

华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56

7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 9	开放式基金份额变动	58
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	61
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	61
§ 12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015148	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 12 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	112,455,606.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015148	015149
报告期末下属分级基金的份额总额	84,633,285.17 份	27,822,321.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要利用量化选股模型，在保持对中证 1000 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。具体策略包括：</p> <p>（1）指数化被动投资策略</p> <p>（2）量化增强投资策略</p> <p>（3）模型的应用与调整</p> <p>（4）港股通标的股票投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>6、参与融资业务相关策略</p> <p>7、参与转融通证券出借业务投资策略</p> <p>8、存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本

	基金可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-9,970,872.06	-5,851,030.86
本期利润	-15,190,014.51	-6,331,475.77
加权平均基金份额 本期利润	-0.1714	-0.1398

本期加权平均净值利润率	-21.78%	-17.83%
本期基金份额净值增长率	-19.07%	-19.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-24,159,834.28	-8,098,338.91
期末可供分配基金份额利润	-0.2855	-0.2911
期末基金资产净值	60,473,450.89	19,723,982.48
期末基金份额净值	0.7145	0.7089
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-28.55%	-29.11%

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

华安中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.58%	1.34%	-8.15%	1.36%	-0.43%	-0.02%
过去三个月	-10.98%	1.47%	-9.52%	1.42%	-1.46%	0.05%
过去六个月	-19.07%	2.06%	-15.99%	1.87%	-3.08%	0.19%
过去一年	-24.84%	1.58%	-24.53%	1.47%	-0.31%	0.11%

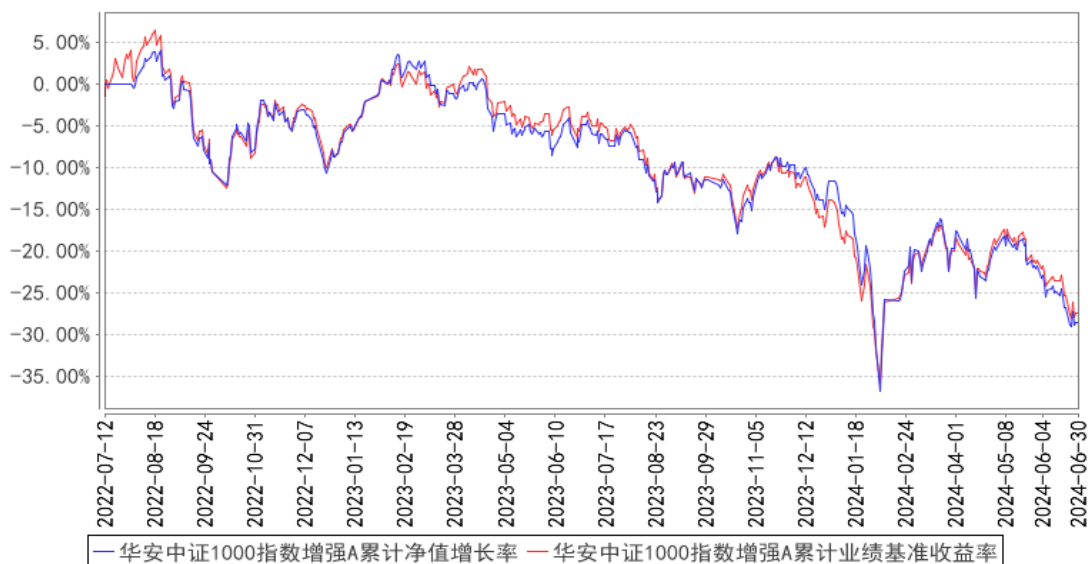
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-28.55%	1.31%	-27.49%	1.28%	-1.06%	0.03%

华安中证 1000 指数增强 C

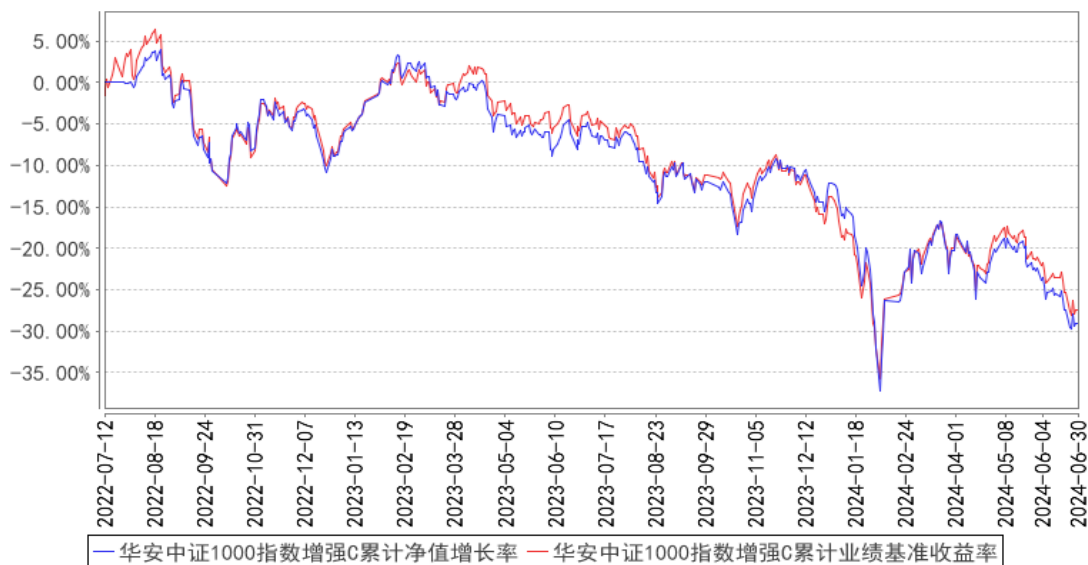
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.61%	1.34%	-8.15%	1.36%	-0.46%	-0.02%
过去三个月	-11.07%	1.46%	-9.52%	1.42%	-1.55%	0.04%
过去六个月	-19.24%	2.06%	-15.99%	1.87%	-3.25%	0.19%
过去一年	-25.13%	1.58%	-24.53%	1.47%	-0.60%	0.11%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-29.11%	1.31%	-27.49%	1.28%	-1.62%	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

华安中证1000指数增强A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



华安中证1000指数增强C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



§ 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6月30日，公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等263只证券投资基金，管理资产规模达到6,651.01亿元人民币。

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		
马韬	本基金的基金经理	2022年7月12日	-	9年	硕士研究生，9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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进

行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 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

2024 年上半年国内宏观经济延续修复的态势，供需两端主要指标均稳中有升。随着地产周期、人口周期及债务周期等均进入新阶段，经济增长仍然面临不小的压力。权益市场在上半年表现也较为一般，整体表现相对弱势。

市场风格主要表现为红利、大盘领先，宽基指数表现为沪深 300 强于中证 500 强于中证 1000。小微盘风格股票在一季度经历了历史罕见的波动，先是在 1 月份由雪球敲入、DMA 平仓等引发的流动性危机而导致小微盘股票大幅下跌，而后又在 2—3 月迅速反弹。在此期间，市场主流的量化模型均受到了不同程度的挑战。行业层面，也主要表现为以银行、煤炭、电力及公用事业等为代表的红利板块继续强势，传统的消费、新能源、医药等板块仍然疲软。

本基金坚持以量化基本面为核心的投资框架，并不断深耕量化交易策略，通过量化基本面策略建立未来基本面向好、景气度提升且估值性价比高的基础配置组合，再通过量化交易型策略在配置组合之上提升一定的交易频率，获取市场短期非理性定价带来的交易性收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.7145 元，C 类份额净值为 0.7089 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-19.07%，同期业绩比较基准增长率为-15.99%，C 类份额净值增长率为-19.24%，同期业绩比较基准增长率为-15.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，大的宏观背景是更加强调高质量发展，强调质量，强调结构。根据《政府工作报告》的部署，大力推进现代化产业体系建设、加快发展新质生产力将是贯穿 2024 全年的首要工作目标。货币政策上，总量层面仍将保持适度宽松，结构上将更加注重政策的实施效果，发挥货币政策的结构优化作用。

在此背景下，证券市场可能将会继续演绎结构性行情，在没有特别明显增量资金的情况下，板块和行业之间的轮动效应可能会再加强。在基本配置上，沿着景气变化和改革政策方向把握投资机会，一方面是红利策略，关注分红改革新政下分红水平占优或分红有提升空间的板块和企业；另一方面是新质生产力，主要集中在科技成长、先进制造等板块。

作为中证 1000 指数增强基金的管理人，从量化基本面模型上看，景气度模型依旧是接下来一段时间操作的重点，但是会更加紧密的配合估值模型和交易模型；在交易类策略中，也会密切留意市场流动性的变动对交易模型的冲击，总体的来说，我们将在跟踪指数的前提下，继续坚持量化因子策略，勤勉尽责，力争为投资者获得长期稳定的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,181,955.69	4,027,039.55
结算备付金		9,140,594.96	4,957,718.15
存出保证金		927,134.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	67,213,178.13	129,428,730.01
其中：股票投资		67,213,178.13	129,428,730.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,754.51	166,104.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		80,488,617.69	138,579,592.30
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		139,357.05	217,962.40
应付管理人报酬		41,316.06	70,805.01
应付托管费		10,329.06	17,701.23
应付销售服务费		6,775.36	19,519.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		204.28	0.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	93,202.51	180,000.00
负债合计		291,184.32	505,988.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	112,455,606.56	156,760,223.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-32,258,173.19	-18,686,619.02
净资产合计		80,197,433.37	138,073,604.18
负债和净资产总计		80,488,617.69	138,579,592.30

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 112,455,606.56 份，其中 A 类基金份额净值 0.7145 元，基金份额总额 84,633,285.17 份；C 类基金份额净值 0.7089 元，基金份额总额

27,822,321.39 份。

6.2 利润表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-20,966,900.87	13,080,132.08
1. 利息收入		34,936.09	40,180.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,936.09	40,180.35
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）		-15,348,019.25	4,298,743.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-16,938,486.03	2,843,368.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,542.17	30,261.81
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	727,887.56	81,876.92
股利收益	6.4.7.13	845,037.05	1,343,235.87
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）	6.4.7.14	-5,699,587.36	8,735,522.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	45,769.65	5,685.63
减：二、营业总支出		554,589.41	1,190,613.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	314,252.57	706,969.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,563.23	176,742.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	70,914.00	214,734.74

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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		2,623.81	729.11
8. 其他费用	6.4.7.17	88,235.80	91,437.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,521,490.28	11,889,519.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,521,490.28	11,889,519.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,521,490.28	11,889,519.02

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	156,760,223.20	-	-18,686,619.02	138,073,604.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	156,760,223.20	-	-18,686,619.02	138,073,604.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-44,304,616.64	-	-13,571,554.17	-57,876,170.81
(一)、综合收益总额	-	-	-21,521,490.28	-21,521,490.28
(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)	-44,304,616.64	-	7,949,936.11	-36,354,680.53
其中：1. 基金申	20,450,150.39	-	-4,758,165.08	15,691,985.31

购款				
2. 基金赎回款	-64,754,767.03	-	12,708,101.19	-52,046,665.84
(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	112,455,606.56	-	-32,258,173.19	80,197,433.37
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	273,844,485.00	-	-23,460,841.21	250,383,643.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	273,844,485.00	-	-23,460,841.21	250,383,643.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,122,608.99	-	12,704,520.60	-50,418,088.39
(一)、综合收益总额	-	-	11,889,519.02	11,889,519.02
(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)	-63,122,608.99	-	815,001.58	-62,307,607.41
其中：1. 基金申购款	24,558,523.46	-	-543,450.55	24,015,072.91
2. 基金赎回款	-87,681,132.45	-	1,358,452.13	-86,322,680.32
(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	-	-	-	-

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	210,721,876.01	-	-10,756,320.61	199,965,555.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证 1000 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”)证监许可[2022]第 196 号《关于准予华安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 236,269,718.90 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0484 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 236,358,692.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 88,973.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购或申购基金时收取认购费或申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分设不同的基金代码,并分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,181,955.69
等于：本金	3,181,642.72
加：应计利息	312.97

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	3,181,955.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	71,901,284.23	-	67,213,178.13	-4,688,106.10
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	71,901,284.23	-	67,213,178.13	-4,688,106.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,228,600.00	-	-	-
	8,228,600.00	-	-	-

其中： 股指期货 投资				
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	8,228,600.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/ 卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	5.00	4,858,000.00	-334,600.00
IM2409	IM2409	3.00	2,868,120.00	-167,880.00
合计				-502,480.00
减：可抵销期货 暂收款				-502,480.00
净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	6,364.19
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,838.32
合计	93,202.51

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	92,028,836.99	92,028,836.99
本期申购	5,477,610.07	5,477,610.07
本期赎回(以“-”号填列)	-12,873,161.89	-12,873,161.89
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	84,633,285.17	84,633,285.17

华安中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	64,731,386.21	64,731,386.21
本期申购	14,972,540.32	14,972,540.32
本期赎回(以“-”号填列)	-51,881,605.14	-51,881,605.14
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	27,822,321.39	27,822,321.39

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,716,094.85	942,197.51	-10,773,897.34
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-11,716,094.85	942,197.51	-10,773,897.34
本期利润	-9,970,872.06	-5,219,142.45	-15,190,014.51
本期基金份额交易产生的变动数	1,500,394.37	303,683.20	1,804,077.57
其中：基金申购款	-1,105,374.37	-83,728.51	-1,189,102.88
基金赎回款	2,605,768.74	387,411.71	2,993,180.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,186,572.54	-3,973,261.74	-24,159,834.28

华安中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-8,564,622.26	651,900.58	-7,912,721.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-8,564,622.26	651,900.58	-7,912,721.68
本期利润	-5,851,030.86	-480,444.91	-6,331,475.77
本期基金份额交易产生的变动数	7,617,064.29	-1,471,205.75	6,145,858.54
其中：基金申购款	-3,221,289.79	-347,772.41	-3,569,062.20
基金赎回款	10,838,354.08	-1,123,433.34	9,714,920.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,798,588.83	-1,299,750.08	-8,098,338.91

6.4.7.9 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 6 月 30 日	
活期存款利息收入	8,110.97	
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	26,825.12	
其他	-	
合计	34,936.09	

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,938,486.03	
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	-16,938,486.03	

6.4.7.10.2 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 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	713,118,524.14	
减：卖出股票成本总额	728,892,777.98	

减：交易费用	1,164,232.19
买卖股票差价收入	-16,938,486.03

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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6月30日
债券投资收益——利息收入	22.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,519.75
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	17,542.17

6.4.7.11.2 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6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	138,648.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	121,100.00
减：应计利息总额	23.09
减：交易费用	5.58
买卖债券差价收入	17,519.75

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	727,887.56

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	845,037.05
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	845,037.05

6.4.7.14 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,197,107.36
股票投资	-5,197,107.36
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-502,480.00
权证投资	-
期货投资	-502,480.00
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	-5,699,587.36

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,339.19
基金转换费收入	5,430.46
合计	45,769.65

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	27,165.98
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,397.48

合计	88,235.80
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	314,252.57	706,969.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	147,679.97	330,781.32
应支付基金管理人的净管理费	166,572.60	376,187.94

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	78,563.23	176,742.33

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 1000 指数 增强 A	华安中证 1000 指数 增强 C	合计
华安基金管理有限公司	-	5,910.08	5,910.08
招商银行股份有限公司	-	1,113.89	1,113.89
合计	-	7,023.97	7,023.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 1000 指数 增强 A	华安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	134.39	134.39

华安基金管理有限公司	-	5,937.65	5,937.65
招商银行股份有限公司	-	496.43	496.43
合计	-	6,568.47	6,568.47

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金，再由华安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	3,181,955.69	8,110.97	6,303,430.33	15,430.25

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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 6 月 30 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	575	12,236.00
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	1,644	26,632.80
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	1,860	43,896.00
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	1,382	46,974.18
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	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	127086	恒邦转债	老股东配售	1,255	125,500.00
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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	1-6 个月（含）	新股限售	16.98	13.48	94	1,596.12	1,267.12	-

001387	雪祺电气	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股限售	15.38	15.25	79	1,215.02	1,204.75	-
001387	雪祺电气	2024年06月03日	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	15.25	23	0.00	350.75	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.83	86	2,408.86	3,253.38	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股限售	126.89	188.01	118	14,973.02	22,185.18	-
301589	诺瓦星云	2024年05月30日	1-6个月(含)	新股限售-送股	0.00	188.01	94	0.00	17672.94	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月(含)	新股限售	16.20	15.96	165	2,673.00	2,633.40	-
603082	北自科技	2024年1月23日	1-6个月(含)	新股限售	21.28	29.49	58	1,234.24	1,710.42	-
603312	西典新能	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股限售	29.02	25.36	42	1,218.84	1,065.12	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	1-6个月(含)	新股限售	72.46	68.06	19	1,376.74	1,293.14	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	新股限售	38.18	38.90	28	1,069.04	1,089.20	-
688709	成都华微	2024年1月31日	1-6个月(含)	新股限售	15.69	18.79	195	3,059.55	3,664.05	-

6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024年5月6日	重大事项停牌	12.35	2024年7月8日	9.88	7,600	107,946.80	93,860.00	-
002610	ST 爱康	2024年6月19日	重大事项停牌	0.01	-	-	85,600	145,025.00	856.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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。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。本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小，在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（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 6.4.12。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。于 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、清算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,181,955.69	-	-	-	3,181,955.69
结算备付金	9,140,594.96	-	-	-	9,140,594.96
存出保证金	-	-	-	927,134.40	927,134.40
交易性金融资产	-	-	-	67,213,178.13	67,213,178.13
应收申购款	-	-	-	25,754.51	25,754.51
资产总计	12,322,550.65	-	-	68,166,067.04	80,488,617.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	139,357.05	139,357.05
应付管理人报酬	-	-	-	41,316.06	41,316.06
应付托管费	-	-	-	10,329.06	10,329.06
应付销售服务费	-	-	-	6,775.36	6,775.36
应交税费	-	-	-	204.28	204.28
其他负债	-	-	-	93,202.51	93,202.51
负债总计	-	-	-	291,184.32	291,184.32
利率敏感度缺口	12,322,550.65	-	-	67,874,882.72	80,197,433.37
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	4,027,039.55	-	-	-	4,027,039.55
结算备付金	4,957,718.15	-	-	-	4,957,718.15
交易性金融资产	-	-	-	129,428,730.01	129,428,730.01
应收申购款	-	-	-	166,104.59	166,104.59
资产总计	8,984,757.70	-	-	129,594,834.60	138,579,592.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	217,962.40	217,962.40
应付管理人报酬	-	-	-	70,805.01	70,805.01
应付托管费	-	-	-	17,701.23	17,701.23
应付销售服务费	-	-	-	19,519.43	19,519.43
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	505,988.12	505,988.12
利率敏感度缺口	8,984,757.70	-	-	129,088,846.48	138,073,604.18

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，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)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 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	67,213,178.13	83.81	129,428,730.01	93.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产 — 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	67,213,178.13	83.81	129,428,730.01	93.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	4,335,287.25	6,389,374.50
	业绩比较基准下降5%	-4,335,287.25	-6,389,374.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	67,061,072.68	129,153,521.50
第二层次	93,860.00	-
第三层次	58,245.45	275,208.51
合计	67,213,178.13	129,428,730.01

6.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	67,213,178.13	83.51
	其中：股票	67,213,178.13	83.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,322,550.65	15.31
8	其他各项资产	952,888.91	1.18
9	合计	80,488,617.69	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	457,296.00	0.57
B	采矿业	2,099,593.00	2.62
C	制造业	41,647,928.95	51.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,055,226.06	3.81
E	建筑业	1,249,566.00	1.56
F	批发和零售业	2,921,003.00	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	3,160,080.60	3.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,152,184.38	5.18
J	金融业	3,084,790.45	3.85
K	房地产业	815,507.80	1.02
L	租赁和商务服务业	1,440,268.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	779,740.44	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	1,285,518.40	1.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	304,534.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	610,469.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	67,063,706.08	83.62

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	149,472.05	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	149,472.05	0.19

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002745	木林森	47,600	383,656.00	0.48
2	000420	吉林化纤	112,100	354,236.00	0.44
3	601918	新集能源	36,100	351,975.00	0.44
4	002416	爱施德	39,400	348,690.00	0.43
5	002221	东华能源	42,400	348,104.00	0.43
6	000727	冠捷科技	157,500	324,450.00	0.40
7	688556	高测股份	26,971	320,685.19	0.40
8	600577	精达股份	79,500	315,615.00	0.39
9	600033	福建高速	92,900	311,215.00	0.39
10	002402	和而泰	28,900	309,519.00	0.39

11	000543	皖能电力	34,800	307,980.00	0.38
12	000030	富奥股份	62,700	307,857.00	0.38
13	000016	深康佳 A	144,000	306,720.00	0.38
14	002549	凯美特气	58,400	298,424.00	0.37
15	601333	广深铁路	92,100	298,404.00	0.37
16	002434	万里扬	60,200	294,980.00	0.37
17	688389	普门科技	18,109	294,452.34	0.37
18	600761	安徽合力	13,600	294,304.00	0.37
19	688383	新益昌	5,621	292,910.31	0.37
20	000567	海德股份	51,745	290,289.45	0.36
21	600643	爱建集团	76,600	288,782.00	0.36
22	603393	新天然气	8,200	284,868.00	0.36
23	601975	招商南油	79,300	284,687.00	0.35
24	002139	拓邦股份	26,800	284,616.00	0.35
25	688388	嘉元科技	29,034	283,081.50	0.35
26	600210	紫江企业	53,000	281,960.00	0.35
27	002091	江苏国泰	41,200	280,572.00	0.35
28	688409	富创精密	7,579	279,968.26	0.35
29	300741	华宝股份	17,900	272,796.00	0.34
30	002237	恒邦股份	23,700	272,787.00	0.34
31	002010	传化智联	70,800	271,872.00	0.34
32	002099	海翔药业	53,000	270,830.00	0.34
32	300182	捷成股份	73,000	270,830.00	0.34
33	002456	欧菲光	34,500	269,445.00	0.34
34	601778	晶科科技	118,100	269,268.00	0.34
35	000488	晨鸣纸业	76,900	266,074.00	0.33
36	002467	二六三	79,500	265,530.00	0.33
37	603588	高能环境	42,200	265,016.00	0.33
38	002048	宁波华翔	20,000	258,800.00	0.32
39	600458	时代新材	25,500	257,550.00	0.32
40	002318	久立特材	11,000	256,630.00	0.32
41	002249	大洋电机	54,220	256,460.60	0.32
42	002053	云南能投	21,200	256,308.00	0.32
43	000503	国新健康	38,000	253,460.00	0.32
44	002839	张家港行	62,400	250,848.00	0.31
45	002079	苏州固锝	29,200	248,784.00	0.31
46	601908	京运通	98,300	248,699.00	0.31
47	603871	嘉友国际	14,040	248,367.60	0.31
48	600269	赣粤高速	47,600	246,092.00	0.31
49	002183	怡亚通	86,000	244,240.00	0.30
50	000813	德展健康	116,900	243,152.00	0.30
51	605009	豪悦护理	6,100	240,584.00	0.30
52	000735	罗牛山	55,400	239,882.00	0.30

53	002274	华昌化工	32,300	239,666.00	0.30
54	002701	奥瑞金	57,500	239,200.00	0.30
55	000915	华特达因	7,900	238,264.00	0.30
56	002127	南极电商	91,600	238,160.00	0.30
57	600320	振华重工	69,500	237,690.00	0.30
58	002204	大连重工	55,600	237,412.00	0.30
59	601222	林洋能源	37,600	235,752.00	0.29
60	603718	海利生物	37,800	233,226.00	0.29
61	600323	瀚蓝环境	11,100	231,990.00	0.29
62	600057	厦门象屿	34,100	231,880.00	0.29
63	002421	达实智能	99,300	231,369.00	0.29
64	600252	中恒集团	106,300	230,671.00	0.29
65	300409	道氏技术	26,900	230,264.00	0.29
66	002967	广电计量	19,500	230,100.00	0.29
67	002126	银轮股份	13,200	229,812.00	0.29
68	600452	涪陵电力	18,100	229,327.00	0.29
69	300679	电连技术	5,700	229,311.00	0.29
70	002043	兔宝宝	22,100	229,177.00	0.29
71	600908	无锡银行	42,900	228,228.00	0.28
72	600596	新安股份	29,800	226,480.00	0.28
73	300379	东方通	27,900	225,432.00	0.28
74	601311	骆驼股份	28,100	225,362.00	0.28
75	603323	苏农银行	46,800	225,108.00	0.28
76	601718	际华集团	90,600	224,688.00	0.28
77	600285	羚锐制药	9,100	220,311.00	0.27
78	002212	天融信	45,100	219,637.00	0.27
79	601279	英利汽车	58,700	218,951.00	0.27
80	603995	甬金股份	12,400	217,248.00	0.27
81	600667	太极实业	38,000	216,980.00	0.27
82	002100	天康生物	31,200	216,216.00	0.27
83	002948	青岛银行	63,700	214,669.00	0.27
84	300080	易成新能	74,500	214,560.00	0.27
85	600366	宁波韵升	41,000	214,020.00	0.27
86	601677	明泰铝业	18,500	213,860.00	0.27
87	000581	威孚高科	13,100	213,268.00	0.27
88	300463	迈克生物	18,700	212,806.00	0.27
89	002214	大立科技	18,800	212,064.00	0.26
90	300428	立中集团	11,400	211,926.00	0.26
91	300035	中科电气	24,900	211,899.00	0.26
92	300303	聚飞光电	43,400	210,924.00	0.26
93	002004	华邦健康	55,500	210,900.00	0.26
94	002081	金螳螂	69,200	209,676.00	0.26
95	000990	诚志股份	28,000	208,320.00	0.26

96	600312	平高电气	10,700	208,115.00	0.26
97	300026	红日药业	68,100	207,705.00	0.26
98	601375	中原证券	60,900	207,669.00	0.26
99	000761	本钢板材	82,700	207,577.00	0.26
100	000686	东北证券	37,200	207,576.00	0.26
101	000951	中国重汽	14,400	206,208.00	0.26
102	600971	恒源煤电	17,100	204,174.00	0.25
103	300725	药石科技	7,600	203,452.00	0.25
104	300232	洲明科技	38,800	202,536.00	0.25
105	600757	长江传媒	25,100	202,306.00	0.25
106	600037	歌华有线	33,600	200,928.00	0.25
107	600409	三友化工	39,800	199,796.00	0.25
108	600718	东软集团	24,000	198,480.00	0.25
109	000035	中国天楹	43,600	197,508.00	0.25
110	605589	圣泉集团	9,700	196,813.00	0.25
111	600502	安徽建工	45,600	196,080.00	0.24
112	603368	柳药集团	11,200	196,000.00	0.24
113	600586	金晶科技	33,700	195,460.00	0.24
114	002489	浙江永强	82,300	195,051.00	0.24
115	600710	苏美达	23,900	194,785.00	0.24
116	000923	河钢资源	11,300	194,586.00	0.24
117	301205	联特科技	3,100	194,525.00	0.24
118	600750	江中药业	8,400	194,124.00	0.24
119	688289	圣湘生物	11,036	194,012.88	0.24
120	688372	伟测科技	4,920	193,503.60	0.24
121	002270	华明装备	8,700	193,488.00	0.24
122	603301	振德医疗	9,200	191,912.00	0.24
123	600618	氯碱化工	21,800	191,404.00	0.24
124	688167	炬光科技	3,480	191,400.00	0.24
125	600645	中源协和	11,800	189,980.00	0.24
126	002239	奥特佳	82,500	189,750.00	0.24
127	600125	铁龙物流	31,700	189,249.00	0.24
128	600812	华北制药	45,600	187,872.00	0.23
129	000650	仁和药业	31,500	185,850.00	0.23
130	002291	遥望科技	42,800	184,040.00	0.23
131	002020	京新药业	17,500	183,225.00	0.23
132	600562	国睿科技	13,400	183,044.00	0.23
133	002108	沧州明珠	59,600	182,376.00	0.23
134	688680	海优新材	6,320	181,636.80	0.23
135	000969	安泰科技	22,800	180,804.00	0.23
136	603489	八方股份	6,700	180,766.00	0.23
137	600163	中闽能源	37,500	180,750.00	0.23
138	600874	创业环保	32,100	179,439.00	0.22

139	300352	北信源	46,700	179,328.00	0.22
140	002597	金禾实业	9,000	179,010.00	0.22
141	300170	汉得信息	29,100	178,674.00	0.22
142	600496	精工钢构	69,700	178,432.00	0.22
143	000821	京山轻机	15,600	176,748.00	0.22
144	002215	诺普信	23,700	176,565.00	0.22
145	600100	同方股份	34,600	176,114.00	0.22
146	002332	仙琚制药	15,400	175,714.00	0.22
147	002545	东方铁塔	25,800	175,698.00	0.22
148	002807	江阴银行	46,600	175,682.00	0.22
149	300482	万孚生物	7,200	175,680.00	0.22
150	600835	上海机电	15,200	174,952.00	0.22
151	601969	海南矿业	27,500	174,350.00	0.22
152	600572	康恩贝	39,000	174,330.00	0.22
153	600267	海正药业	24,800	174,096.00	0.22
154	000927	中国铁物	72,900	173,502.00	0.22
155	600059	古越龙山	21,800	173,092.00	0.22
156	002585	双星新材	34,700	172,112.00	0.21
157	301069	凯盛新材	13,100	171,741.00	0.21
158	002832	比音勒芬	7,100	171,607.00	0.21
159	002135	东南网架	43,000	170,280.00	0.21
160	000690	宝新能源	33,200	169,320.00	0.21
161	002453	华软科技	39,400	169,026.00	0.21
162	600728	佳都科技	45,500	168,805.00	0.21
163	002233	塔牌集团	23,000	168,130.00	0.21
164	601860	紫金银行	67,200	168,000.00	0.21
165	000426	兴业银锡	12,300	167,034.00	0.21
166	000685	中山公用	23,100	166,551.00	0.21
167	603567	珍宝岛	15,800	166,374.00	0.21
168	002468	申通快递	19,800	166,320.00	0.21
169	002697	红旗连锁	35,900	166,217.00	0.21
170	603169	兰石重装	36,800	165,600.00	0.21
171	002537	海联金汇	32,000	165,440.00	0.21
172	600075	新疆天业	47,900	165,255.00	0.21
173	300451	创业慧康	47,400	164,004.00	0.20
174	002961	瑞达期货	14,900	163,155.00	0.20
175	300166	东方国信	26,600	162,792.00	0.20
176	600717	天津港	38,000	162,260.00	0.20
177	000811	冰轮环境	16,800	162,120.00	0.20
178	601187	厦门银行	30,300	161,499.00	0.20
179	600797	浙大网新	34,500	159,735.00	0.20
180	002746	仙坛股份	27,800	159,294.00	0.20
181	600063	皖维高新	45,200	159,104.00	0.20

182	000065	北方国际	15,300	158,661.00	0.20
183	300772	运达股份	16,500	158,400.00	0.20
184	600810	神马股份	25,300	156,860.00	0.20
185	600185	格力地产	36,900	156,825.00	0.20
186	601678	滨化股份	45,000	156,600.00	0.20
187	002267	陕天然气	20,700	156,492.00	0.20
188	000028	国药一致	4,800	154,704.00	0.19
189	300587	天铁股份	38,100	153,924.00	0.19
190	002283	天润工业	35,700	153,153.00	0.19
191	002906	华阳集团	5,700	152,532.00	0.19
192	002837	英维克	7,100	151,869.00	0.19
193	300049	福瑞股份	3,000	151,020.00	0.19
194	603699	纽威股份	8,800	150,656.00	0.19
195	603113	金能科技	27,500	150,425.00	0.19
196	000935	四川双马	12,500	150,125.00	0.19
197	001323	慕思股份	5,200	149,604.00	0.19
198	000795	英洛华	27,000	149,580.00	0.19
199	601200	上海环境	17,500	148,750.00	0.19
200	688707	振华新材	15,178	147,833.72	0.18
201	002061	浙江交科	40,400	147,460.00	0.18
202	002034	旺能环境	11,300	147,013.00	0.18
203	002705	新宝股份	10,400	146,328.00	0.18
204	000848	承德露露	18,600	146,196.00	0.18
205	002617	露笑科技	30,300	145,440.00	0.18
206	301239	普瑞眼科	4,100	144,853.00	0.18
207	300263	隆华科技	25,800	144,480.00	0.18
208	300702	天宇股份	8,100	144,423.00	0.18
209	600395	盘江股份	24,000	144,240.00	0.18
210	601528	瑞丰银行	30,500	143,960.00	0.18
211	603666	亿嘉和	9,100	143,598.00	0.18
212	600966	博汇纸业	29,600	141,488.00	0.18
213	300323	华灿光电	32,400	140,940.00	0.18
214	600963	岳阳林纸	38,000	139,460.00	0.17
215	603279	景津装备	6,400	138,816.00	0.17
216	600888	新疆众和	19,600	138,572.00	0.17
217	000415	渤海租赁	54,100	137,955.00	0.17
218	600604	市北高新	39,500	136,670.00	0.17
219	600976	健民集团	2,700	136,350.00	0.17
220	688586	江航装备	14,643	136,179.90	0.17
221	300294	博雅生物	4,100	135,300.00	0.17
222	002583	海能达	33,000	134,310.00	0.17
223	000600	建投能源	21,300	134,190.00	0.17
224	600007	中国国贸	6,100	133,956.00	0.17

225	600787	中储股份	27,800	133,718.00	0.17
226	300143	盈康生命	17,700	133,281.00	0.17
227	300382	斯莱克	22,500	132,975.00	0.17
228	600649	城投控股	39,900	132,468.00	0.17
229	600929	雪天盐业	24,700	130,910.00	0.16
230	300674	宇信科技	11,800	130,744.00	0.16
231	300369	绿盟科技	25,500	130,305.00	0.16
232	601369	陕鼓动力	16,200	129,924.00	0.16
233	600821	金开新能	25,200	129,528.00	0.16
234	600403	大有能源	49,900	128,742.00	0.16
235	000902	新洋丰	10,800	128,196.00	0.16
236	600305	恒顺醋业	17,400	125,802.00	0.16
237	600993	马应龙	4,700	125,349.00	0.16
238	301071	力量钻石	4,500	124,695.00	0.16
239	002516	旷达科技	34,100	124,124.00	0.15
240	688050	爱博医疗	1,691	123,984.12	0.15
241	002320	海峡股份	24,000	123,840.00	0.15
242	002123	梦网科技	17,600	123,728.00	0.15
243	002349	精华制药	18,800	123,328.00	0.15
244	688739	成大生物	5,063	122,727.12	0.15
245	600740	山西焦化	31,300	122,696.00	0.15
246	300783	三只松鼠	5,600	122,472.00	0.15
247	301175	中科环保	27,600	121,164.00	0.15
248	002038	双鹭药业	16,400	120,868.00	0.15
249	002649	博彦科技	15,100	120,196.00	0.15
250	600073	上海梅林	21,800	120,118.00	0.15
251	300953	震裕科技	2,200	119,240.00	0.15
252	002190	成飞集成	8,400	118,608.00	0.15
253	300119	瑞普生物	8,700	118,494.00	0.15
254	600363	联创光电	4,300	118,336.00	0.15
255	002390	信邦制药	35,700	118,167.00	0.15
256	601099	太平洋	38,700	118,035.00	0.15
257	688315	诺禾致源	10,777	117,684.84	0.15
258	600916	中国黄金	12,200	117,364.00	0.15
259	000597	东北制药	30,100	116,487.00	0.15
260	300415	伊之密	5,600	116,368.00	0.15
261	600313	农发种业	20,400	114,036.00	0.14
262	300267	尔康制药	54,800	113,984.00	0.14
263	600123	兰花科创	12,700	113,665.00	0.14
264	600648	外高桥	12,800	113,408.00	0.14
265	300134	大富科技	16,600	113,212.00	0.14
266	000869	张裕 A	5,300	113,155.00	0.14
267	603281	江瀚新材	5,000	112,250.00	0.14

268	600651	飞乐音响	40,600	112,056.00	0.14
269	002216	三全食品	10,100	110,898.00	0.14
270	688798	艾为电子	1,957	110,805.34	0.14
271	000758	中色股份	21,800	110,744.00	0.14
272	600635	大众公用	41,200	110,416.00	0.14
273	002226	江南化工	24,500	109,760.00	0.14
274	002782	可立克	9,900	109,692.00	0.14
275	301216	万凯新材	9,700	108,543.00	0.14
276	002488	金固股份	24,700	108,433.00	0.14
277	001213	中铁特货	27,400	108,230.00	0.13
278	603609	禾丰股份	16,500	107,910.00	0.13
279	603008	喜临门	6,200	107,446.00	0.13
280	688266	泽璟制药	1,980	107,355.60	0.13
281	002911	佛燃能源	11,729	107,203.06	0.13
282	603915	国茂股份	10,300	105,987.00	0.13
283	300850	新强联	7,000	105,140.00	0.13
284	601326	秦港股份	33,000	104,610.00	0.13
285	600780	通宝能源	17,700	104,430.00	0.13
286	600623	华谊集团	18,000	104,040.00	0.13
287	002550	千红制药	19,100	102,949.00	0.13
288	300827	上能电气	4,600	102,856.00	0.13
289	600751	海航科技	45,900	101,898.00	0.13
290	002567	唐人神	19,000	101,840.00	0.13
291	603229	奥翔药业	10,100	101,505.00	0.13
292	600206	有研新材	11,400	101,460.00	0.13
293	688596	正帆科技	3,048	100,584.00	0.13
294	605333	沪光股份	3,600	100,260.00	0.13
295	300079	数码视讯	24,600	99,876.00	0.12
296	688139	海尔生物	2,674	99,472.80	0.12
297	600012	皖通高速	7,100	99,187.00	0.12
298	600508	上海能源	7,000	99,050.00	0.12
299	002191	劲嘉股份	26,900	97,109.00	0.12
300	688023	安恒信息	2,424	96,984.24	0.12
301	601137	博威合金	6,300	96,012.00	0.12
302	603906	龙蟠科技	12,300	95,817.00	0.12
303	000061	农产品	19,700	95,742.00	0.12
304	601101	昊华能源	10,400	95,576.00	0.12
305	603938	三孚股份	8,100	95,175.00	0.12
306	603477	巨星农牧	3,300	94,710.00	0.12
307	002176	江特电机	11,500	93,725.00	0.12
308	002895	川恒股份	5,100	93,381.00	0.12
309	300363	博腾股份	7,700	92,015.00	0.11
310	603583	捷昌驱动	4,500	91,710.00	0.11

311	001236	弘业期货	12,800	91,008.00	0.11
312	601886	江河集团	18,600	90,768.00	0.11
313	600601	方正科技	30,200	90,600.00	0.11
314	603055	台华新材	8,900	90,157.00	0.11
315	601107	四川成渝	17,000	89,250.00	0.11
316	002941	新疆交建	8,900	88,822.00	0.11
317	000837	秦川机床	12,000	88,320.00	0.11
318	601619	嘉泽新能	28,900	87,567.00	0.11
319	002101	广东鸿图	8,300	87,399.00	0.11
320	688321	微芯生物	4,953	87,172.80	0.11
321	600595	中孚实业	34,900	86,901.00	0.11
322	603565	中谷物流	9,900	86,526.00	0.11
323	603328	依顿电子	11,000	86,460.00	0.11
324	688598	金博股份	3,053	86,399.90	0.11
325	688031	星环科技	2,353	86,378.63	0.11
326	600428	中远海特	14,000	85,680.00	0.11
327	600559	老白干酒	4,700	85,446.00	0.11
328	603297	永新光学	1,400	84,686.00	0.11
329	002681	奋达科技	23,000	83,950.00	0.10
330	603358	华达科技	2,900	83,665.00	0.10
331	600120	浙江东方	24,800	82,832.00	0.10
332	002317	众生药业	7,200	82,296.00	0.10
333	002581	未名医药	8,400	81,060.00	0.10
334	002088	鲁阳节能	6,600	79,794.00	0.10
335	002145	中核钛白	24,300	79,704.00	0.10
336	600335	国机汽车	13,800	79,626.00	0.10
337	000029	深深房 A	7,400	78,662.00	0.10
338	600729	重庆百货	3,500	78,260.00	0.10
339	600389	江山股份	5,500	77,605.00	0.10
340	600017	日照港	28,900	77,163.00	0.10
341	300257	开山股份	7,600	76,760.00	0.10
342	002287	奇正藏药	3,900	76,362.00	0.10
343	600248	陕建股份	21,000	76,230.00	0.10
344	603013	亚普股份	5,600	75,432.00	0.09
345	300358	楚天科技	10,100	75,144.00	0.09
346	002901	大博医疗	2,900	74,907.00	0.09
347	600422	昆药集团	4,200	74,886.00	0.09
348	300705	九典制药	2,800	74,872.00	0.09
349	000917	电广传媒	14,700	74,235.00	0.09
350	600575	淮河能源	18,700	72,743.00	0.09
351	600782	新钢股份	21,900	72,708.00	0.09
352	601952	苏垦农发	8,000	72,160.00	0.09
353	002060	广东建工	21,000	71,820.00	0.09

354	600507	方大特钢	18,900	70,686.00	0.09
355	300761	立华股份	3,100	70,184.00	0.09
356	605507	国邦医药	4,200	69,930.00	0.09
357	600688	上海石化	26,700	69,687.00	0.09
358	003039	顺控发展	5,500	68,915.00	0.09
359	688578	艾力斯	1,070	68,201.80	0.09
360	603599	广信股份	5,600	67,928.00	0.08
361	688016	心脉医疗	691	67,752.55	0.08
362	600459	贵研铂业	5,000	67,550.00	0.08
363	300775	三角防务	2,200	67,320.00	0.08
364	300821	东岳硅材	9,800	67,032.00	0.08
365	000968	蓝焰控股	10,500	66,780.00	0.08
366	000672	上峰水泥	10,900	66,708.00	0.08
367	600420	国药现代	6,200	66,216.00	0.08
368	000928	中钢国际	11,800	65,490.00	0.08
369	601163	三角轮胎	4,300	65,446.00	0.08
370	300315	掌趣科技	15,600	65,052.00	0.08
371	001311	多利科技	2,680	64,802.40	0.08
372	000090	天健集团	16,000	64,320.00	0.08
373	600116	三峡水利	9,300	64,170.00	0.08
374	600201	生物股份	8,900	64,169.00	0.08
375	603881	数据港	5,020	63,804.20	0.08
376	002727	一心堂	4,200	63,378.00	0.08
377	000555	神州信息	6,800	63,376.00	0.08
378	603766	隆鑫通用	9,300	63,054.00	0.08
379	002773	康弘药业	2,900	62,785.00	0.08
380	300869	康泰医学	4,800	62,736.00	0.08
381	000429	粤高速 A	6,000	62,460.00	0.08
382	600711	盛屯矿业	17,000	62,390.00	0.08
383	600477	杭萧钢构	26,700	62,211.00	0.08
384	300456	赛微电子	3,900	61,893.00	0.08
385	002276	万马股份	8,600	61,662.00	0.08
386	603063	禾望电气	4,000	61,320.00	0.08
387	688789	宏华数科	565	60,907.00	0.08
388	603556	海兴电力	1,300	60,879.00	0.08
389	605222	起帆电缆	3,800	58,292.00	0.07
390	000582	北部湾港	7,800	58,032.00	0.07
391	300737	科顺股份	13,300	57,190.00	0.07
392	300039	上海凯宝	10,600	56,710.00	0.07
393	002250	联化科技	11,700	56,160.00	0.07
394	603299	苏盐井神	5,900	56,050.00	0.07
395	001338	永顺泰	5,700	55,860.00	0.07
396	688366	昊海生科	904	55,758.72	0.07

397	000088	盐田港	12,300	55,719.00	0.07
398	002389	航天彩虹	4,000	55,560.00	0.07
399	600064	南京高科	9,140	55,479.80	0.07
400	688177	百奥泰	2,609	55,102.08	0.07
401	002643	万润股份	5,500	55,000.00	0.07
402	002254	泰和新材	6,200	54,870.00	0.07
403	601811	新华文轩	3,900	54,639.00	0.07
404	002484	江海股份	4,100	54,325.00	0.07
405	301087	可孚医疗	1,600	54,240.00	0.07
406	002859	洁美科技	2,700	54,216.00	0.07
407	600480	凌云股份	5,500	54,065.00	0.07
408	688033	天宜上佳	8,926	53,556.00	0.07
409	300770	新媒股份	1,600	53,408.00	0.07
410	002960	青鸟消防	4,200	53,088.00	0.07
411	002041	登海种业	6,500	52,520.00	0.07
412	002946	新乳业	5,900	51,684.00	0.06
413	002646	天佑德酒	5,000	51,150.00	0.06
414	000828	东莞控股	5,600	50,456.00	0.06
415	002461	珠江啤酒	6,700	49,714.00	0.06
416	688526	科前生物	3,364	49,417.16	0.06
417	300034	钢研高纳	3,100	49,259.00	0.06
418	688408	中信博	534	49,170.72	0.06
419	603985	恒润股份	4,100	48,790.00	0.06
420	002511	中顺洁柔	7,000	48,440.00	0.06
421	601609	金田股份	8,500	48,110.00	0.06
422	688106	金宏气体	2,710	47,479.20	0.06
423	002978	安宁股份	1,700	47,362.00	0.06
424	600662	外服控股	11,700	46,917.00	0.06
425	603876	鼎胜新材	5,000	46,350.00	0.06
426	603638	艾迪精密	3,300	46,299.00	0.06
427	000557	西部创业	12,200	45,872.00	0.06
428	603733	仙鹤股份	2,600	45,708.00	0.06
429	002154	报喜鸟	8,400	45,696.00	0.06
430	002612	朗姿股份	3,300	45,606.00	0.06
431	000762	西藏矿业	2,500	45,200.00	0.06
432	600685	中船防务	1,600	44,640.00	0.06
433	301268	铭利达	2,800	43,540.00	0.05
434	601801	皖新传媒	6,200	42,966.00	0.05
435	300573	兴齐眼药	260	42,640.00	0.05
436	600776	东方通信	4,300	42,269.00	0.05
437	600556	天下秀	11,600	42,224.00	0.05
438	002315	焦点科技	1,500	40,440.00	0.05
439	002245	蔚蓝锂芯	5,200	40,300.00	0.05

440	603100	川仪股份	1,700	39,967.00	0.05
441	002063	远光软件	7,600	39,824.00	0.05
442	002737	葵花药业	1,700	39,746.00	0.05
443	601921	浙版传媒	5,200	39,728.00	0.05
444	600877	电科芯片	3,700	39,664.00	0.05
445	600478	科力远	10,500	39,585.00	0.05
446	000767	晋控电力	16,900	39,377.00	0.05
447	002077	大港股份	3,300	39,336.00	0.05
448	000550	江铃汽车	1,800	39,078.00	0.05
449	002534	西子洁能	3,900	39,039.00	0.05
450	600882	妙可蓝多	3,100	38,657.00	0.05
451	300773	拉卡拉	3,100	38,533.00	0.05
452	002396	星网锐捷	2,900	38,309.00	0.05
453	001308	康冠科技	1,700	38,250.00	0.05
454	600110	诺德股份	12,400	37,820.00	0.05
455	600328	中盐化工	5,500	37,730.00	0.05
456	600771	广誉远	2,000	37,660.00	0.05
457	002003	伟星股份	3,000	37,650.00	0.05
458	603033	三维股份	3,200	37,440.00	0.05
459	600197	伊力特	2,100	37,401.00	0.05
460	002539	云图控股	5,100	36,363.00	0.05
461	000875	吉电股份	6,800	36,244.00	0.05
462	688019	安集科技	281	35,349.80	0.04
463	688091	上海谊众	1,560	35,240.40	0.04
464	301080	百普赛斯	1,000	35,000.00	0.04
465	002405	四维图新	5,500	34,210.00	0.04
466	000517	荣安地产	12,300	32,964.00	0.04
467	300298	三诺生物	1,300	32,942.00	0.04
468	300113	顺网科技	3,200	32,768.00	0.04
469	600864	哈投股份	6,800	32,300.00	0.04
470	002171	楚江新材	4,900	32,291.00	0.04
471	000970	中科三环	4,200	32,130.00	0.04
472	001914	招商积余	3,200	32,064.00	0.04
473	688403	汇成股份	3,767	31,944.16	0.04
474	600446	金证股份	3,200	31,776.00	0.04
475	002302	西部建设	6,100	31,720.00	0.04
476	600639	浦东金桥	3,100	31,651.00	0.04
477	603566	普莱柯	2,300	31,234.00	0.04
478	600217	中再资环	8,200	30,832.00	0.04
479	603306	华懋科技	1,700	30,719.00	0.04
480	603057	紫燕食品	2,000	30,640.00	0.04
481	300660	江苏雷利	1,200	30,624.00	0.04
482	300910	瑞丰新材	700	30,604.00	0.04

483	002242	九阳股份	2,900	30,392.00	0.04
484	002015	协鑫能科	3,800	30,248.00	0.04
485	688083	中望软件	412	29,919.44	0.04
486	600055	万东医疗	2,300	28,405.00	0.04
487	300332	天壕能源	5,200	27,612.00	0.03
488	300693	盛弘股份	1,300	27,222.00	0.03
489	300244	迪安诊断	2,200	26,400.00	0.03
490	300188	国投智能	2,300	25,553.00	0.03
491	600273	嘉化能源	3,500	24,990.00	0.03
492	600773	西藏城投	2,400	24,768.00	0.03
493	600461	洪城环境	2,100	24,318.00	0.03
494	002446	盛路通信	4,300	24,295.00	0.03
495	300735	光弘科技	1,100	23,760.00	0.03
496	300820	英杰电气	600	23,604.00	0.03
497	600850	电科数字	1,300	23,530.00	0.03
498	600597	光明乳业	3,000	23,310.00	0.03
499	300747	锐科激光	1,300	23,075.00	0.03
500	600456	宝钛股份	900	22,977.00	0.03
501	002023	海特高新	2,500	22,875.00	0.03
502	600211	西藏药业	700	22,806.00	0.03
503	603983	丸美股份	800	22,024.00	0.03
504	002163	海南发展	4,000	21,920.00	0.03
505	300236	上海新阳	700	21,798.00	0.03
506	301078	孩子王	4,200	21,252.00	0.03
507	002498	汉缆股份	6,300	20,727.00	0.03
508	601963	重庆银行	2,600	20,150.00	0.03
509	600475	华光环能	2,300	20,033.00	0.02
510	300123	亚光科技	4,300	19,952.00	0.02
511	688630	芯碁微装	316	19,772.12	0.02
512	300183	东软载波	1,700	19,686.00	0.02
513	688270	臻镭科技	610	15,921.00	0.02
514	300077	国民技术	1,800	15,714.00	0.02
515	300393	中来股份	2,700	15,579.00	0.02
516	002222	福晶科技	690	15,545.70	0.02
517	002706	良信股份	2,200	15,092.00	0.02
518	000712	锦龙股份	2,000	15,000.00	0.02
519	688048	长光华芯	448	13,995.52	0.02
520	688158	优刻得	1,269	12,981.87	0.02
521	688400	凌云光	683	11,392.44	0.01
522	605365	立达信	500	7,935.00	0.01
523	002635	安洁科技	500	7,720.00	0.01
524	301090	华润材料	1,100	7,238.00	0.01
525	301015	百洋医药	300	7,059.00	0.01

526	601033	永兴股份	165	2,633.40	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300630	普利制药	7,600	93,860.00	0.12
2	301589	诺瓦星云	212	39,858.12	0.05
3	688709	成都华微	195	3,664.05	0.00
4	301502	华阳智能	86	3,253.38	0.00
5	603082	北自科技	58	1,710.42	0.00
6	001387	雪祺电气	102	1,555.50	0.00
7	603325	博隆技术	19	1,293.14	0.00
8	001379	腾达科技	94	1,267.12	0.00
9	603375	盛景微	28	1,089.20	0.00
10	603312	西典新能	42	1,065.12	0.00
11	002610	ST 爱康	85,600	856.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	601011	宝泰隆	2,730,151.00	1.98
2	002145	中核钛白	2,579,048.00	1.87
3	688322	奥比中光	2,543,789.14	1.84
4	000426	兴业银锡	2,543,731.00	1.84
5	600225	卓朗科技	2,538,377.00	1.84
6	300158	振东制药	2,524,222.00	1.83
7	000690	宝新能源	2,353,675.00	1.70
8	300188	国投智能	2,336,392.00	1.69
9	601212	白银有色	2,317,940.00	1.68
10	601918	新集能源	2,315,333.00	1.68
11	688707	振华新材	2,280,170.26	1.65
12	688133	泰坦科技	2,275,948.81	1.65
13	002807	江阴银行	2,257,833.00	1.64
14	600151	航天机电	2,211,368.99	1.60
15	600266	城建发展	2,169,561.00	1.57
16	688326	经纬恒润	2,166,119.82	1.57
17	301239	普瑞眼科	2,155,071.00	1.56
18	002217	*ST 合泰	2,139,901.00	1.55
19	000818	航锦科技	2,136,956.00	1.55
20	688333	铂力特	2,131,713.75	1.54

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600225	卓朗科技	3,397,607.00	2.46
2	601918	新集能源	3,244,804.00	2.35
3	600266	城建发展	3,090,925.00	2.24
4	600780	通宝能源	2,815,275.00	2.04
5	300079	数码视讯	2,632,378.57	1.91
6	688322	奥比中光	2,543,575.95	1.84
7	601011	宝泰隆	2,521,974.00	1.83
8	000426	兴业银锡	2,433,450.00	1.76
9	300188	国投智能	2,420,350.00	1.75
10	601212	白银有色	2,393,936.00	1.73
11	600662	外服控股	2,353,753.00	1.70
12	000528	柳工	2,347,285.80	1.70
13	002145	中核钛白	2,345,438.20	1.70
14	600578	京能电力	2,309,685.00	1.67
15	000761	本钢板材	2,297,301.00	1.66
16	000560	我爱我家	2,225,468.00	1.61
17	300158	振东制药	2,222,349.00	1.61
18	600770	综艺股份	2,221,694.00	1.61
19	688598	金博股份	2,206,529.10	1.60
20	603098	森特股份	2,204,418.00	1.60

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	671,874,333.46
卖出股票收入（成交）总额	713,118,524.14

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	927,134.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	25,754.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	952,888.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300630	普利制药	93,860.00	0.12	重大事项停牌
2	301589	诺瓦星云	39,858.12	0.05	新股限售
3	688709	成都华微	3,664.05	0.00	新股限售
4	301502	华阳智能	3,253.38	0.00	新股限售
5	603082	北自科技	1,710.42	0.00	新股限售

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华安中证 1000 指数增强 A	1,688	50,138.20	413,102.38	0.49	84,220,182.79	99.51
华安中证 1000 指数增强 C	907	30,675.11	4,353,072.27	15.65	23,469,249.12	84.35
合计	2,595	43,335.49	4,766,174.65	4.24	107,689,431.91	95.76

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安中证 1000 指数增强 A	7,081.58	0.01
	华安中证 1000 指数增强 C	-	-
	合计	7,081.58	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 7 月 12 日）基金份额总额	174,819,963.48	61,538,729.33
本报告期期初基金份额总额	92,028,836.99	64,731,386.21
本报告期基金总申购份额	5,477,610.07	14,972,540.32
减：本报告期基金总赎回份额	12,873,161.89	51,881,605.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	84,633,285.17	27,822,321.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	2	1,384,805,846.10	100.00	718,838.76	100.00	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 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) 研究服务能力较强，有较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，能

够针对本基金投资运作管理需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

(3) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的尽职调查

由相关部门牵头依据上述交易单元选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调查。

(2) 完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

(3) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(4) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(5) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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 (%)

兴业证 券	259,748.42	100.00	-	-	-	-
----------	------------	--------	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于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和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 12 日
2	华安中证 1000 指数增强 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 19 日
3	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和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 24 日
4	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 12 日
5	华安中证 1000 指数增强 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
6	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和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
7	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和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
8	华安中证 1000 指数增强 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
9	华安中证 1000 指数增强 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 日
10	华安中证 1000 指数增强更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 日
11	华安中证 1000 指数增强 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中证 1000 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中证 1000 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；

12.2 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>。

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日