365	688169	石头科技	1,663	364,679.27	0.03
366	002414	高德红外	47,755	354,819.65	0.03
367	300017	网宿科技	32,800	346,696.00	0.03
368	603939	益丰药房	14,078	339,702.14	0.03
369	600497	驰宏锌锗	60,400	336,428.00	0.03
370	000301	东方盛虹	40,100	329,221.00	0.03
371	300896	爱美客	1,800	328,500.00	0.03
372	000960	锡业股份	23,400	328,302.00	0.03
373	601155	新城控股	27,400	327,704.00	0.03
374	002180	纳思达	11,600	326,772.00	0.03
375	002709	天赐材料	16,400	323,408.00	0.03
376	600176	中国巨石	28,300	322,337.00	0.03
377	002432	九安医疗	7,900	322,162.00	0.03
378	688122	西部超导	7,490	320,721.80	0.03
379	300474	景嘉微	3,400	317,866.00	0.03
380	300114	中航电测	4,400	315,832.00	0.03
381	000596	古井贡酒	1,800	311,940.00	0.03
382	601168	西部矿业	18,900	303,723.00	0.03

383	601136	首创证券	13,500	297,000.00	0.03
384	000728	国元证券	35,400	295,944.00	0.03
385	002138	顺络电子	9,300	292,764.00	0.03
386	002085	万丰奥威	15,400	291,830.00	0.03
387	600115	中国东航	72,200	288,800.00	0.03
388	600563	法拉电子	2,400	285,408.00	0.03
389	002459	晶澳科技	20,596	283,195.00	0.03
390	600188	兖矿能源	19,925	282,337.25	0.03
391	000963	华东医药	8,100	280,260.00	0.03
392	000800	一汽解放	34,100	279,620.00	0.03
393	002074	国轩高科	12,900	273,738.00	0.03
394	002739	万达电影	22,186	269,338.04	0.03
395	601100	恒立液压	5,100	269,127.00	0.03
396	601799	星宇股份	2,000	266,960.00	0.02
397	688469	芯联集成	50,980	261,527.40	0.02
398	002271	东方雨虹	19,400	251,812.00	0.02
399	600875	东方电气	15,700	249,473.00	0.02
400	600011	华能国际	35,100	237,627.00	0.02
401	688120	华海清科	1,420	231,445.80	0.02
402	688188	柏楚电子	1,159	225,135.75	0.02
403	300003	乐普医疗	19,600	222,264.00	0.02
404	600879	航天电子	24,800	222,208.00	0.02
405	002738	中矿资源	6,040	214,420.00	0.02
406	300450	先导智能	10,657	213,353.14	0.02
407	603298	杭叉集团	11,900	212,891.00	0.02
408	601699	潞安环能	14,800	212,528.00	0.02
409	600166	福田汽车	84,400	211,844.00	0.02
410	688599	天合光能	10,912	210,601.60	0.02
411	300442	润泽科技	4,000	207,840.00	0.02
412	600029	南方航空	31,500	204,435.00	0.02
413	000630	铜陵有色	62,400	201,552.00	0.02
414	600482	中国动力	7,800	190,866.00	0.02
415	002517	恺英网络	13,900	189,179.00	0.02
416	600885	宏发股份	5,782	183,983.24	0.02
417	603606	东方电缆	3,400	178,670.00	0.02
418	300285	国瓷材料	10,400	177,216.00	0.02
419	688126	沪硅产业	9,388	176,682.16	0.02
420	601216	君正集团	33,300	175,158.00	0.02
421	000709	河钢股份	76,900	169,949.00	0.02
422	002439	启明星辰	10,600	167,692.00	0.02
423	688099	晶晨股份	2,348	161,260.64	0.02
424	600060	海信视像	7,600	151,544.00	0.01
425	000750	国海证券	34,100	145,948.00	0.01

426	002920	德赛西威	1,310	144,244.10	0.01
427	000617	中油资本	17,700	121,953.00	0.01
428	002736	国信证券	10,600	118,720.00	0.01
429	002465	海格通信	10,300	113,094.00	0.01
430	600895	张江高科	4,200	112,560.00	0.01
431	601567	三星医疗	3,600	110,736.00	0.01
432	600588	用友网络	10,200	109,446.00	0.01
433	600362	江西铜业	5,100	105,264.00	0.01
434	601872	招商轮船	15,900	101,919.00	0.01
435	603296	华勤技术	1,398	99,188.10	0.01
436	688072	拓荆科技	583	89,589.61	0.01
437	688363	华熙生物	1,610	82,174.40	0.01
438	000876	新希望	9,000	80,820.00	0.01
439	002078	太阳纸业	5,314	79,019.18	0.01
440	600233	圆通速递	5,400	76,626.00	0.01
441	300316	晶盛机电	2,400	76,560.00	0.01
442	601633	长城汽车	2,900	76,357.00	0.01
443	000408	藏格矿业	2,700	74,871.00	0.01
444	300012	华测检测	5,532	68,762.76	0.01
445	300223	北京君正	1,000	68,200.00	0.01
446	002673	西部证券	7,678	62,575.70	0.01
447	600988	赤峰黄金	4,000	62,440.00	0.01
448	688617	惠泰医疗	140	52,126.20	0.00
449	002601	龙佰集团	2,800	49,476.00	0.00
450	601878	浙商证券	3,300	40,392.00	0.00
451	603833	欧派家居	500	34,470.00	0.00
452	600909	华安证券	5,030	30,481.80	0.00
453	601211	国泰君安	1,600	29,840.00	0.00
454	601865	福莱特	1,300	25,597.00	0.00
455	688187	时代电气	533	25,541.36	0.00
456	301269	华大九天	200	24,220.00	0.00
457	600705	中航产融	6,200	22,506.00	0.00
458	601198	东兴证券	1,700	18,717.00	0.00
459	603198	迎驾贡酒	300	16,182.00	0.00
460	601825	沪农商行	1,800	15,318.00	0.00
461	300251	光线传媒	1,600	15,104.00	0.00
462	600498	烽火通信	756	14,711.76	0.00
463	688234	天岳先进	270	13,824.00	0.00
464	600256	广汇能源	2,000	13,460.00	0.00
465	002152	广电运通	1,140	13,292.40	0.00
466	600702	舍得酒业	200	13,186.00	0.00
467	000792	盐湖股份	800	13,168.00	0.00
468	601058	赛轮轮胎	900	12,897.00	0.00

469	300866	安克创新	130	12,693.20	0.00
470	002472	双环传动	400	12,248.00	0.00
471	000878	云南铜业	1,000	12,190.00	0.00
472	300142	沃森生物	1,000	12,080.00	0.00
473	600763	通策医疗	262	11,632.80	0.00
474	000921	海信家电	400	11,560.00	0.00
475	300454	深信服	200	11,480.00	0.00
476	600522	中天科技	800	11,456.00	0.00
477	002841	视源股份	300	11,073.00	0.00
478	002456	欧菲光	900	10,782.00	0.00
479	002032	苏泊尔	200	10,642.00	0.00
480	601727	上海电气	1,300	10,543.00	0.00
481	688213	思特威	133	10,336.76	0.00
482	300136	信维通信	400	10,176.00	0.00
483	603486	科沃斯	216	10,152.00	0.00
484	002850	科达利	100	9,768.00	0.00
485	601077	渝农商行	1,600	9,680.00	0.00
486	300146	汤臣倍健	800	9,640.00	0.00
487	300751	迈为股份	83	8,727.45	0.00
488	603806	福斯特	588	8,702.40	0.00
489	603179	新泉股份	200	8,540.00	0.00
490	600970	中材国际	900	8,532.00	0.00
491	603605	珀莱雅	100	8,470.00	0.00
492	600765	中航重机	400	8,188.00	0.00
493	300765	新诺威	300	7,977.00	0.00
494	600673	东阳光	700	7,903.00	0.00
495	600998	九州通	1,534	7,854.08	0.00
496	600038	中直股份	200	7,712.00	0.00
497	000021	深科技	400	7,624.00	0.00
498	002821	凯莱英	100	7,609.00	0.00
499	600862	中航高科	300	7,578.00	0.00
500	300037	新宙邦	200	7,488.00	0.00
501	603979	金诚信	200	7,260.00	0.00
502	600026	中远海能	600	6,960.00	0.00
503	300699	光威复材	200	6,930.00	0.00
504	603885	吉祥航空	500	6,850.00	0.00
505	601238	广汽集团	700	6,538.00	0.00
506	300999	金龙鱼	200	6,522.00	0.00
507	601333	广深铁路	1,900	6,517.00	0.00
508	603338	浙江鼎力	100	6,452.00	0.00
509	688065	凯赛生物	165	6,402.00	0.00
510	002600	领益智造	800	6,400.00	0.00
511	002812	恩捷股份	200	6,398.00	0.00

512	300724	捷佳伟创	100	6,321.00	0.00
513	002294	信立泰	200	6,186.00	0.00
514	600329	达仁堂	200	6,160.00	0.00
515	300763	锦浪科技	100	6,107.00	0.00
516	603899	晨光股份	200	6,050.00	0.00
517	002244	滨江集团	700	6,027.00	0.00
518	300529	健帆生物	200	5,868.00	0.00
519	688235	百济神州	36	5,796.72	0.00
520	600985	淮北矿业	400	5,628.00	0.00
521	688385	复旦微电	135	5,182.65	0.00
522	002025	航天电器	100	4,856.00	0.00
523	002080	中材科技	334	4,368.72	0.00
524	002430	杭氧股份	200	4,360.00	0.00
525	300373	扬杰科技	100	4,352.00	0.00
526	000733	振华科技	100	4,217.00	0.00
527	600061	国投资本	552	4,151.04	0.00
528	688082	盛美上海	41	4,100.00	0.00
529	603589	口子窖	100	3,924.00	0.00
530	600703	三安光电	300	3,651.00	0.00
531	600801	华新水泥	300	3,630.00	0.00
532	002603	以岭药业	200	3,202.00	0.00
533	600733	北汽蓝谷	400	3,200.00	0.00
534	000400	许继电气	100	2,753.00	0.00
535	601456	国联证券	200	2,704.00	0.00
536	603596	伯特利	60	2,675.40	0.00
537	300054	鼎龙股份	100	2,602.00	0.00
538	601990	南京证券	300	2,598.00	0.00
539	300001	特锐德	100	2,195.00	0.00
540	002558	巨人网络	100	1,269.00	0.00
541	600170	上海建工	300	795.00	0.00
542	688303	大全能源	30	724.20	0.00
543	603659	璞泰来	45	715.95	0.00

8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	600528	中铁工业	249,600	2,011,776.00	0.19
2	601228	广州港	532,700	1,805,853.00	0.17
3	000739	普洛药业	110,500	1,796,730.00	0.17
4	600299	安迪苏	142,900	1,793,395.00	0.17
5	600925	苏能股份	330,300	1,750,590.00	0.16
6	000883	湖北能源	339,500	1,690,710.00	0.16
7	601808	中海油服	106,900	1,630,225.00	0.15

8	000937	冀中能源	256,300	1,619,816.00	0.15
9	000778	新兴铸管	408,500	1,568,640.00	0.15
10	600755	厦门国贸	231,000	1,533,840.00	0.14
11	600529	山东药玻	58,500	1,507,545.00	0.14
12	601665	齐鲁银行	263,100	1,470,729.00	0.14
13	600578	京能电力	398,400	1,402,368.00	0.13
14	601158	重庆水务	285,700	1,399,930.00	0.13
15	601965	中国汽研	74,100	1,305,642.00	0.12
16	600517	国网英大	236,500	1,303,115.00	0.12
17	601611	中国核建	128,300	1,159,832.00	0.11
18	603233	大参林	76,173	1,147,165.38	0.11
19	600500	中化国际	279,250	1,122,585.00	0.10
20	601898	中煤能源	90,700	1,104,726.00	0.10
21	600098	广州发展	168,100	1,079,202.00	0.10
22	600258	首旅酒店	69,300	1,016,631.00	0.10
23	002203	海亮股份	90,800	976,100.00	0.09
24	000559	万向钱潮	158,100	972,315.00	0.09
25	600377	宁沪高速	63,300	969,123.00	0.09
26	600516	方大炭素	198,700	959,721.00	0.09
27	601598	中国外运	176,800	945,880.00	0.09
28	601098	中南传媒	62,500	938,125.00	0.09
29	600378	昊华科技	31,000	896,210.00	0.08
30	688425	铁建重工	203,414	895,021.60	0.08
31	002867	周大生	60,500	879,065.00	0.08
32	002408	齐翔腾达	172,760	868,982.80	0.08
33	603379	三美股份	21,900	840,522.00	0.08
34	000967	盈峰环境	169,000	839,930.00	0.08
35	603786	科博达	13,500	834,300.00	0.08
36	000998	隆平高科	67,300	751,741.00	0.07
37	600350	山东高速	68,200	701,096.00	0.07
38	300676	华大基因	16,700	700,899.00	0.07
39	603883	老百姓	42,200	690,814.00	0.06
40	601139	深圳燃气	97,400	687,644.00	0.06
41	601106	中国一重	220,400	641,364.00	0.06
42	000032	深桑达 A	36,000	635,040.00	0.06
43	002608	江苏国信	81,200	622,804.00	0.06
44	000959	首钢股份	203,280	620,004.00	0.06
45	000539	粤电力 A	135,400	613,362.00	0.06
46	600867	通化东宝	72,500	584,350.00	0.05
47	600129	太极集团	18,600	459,792.00	0.04
48	002563	森马服饰	43,500	305,370.00	0.03
49	001286	陕西能源	29,500	273,760.00	0.03
50	002507	涪陵榨菜	19,300	272,709.00	0.03

51	002690	美亚光电	18,040	267,352.80	0.02
52	002373	千方科技	13,700	138,918.00	0.01
53	600126	杭钢股份	24,500	117,110.00	0.01
54	603707	健友股份	7,700	102,179.00	0.01
55	600271	航天信息	11,200	102,032.00	0.01
56	000401	冀东水泥	17,400	91,002.00	0.01
57	600859	王府井	5,800	89,378.00	0.01
58	601998	中信银行	12,500	87,250.00	0.01
59	603882	金域医学	2,613	71,935.89	0.01
60	002153	石基信息	8,900	63,546.00	0.01
61	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
62	688276	百克生物	2,418	60,715.98	0.01
63	600995	南网储能	5,700	57,684.00	0.01
64	688375	国博电子	1,035	51,087.60	0.00
65	600977	中国电影	4,400	51,084.00	0.00
66	300888	稳健医疗	1,180	49,654.40	0.00
67	601636	旗滨集团	8,700	48,807.00	0.00
68	688387	信科移动	8,177	48,734.92	0.00
69	601212	白银有色	17,500	48,650.00	0.00
70	000987	越秀资本	6,882	48,311.64	0.00
71	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
72	002683	广东宏大	1,800	47,664.00	0.00
73	300601	康泰生物	2,700	46,305.00	0.00
74	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
75	600872	中炬高新	2,000	44,040.00	0.00
76	603444	吉比特	200	43,768.00	0.00
77	300070	碧水源	8,600	43,516.00	0.00
78	300024	机器人	2,400	43,080.00	0.00
79	603529	爱玛科技	1,050	43,071.00	0.00
80	002487	大金重工	2,000	40,980.00	0.00
81	600032	浙江新能	5,500	40,700.00	0.00
82	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
83	000636	风华高科	2,700	38,745.00	0.00
84	601858	中国科传	1,900	38,722.00	0.00
85	300118	东方日升	3,200	38,336.00	0.00
86	600435	北方导航	3,800	37,088.00	0.00
87	002385	大北农	8,300	35,939.00	0.00
88	688561	奇安信	1,272	34,127.76	0.00
89	600131	国网信通	1,800	34,038.00	0.00
90	688153	唯捷创芯	994	33,259.24	0.00
91	002410	广联达	2,780	32,692.80	0.00
92	002500	山西证券	5,200	32,656.00	0.00
93	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00

94	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
95	688819	天能股份	1,114	30,323.08	0.00
96	300803	指南针	300	28,785.00	0.00
97	601156	东航物流	1,700	28,679.00	0.00
98	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
99	688331	荣昌生物	902	27,159.22	0.00
100	300604	长川科技	600	26,478.00	0.00
101	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
102	600143	金发科技	2,987	25,807.68	0.00
103	603927	中科软	1,180	25,606.00	0.00
104	688475	萤石网络	821	24,785.99	0.00
105	603456	九洲药业	1,800	24,624.00	0.00
106	688032	禾迈股份	197	22,190.08	0.00
107	600499	科达制造	2,800	21,840.00	0.00
108	301165	锐捷网络	300	21,660.00	0.00
109	002407	多氟多	1,800	21,600.00	0.00
110	300212	易华录	900	21,060.00	0.00
111	002572	索菲亚	1,200	20,616.00	0.00
112	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
113	002268	电科网安	1,200	19,500.00	0.00
114	002568	百润股份	696	19,494.96	0.00
115	600580	卧龙电驱	1,100	18,909.00	0.00
116	603077	和邦生物	8,700	17,748.00	0.00
117	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
118	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
119	300979	华利集团	200	15,730.00	0.00
120	301565	中仑新材	711	15,215.40	0.00
121	002261	拓维信息	800	14,648.00	0.00
122	002624	完美世界	1,400	14,462.00	0.00
123	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
124	688778	厦钨新能	315	14,376.60	0.00
125	688390	固德威	350	14,315.00	0.00
126	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
127	601698	中国卫通	700	14,280.00	0.00
128	600764	中国海防	500	14,160.00	0.00
129	300567	精测电子	200	12,860.00	0.00
130	600732	爱旭股份	1,100	12,122.00	0.00
131	000893	亚钾国际	600	12,096.00	0.00
132	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
133	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
134	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
135	300558	贝达药业	200	10,786.00	0.00
136	603650	彤程新材	300	10,491.00	0.00

137	003031	中瓷电子	200	10,478.00	0.00
138	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
139	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
140	688297	中无人机	242	9,747.76	0.00
141	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
142	688772	珠海冠宇	553	8,892.24	0.00
143	600373	中文传媒	700	8,785.00	0.00
144	000958	电投产融	1,400	8,722.00	0.00
145	000898	鞍钢股份	3,500	8,400.00	0.00
146	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
147	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
148	000997	新大陆	400	7,980.00	0.00
148	601608	中信重工	1,900	7,980.00	0.00
149	301267	华夏眼科	400	7,616.00	0.00
150	300677	英科医疗	300	7,584.00	0.00
151	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
152	002019	亿帆医药	700	7,504.00	0.00
153	600208	衢州发展	2,500	7,400.00	0.00
154	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
155	688516	奥特维	168	7,276.08	0.00
156	001203	大中矿业	800	6,928.00	0.00
157	002044	美年健康	1,500	6,885.00	0.00
158	002653	海思科	200	6,650.00	0.00
159	688567	孚能科技	565	6,554.00	0.00
160	300073	当升科技	150	6,042.00	0.00
161	603737	三棵树	140	5,964.00	0.00
162	688052	纳芯微	45	5,863.50	0.00
163	002557	洽洽食品	200	5,810.00	0.00
164	002299	圣农发展	400	5,792.00	0.00
165	000060	中金岭南	1,200	5,628.00	0.00
166	688002	睿创微纳	116	5,453.16	0.00
167	603728	鸣志电器	100	5,400.00	0.00
168	688536	思瑞浦	54	4,995.00	0.00
169	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
170	600663	陆家嘴	500	4,920.00	0.00
171	688349	三一重能	155	4,786.40	0.00
172	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
173	300957	贝泰妮	100	4,269.00	0.00
174	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
175	603868	飞科电器	100	4,152.00	0.00
176	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
177	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
178	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00

179	600325	华发股份	600	3,456.00	0.00
180	300595	欧普康视	180	3,411.00	0.00
181	300383	光环新网	200	2,918.00	0.00
182	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
183	603228	景旺电子	100	2,784.00	0.00
184	600808	马钢股份	900	2,781.00	0.00
185	002195	岩山科技	700	2,779.00	0.00
186	002436	兴森科技	230	2,555.30	0.00
187	688248	南网科技	79	2,535.11	0.00
188	000537	中绿电	255	2,325.60	0.00
189	300390	天华新能	100	2,305.00	0.00
190	600416	湘电股份	200	2,258.00	0.00
191	300748	金力永磁	124	2,217.12	0.00
192	600483	福能股份	200	1,994.00	0.00
193	600056	中国医药	160	1,776.00	0.00
194	600884	杉杉股份	195	1,452.75	0.00
195	000887	中鼎股份	100	1,312.00	0.00
196	300002	神州泰岳	100	1,159.00	0.00
197	688301	奕瑞科技	10	955.70	0.00
198	688521	芯原股份	18	943.74	0.00
199	002531	天顺风能	118	933.38	0.00
200	688220	翱捷科技	12	649.08	0.00
201	400174	中天 3	100	1.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601328	交通银行	41,023,938.50	4.12
2	600919	江苏银行	38,506,325.95	3.87
3	002027	分众传媒	37,842,095.01	3.80
4	601288	农业银行	36,981,612.00	3.72
5	600406	国电南瑞	36,506,183.13	3.67
6	601728	中国电信	35,732,085.00	3.59
7	601398	工商银行	35,044,243.00	3.52
8	600031	三一重工	34,903,661.00	3.51
9	601318	中国平安	34,752,912.00	3.49
10	600036	招商银行	34,343,943.00	3.45
11	600905	三峡能源	34,289,600.00	3.45
12	601816	京沪高铁	34,176,361.00	3.43
13	300408	三环集团	34,025,985.00	3.42
14	600000	浦发银行	33,447,288.27	3.36
15	000651	格力电器	32,913,928.00	3.31

16	600309	万华化学	32,758,187.92	3.29
17	600690	海尔智家	32,632,391.00	3.28
18	000001	平安银行	32,060,711.00	3.22
19	601766	中国中车	31,841,888.00	3.20
20	000333	美的集团	31,134,740.00	3.13
21	601988	中国银行	30,907,647.10	3.11
22	600887	伊利股份	30,332,256.00	3.05
23	601006	大秦铁路	30,053,515.39	3.02
24	601668	中国建筑	30,034,397.00	3.02
25	002415	海康威视	29,758,678.05	2.99
26	000425	徐工机械	29,615,279.00	2.98
27	600900	长江电力	29,536,474.00	2.97
28	601166	兴业银行	29,352,713.00	2.95
29	600346	恒力石化	29,276,784.00	2.94
30	601899	紫金矿业	28,974,444.00	2.91
31	601818	光大银行	27,980,683.00	2.81
32	601919	中远海控	27,955,630.80	2.81
33	300124	汇川技术	27,931,611.00	2.81
34	000723	美锦能源	27,832,207.00	2.80
35	601669	中国电建	27,793,487.00	2.79
36	300750	宁德时代	27,724,805.60	2.79
37	603993	洛阳钼业	27,332,992.00	2.75
38	601939	建设银行	27,148,060.00	2.73
39	601169	北京银行	27,062,547.43	2.72
40	000630	铜陵有色	26,886,774.00	2.70
41	600050	中国联通	26,806,777.00	2.69
42	601118	海南橡胶	26,540,133.00	2.67
43	601658	邮储银行	26,210,853.00	2.63
44	600016	民生银行	26,156,104.00	2.63
45	601088	中国神华	26,029,398.00	2.62
46	601225	陕西煤业	25,816,306.82	2.59
47	601985	中国核电	25,615,318.00	2.57
48	002475	立讯精密	25,523,720.00	2.56
49	000100	TCL 科技	25,286,708.60	2.54
50	601117	中国化学	25,282,556.00	2.54
51	600999	招商证券	25,161,928.00	2.53
52	000983	山西焦煤	25,146,961.00	2.53
53	600028	中国石化	25,143,410.00	2.53
54	601229	上海银行	25,063,220.31	2.52
55	600941	中国移动	25,003,887.15	2.51
56	600989	宝丰能源	24,995,080.00	2.51
57	600115	中国东航	24,967,122.00	2.51
58	600660	福耀玻璃	24,834,563.98	2.50

59	002601	龙佰集团	24,761,119.00	2.49
60	600655	豫园股份	24,756,871.00	2.49
61	600176	中国巨石	24,721,768.51	2.48
62	000166	申万宏源	24,520,335.04	2.46
63	002352	顺丰控股	24,287,350.00	2.44
64	600019	宝钢股份	24,075,686.00	2.42
65	000776	广发证券	24,075,649.00	2.42
66	600282	南钢股份	24,053,924.00	2.42
67	001965	招商公路	23,949,985.26	2.41
68	002128	电投能源	23,826,855.00	2.39
69	600893	航发动力	23,790,608.00	2.39
70	000895	双汇发展	23,761,578.00	2.39
71	000063	中兴通讯	23,686,094.00	2.38
72	002594	比亚迪	23,595,379.86	2.37
73	600884	杉杉股份	23,582,638.70	2.37
74	601390	中国中铁	23,571,449.00	2.37
75	601600	中国铝业	23,561,080.00	2.37
76	000703	恒逸石化	23,552,198.00	2.37
77	600023	浙能电力	23,529,810.00	2.36
78	000301	东方盛虹	23,529,591.00	2.36
79	601916	浙商银行	23,474,969.00	2.36
80	003816	中国广核	23,388,545.00	2.35
81	002493	荣盛石化	23,280,637.00	2.34
82	000513	丽珠集团	23,230,196.23	2.33
83	002142	宁波银行	23,041,573.64	2.31
84	300498	温氏股份	22,923,872.00	2.30
85	600219	南山铝业	22,813,552.00	2.29
86	600583	海油工程	22,692,556.99	2.28
87	000725	京东方 A	22,597,475.00	2.27
88	603259	药明康德	22,521,955.00	2.26
89	600276	恒瑞医药	22,512,672.00	2.26
90	000783	长江证券	22,483,991.00	2.26
91	002064	华峰化学	22,474,832.06	2.26
92	601868	中国能建	22,463,926.00	2.26
93	600863	内蒙华电	22,451,421.00	2.26
94	600585	海螺水泥	22,449,105.61	2.26
95	000157	中联重科	22,355,703.20	2.25
96	002236	大华股份	22,296,969.60	2.24
97	600958	东方证券	22,188,549.48	2.23
98	600873	梅花生物	22,174,757.73	2.23
99	600018	上港集团	22,165,030.00	2.23
100	600795	国电电力	22,094,625.00	2.22
101	000932	华菱钢铁	22,005,955.00	2.21

102	601021	春秋航空	21,997,378.00	2.21
103	601128	常熟银行	21,997,290.28	2.21
104	688396	华润微	21,945,413.31	2.20
105	600436	片仔癀	21,783,664.00	2.19
106	002230	科大讯飞	21,773,277.44	2.19
107	002384	东山精密	21,686,215.84	2.18
108	688256	寒武纪	21,626,141.97	2.17
109	601997	贵阳银行	21,623,677.80	2.17
110	688390	固德威	21,601,820.67	2.17
111	002120	韵达股份	21,572,018.00	2.17
112	688538	和辉光电	21,462,811.62	2.16
113	002966	苏州银行	21,444,539.80	2.15
114	000683	远兴能源	21,361,994.00	2.15
115	601377	兴业证券	21,319,289.40	2.14
116	601991	大唐发电	21,302,998.00	2.14
117	601601	中国太保	21,259,626.00	2.14
118	600637	东方明珠	21,174,344.79	2.13
119	603568	伟明环保	20,971,175.56	2.11
120	600352	浙江龙盛	20,964,764.00	2.11
121	688981	中芯国际	20,863,422.18	2.10
122	688017	绿的谐波	20,814,249.75	2.09
123	002432	九安医疗	20,776,724.00	2.09
124	002371	北方华创	20,774,324.00	2.09
125	603260	合盛硅业	20,738,531.00	2.08
126	603501	韦尔股份	20,707,992.30	2.08
127	603899	晨光股份	20,583,101.00	2.07
128	300308	中际旭创	20,537,271.00	2.06
129	601877	正泰电器	20,518,518.00	2.06
130	601000	唐山港	20,474,074.96	2.06
131	600233	圆通速递	20,434,628.00	2.05
132	601866	中远海发	20,408,279.00	2.05
133	601577	长沙银行	20,300,046.00	2.04
134	601186	中国铁建	20,238,994.00	2.03
135	600803	新奥股份	20,211,418.00	2.03
136	600029	南方航空	20,046,283.00	2.01
137	600183	生益科技	20,033,960.00	2.01
138	601688	华泰证券	19,952,047.00	2.00
139	600582	天地科技	19,907,072.00	2.00

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。

8.4.2 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	601288	农业银行	39,215,120.00	3.94
2	601728	中国电信	36,648,130.00	3.68
3	002027	分众传媒	36,416,388.00	3.66
4	601328	交通银行	34,189,254.00	3.43
5	600919	江苏银行	34,099,213.00	3.43
6	600406	国电南瑞	32,477,037.23	3.26
7	600031	三一重工	32,265,900.54	3.24
8	600905	三峡能源	31,905,847.00	3.21
9	601939	建设银行	31,876,367.00	3.20
10	300408	三环集团	31,779,658.09	3.19
11	000425	徐工机械	31,518,750.00	3.17
12	600690	海尔智家	30,425,232.00	3.06
13	603993	洛阳钼业	29,974,891.00	3.01
14	601006	大秦铁路	29,746,256.00	2.99
15	601816	京沪高铁	29,699,968.00	2.98
16	600036	招商银行	29,587,453.00	2.97
17	000630	铜陵有色	29,123,898.00	2.93
18	000100	TCL 科技	28,393,323.26	2.85
19	601398	工商银行	28,360,771.00	2.85
20	600309	万华化学	28,326,256.92	2.85
21	601919	中远海控	27,567,078.40	2.77
22	601988	中国银行	27,457,125.40	2.76
23	600050	中国联通	27,223,782.00	2.74
24	000723	美锦能源	27,007,523.50	2.71
25	600019	宝钢股份	26,763,691.00	2.69
26	600346	恒力石化	26,697,540.00	2.68
27	601118	海南橡胶	26,510,744.00	2.66
28	000513	丽珠集团	26,482,198.00	2.66
29	000333	美的集团	26,364,526.42	2.65
30	601766	中国中车	26,261,822.30	2.64
31	601658	邮储银行	26,195,321.00	2.63
32	600000	浦发银行	26,142,631.00	2.63
33	000932	华菱钢铁	26,116,549.01	2.62
34	000001	平安银行	26,045,940.00	2.62
35	601668	中国建筑	25,905,515.00	2.60
36	601088	中国神华	25,812,979.00	2.59
37	601985	中国核电	25,500,642.00	2.56
38	000983	山西焦煤	25,374,973.60	2.55
39	002415	海康威视	25,174,608.25	2.53
40	600023	浙能电力	25,079,415.00	2.52
41	601669	中国电建	25,030,644.00	2.51
42	600115	中国东航	24,960,357.00	2.51

43	002601	龙佰集团	24,946,851.00	2.51
44	600655	豫园股份	24,899,001.00	2.50
45	600873	梅花生物	24,803,014.04	2.49
46	601117	中国化学	24,740,185.00	2.49
47	003816	中国广核	24,692,873.00	2.48
48	600176	中国巨石	24,614,199.69	2.47
49	601318	中国平安	24,366,333.00	2.45
50	600795	国电电力	24,299,685.00	2.44
51	600989	宝丰能源	23,927,386.00	2.40
52	000157	中联重科	23,893,086.00	2.40
53	300124	汇川技术	23,672,282.00	2.38
54	000725	京东方 A	23,614,464.00	2.37
55	000651	格力电器	23,613,243.93	2.37
56	600282	南钢股份	23,583,058.00	2.37
57	600028	中国石化	23,298,775.49	2.34
58	600999	招商证券	23,289,960.20	2.34
59	000301	东方盛虹	23,275,629.00	2.34
60	601000	唐山港	23,180,195.04	2.33
61	601818	光大银行	23,150,003.00	2.33
62	601229	上海银行	23,060,129.00	2.32
63	600884	杉杉股份	22,968,070.41	2.31
64	600582	天地科技	22,729,600.00	2.28
65	000937	冀中能源	22,666,810.44	2.28
66	002493	荣盛石化	22,638,151.75	2.27
67	002078	太阳纸业	22,590,790.72	2.27
68	600016	民生银行	22,495,425.80	2.26
69	002142	宁波银行	22,456,796.00	2.26
70	300498	温氏股份	22,379,386.40	2.25
71	600887	伊利股份	22,194,944.00	2.23
72	603259	药明康德	22,171,335.00	2.23
73	600893	航发动力	22,130,273.40	2.22
74	000703	恒逸石化	22,102,921.65	2.22
75	601077	渝农商行	22,074,623.00	2.22
76	000166	申万宏源	22,041,578.00	2.21
77	002432	九安医疗	22,038,062.50	2.21
78	601600	中国铝业	22,032,546.00	2.21
79	000783	长江证券	21,968,069.00	2.21
80	600018	上港集团	21,924,976.00	2.20
81	601225	陕西煤业	21,848,385.00	2.20
82	688390	固德威	21,834,692.42	2.19
83	601128	常熟银行	21,818,794.60	2.19
84	001965	招商公路	21,815,131.33	2.19
85	000825	太钢不锈	21,814,926.00	2.19

86	600958	东方证券	21,810,993.72	2.19
87	002128	电投能源	21,743,981.00	2.18
88	002064	华峰化学	21,737,970.06	2.18
89	601169	北京银行	21,680,467.00	2.18
90	601997	贵阳银行	21,595,975.20	2.17
91	600660	福耀玻璃	21,500,804.00	2.16
92	688396	华润微	21,485,087.87	2.16
93	600941	中国移动	21,478,404.00	2.16
94	002120	韵达股份	21,384,979.00	2.15
95	000683	远兴能源	21,358,850.00	2.15
96	600637	东方明珠	21,315,891.65	2.14
97	688017	绿的谐波	21,285,496.54	2.14
98	600585	海螺水泥	21,283,215.00	2.14
99	601555	东吴证券	21,213,279.00	2.13
100	600863	内蒙华电	21,190,720.00	2.13
101	601688	华泰证券	21,170,478.00	2.13
102	300433	蓝思科技	21,167,584.13	2.13
103	600583	海油工程	21,140,885.00	2.12
104	000617	中油资本	21,038,983.22	2.11
105	600009	上海机场	21,038,000.00	2.11
106	600219	南山铝业	21,034,832.00	2.11
107	600511	国药股份	21,017,008.00	2.11
108	601899	紫金矿业	20,987,269.00	2.11
109	002648	卫星化学	20,922,049.00	2.10
110	002044	美年健康	20,910,929.00	2.10
111	601608	中信重工	20,817,979.00	2.09
112	000032	深桑达 A	20,814,095.00	2.09
113	601916	浙商银行	20,808,611.00	2.09
114	601390	中国中铁	20,788,562.00	2.09
115	000895	双汇发展	20,662,758.00	2.08
116	601800	中国交建	20,600,014.00	2.07
117	002384	东山精密	20,586,789.00	2.07
118	688538	和辉光电	20,483,571.20	2.06
119	600820	隧道股份	20,417,117.00	2.05
120	600233	圆通速递	20,389,314.02	2.05
121	601021	春秋航空	20,387,690.35	2.05
122	688256	寒武纪	20,370,450.17	2.05
123	600900	长江电力	20,234,962.50	2.03
124	603899	晨光股份	20,211,484.00	2.03
125	600436	片仔癀	20,184,377.14	2.03
126	600938	中国海油	20,161,799.00	2.03
127	600352	浙江龙盛	20,111,881.00	2.02
128	600803	新奥股份	20,083,564.00	2.02

129	601111	中国国航	19,998,217.00	2.01
130	600029	南方航空	19,964,281.40	2.01
131	002595	豪迈科技	19,916,592.13	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,477,472,185.75
卖出股票收入（成交）总额	10,457,375,631.04

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。

8.5 期末按债券品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）	757.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	757.20	0.00

8.6 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

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	127107	领益转债	6	757.20	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	340,342.98
2	应收清算款	665,235.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	136,217.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,141,796.23

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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（%）
78,728	18,412.67	10,879,444.08	0.75	1,438,713,403.63	99.25

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	534,963.91	0.04

9.3 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情况

无。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
许之彦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 11 月 8 日）	
基金份额总额	1,762,466,123.89

本报告期期初基金份额总额	1,415,635,151.49
本报告期基金总申购份额	338,337,105.43
减：本报告期基金总赎回份额	304,379,409.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,449,592,847.71

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 11 月 9 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。此次变更已经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

目前该审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2024 年 11 月 9 日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理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及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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(%)	
国泰君安	1	6,676,361,983.48	31.90	3,644,509.55	36.40	-
银河证券	2	4,193,044,267.55	20.03	1,603,649.24	16.02	-
浙商证券	1	3,051,179,708.88	14.58	2,829,861.45	28.26	-
招商证券	1	2,296,321,034.82	10.97	747,658.96	7.47	-
中信证券	1	2,179,172,482.85	10.41	426,895.40	4.26	-
中信建投	1	1,810,802,820.49	8.65	533,385.37	5.33	-
申万宏源	2	445,203,554.94	2.13	171,546.56	1.71	-
广发证券	1	183,324,535.30	0.88	35,910.07	0.36	-
华泰证券	1	95,789,230.61	0.46	18,768.09	0.19	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注：本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

- （1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控

制度；

(2) 提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；

(3) 交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

(1) 候选证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

(2) 候选证券公司的准入评估

对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司内部审批程序后完成证券公司准入。

(3) 候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司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

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：中信证券、国信证券、平安证券、东方财富、华泰证券。

撤销交易单元的证券公司：无。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	83,110.81	99.28	-	-	-	-

浙商证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	600.00	0.72	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 12 日
2	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（永兴股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 12 日
3	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 19 日
4	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（北自科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 24 日
5	华安基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 2 日
6	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（肯特股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 21 日
7	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（龙旗科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 24 日
8	华安基金管理有限公司关于副总统经	中国证监会基金电子披	2024 年 3 月 12 日

	理任职的公告	露网站及基金管理人网站	
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
10	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
11	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
12	华安中国股增强指数 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
13	华安中国 A 股增强指数基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
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（键邦股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 29 日
15	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
16	华安中国 A 股增强指数 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
17	关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 24 日
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（国科天成）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 15 日
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（富特科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 29 日
20	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
21	华安中国 A 股增强 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
22	华安基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 10 日

23	华安基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 12 日
24	关于终止中民财富基金销售(上海)有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 18 日
25	华安中国 A 股指数基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 20 日
26	华安中国 A 股增强指数更新的招募说明书(2024 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 20 日
27	华安基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金基金份额净值精度并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 25 日
28	华安 MSCI 中国 A 股指数增强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及基金管理人网站	2024 年 9 月 25 日
29	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 25 日
30	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2024 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 25 日
31	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(托普云农)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 11 日
32	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
33	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
34	华安基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 28 日
35	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国动力”股票估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 9 日
36	华安基金管理有限公司关于暂停北京展恒基金销售股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 13 日
37	华安基金管理有限公司关于旗下基	中国证监会基金电子披	2024 年 11 月 20 日

	金投资关联方承销证券的公告（领 益转债）	露网站及基金管理人网 站	
38	华安基金管理有限公司关于终止乾 道基金销售有限公司办理本公司旗 下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2024 年 11 月 22 日
39	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（中 力股份）	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2024 年 12 月 18 日
40	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	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2024 年 12 月 26 日
41	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	中国证监会基金电子披 露网站及基金管理人网 站	2024 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 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；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 存放地点

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

13.3 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住所
免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日