

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	12
§ 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	14
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 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	1,342,051,429.70 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(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	106,796.76
本期利润	7,262,752.99
加权平均基金份额本期利润	0.0052
本期加权平均净值利润率	0.71%
本期基金份额净值增长率	0.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	588,388,434.85
期末可供分配基金份额利润	0.4384
期末基金资产净值	997,342,490.97
期末基金份额净值	0.7431
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	410.14%

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）。

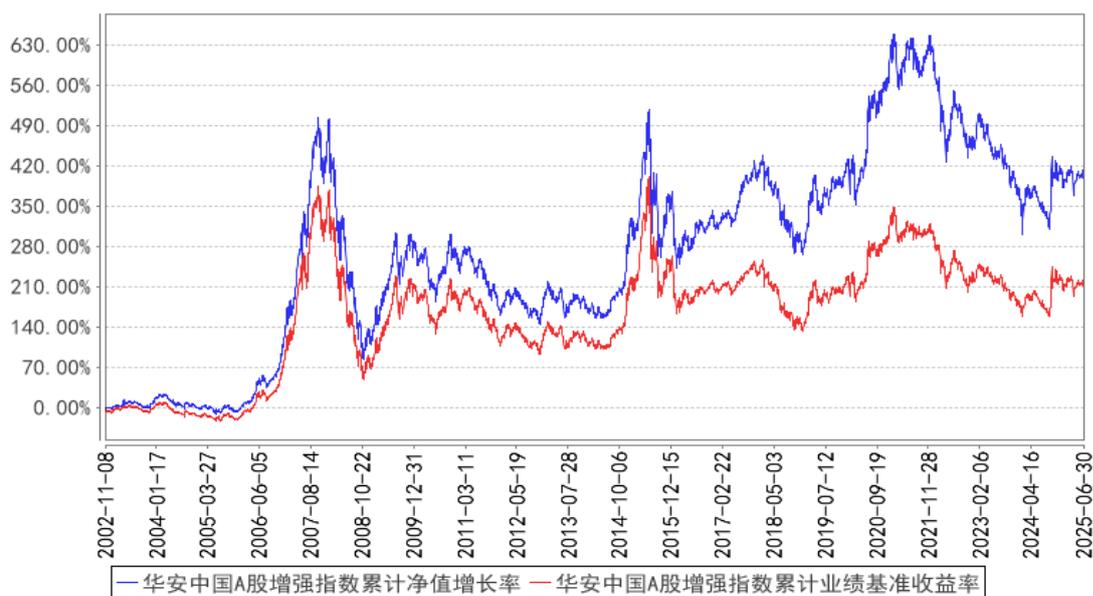
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	2.40%	0.53%	2.88%	0.58%	-0.48%	-0.05%
过去三个月	1.28%	1.06%	1.11%	1.12%	0.17%	-0.06%
过去六个月	0.68%	0.97%	0.45%	1.03%	0.23%	-0.06%
过去一年	12.93%	1.27%	14.08%	1.38%	-1.15%	-0.11%
过去三年	-21.53%	1.12%	-13.20%	1.09%	-8.33%	0.03%
自基金合同生效起至今	410.14%	1.50%	221.03%	1.47%	189.11%	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



§ 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。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、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 2025 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 283 只证券投资基金，管理资产规模达到 7,488.16 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	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。
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	2025 年 1 月 6 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

				<p>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 月至 2025 年 1 月，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 月至 2025 年 6 月，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 月至 2025 年 3 月，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</p>
--	--	--	--	---

					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。2025 年 4 月起，同时担任华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 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发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 7 月 19 日公司发布公告，2025 年 7 月 21 日起，增聘张序先生担任本基金的基金经理，马韬先生不再担任本基金的基金经理。

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业股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

2025 年上半年权益市场表现较好，资本市场整体较为活跃，热点主题不断表现，继 AI 人工智能、机器人等主题爆发之后，创新药、新消费呈现出接力之势。风格上，以银行为代表的大盘红利及小微盘指数均走出了趋势性行情。量化因子方面，无论是传统基本面因子、量价因子还是深度学习类的高频量价因子表现均较为稳定，尤其是在小盘成分股内超额收益较为显著。

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获取市场短期非理性定价带来的交易性收益。2025 年上半年，策略整体平稳运作，基金净值表现跑赢业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.7431 元，本报告期份额净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准增长率为 0.45%。

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，维持经济的平稳过渡和持续发展仍然是宏观政策的主要目标。证券市场稳中向好，在成交持续活跃的背景下各类投资机会纷纷涌现。

作为 MSCI 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、固定收益部门负责人、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

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§ 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	53,299,535.89	60,380,909.05
结算备付金		7,857,091.80	9,920,381.26
存出保证金		245,885.69	340,342.98
交易性金融资产	6.4.7.2	941,272,791.17	1,006,510,265.58
其中：股票投资		941,261,139.84	1,006,509,508.38
基金投资		-	-
债券投资		11,651.33	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	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		7,233,911.68	665,235.90
应收股利		-	-
应收申购款		71,285.96	136,217.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,009,980,502.19	1,077,953,352.12
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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		7,550,319.89	1,386,561.42
应付赎回款		1,134,884.69	2,356,092.38
应付管理人报酬		812,770.32	917,533.21
应付托管费		162,554.07	183,506.65
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	6.4.7.6	2,977,482.25	3,219,479.04
负债合计		12,638,011.22	8,063,172.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	408,954,056.12	441,725,024.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	588,388,434.85	628,165,154.93
净资产合计		997,342,490.97	1,069,890,179.42
负债和净资产总计		1,009,980,502.19	1,077,953,352.12

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7431 元，基金份额总额 1,342,051,429.70 份。

6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,474,320.25	-57,360,954.71
1. 利息收入		118,202.18	152,248.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	118,202.18	152,248.74
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）		6,195,158.80	-78,585,090.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,932,956.29	-89,889,923.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	41,938.62	31,108.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	12,086,176.47	11,273,725.01
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	7,155,956.23	21,068,713.36
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	5,003.04	3,173.39
减：二、营业总支出		6,211,567.26	5,849,081.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,092,962.71	4,777,561.26
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,018,592.49	955,512.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.16	-	-

7. 税金及附加		0.14	-
8. 其他费用	6.4.7.17	100,011.92	116,008.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,262,752.99	-63,210,036.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,262,752.99	-63,210,036.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,262,752.99	-63,210,036.52

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	441,725,024.49	-	628,165,154.93	1,069,890,179.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	441,725,024.49	-	628,165,154.93	1,069,890,179.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,770,968.37	-	-39,776,720.08	-72,547,688.45
（一）、综合收益总额	-	-	7,262,752.99	7,262,752.99
（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）	-32,770,968.37	-	-47,039,473.07	-79,810,441.44
其中：1. 基金申购款	47,239,591.17	-	65,542,361.02	112,781,952.19
2. 基金赎回款	-80,010,559.54	-	-	-192,592,393.63

			112,581,834.09	
(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	408,954,056.12	-	588,388,434.85	997,342,490.97
项目	上年度可比期间 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	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)	-3,737,030.15	-	-68,359,051.23	-72,096,081.38
(一)、综合收益总额	-	-	-63,210,036.52	-63,210,036.52
(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)	-3,737,030.15	-	-5,149,014.71	-8,886,044.86
其中：1. 基金申购款	23,365,250.81	-	28,411,278.99	51,776,529.80
2. 基金赎回款	-27,102,280.96	-	-33,560,293.70	-60,662,574.66
(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	427,640,367.57	-	495,594,834.06	923,235,201.63

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 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×95%+金融同业存款利率×5%。

6.4.2 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。

6.4.3 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要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	53,299,535.89
等于：本金	53,294,709.85
加：应计利息	4,826.04
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	53,299,535.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	918,890,461.85	-	941,261,139.84	22,370,677.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,500.00	0.89	11,651.33	150.44
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,500.00	0.89	11,651.33	150.44
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	918,901,961.85	0.89	941,272,791.17	22,370,828.43	

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

无余额。

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,266,734.28

其中：交易所市场	2,264,303.09
银行间市场	2,431.19
应付利息	-
预提审计费	31,240.60
预提信息披露费	179,507.37
合计	2,977,482.25

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,449,592,847.71	441,725,024.49
本期申购	155,026,626.86	47,239,591.17
本期赎回（以“-”号填列）	-262,568,044.87	-80,010,559.54
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	1,342,051,429.70	408,954,056.12

注：申购含红利再投、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	687,353,925.53	-59,188,770.60	628,165,154.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	687,353,925.53	-59,188,770.60	628,165,154.93
本期利润	106,796.76	7,155,956.23	7,262,752.99
本期基金份额交易产生的变动数	-50,399,407.65	3,359,934.58	-47,039,473.07
其中：基金申购款	72,905,721.87	-7,363,360.85	65,542,361.02
基金赎回款	-123,305,129.52	10,723,295.43	-112,581,834.09
本期已分配利润	-	-	-

本期末	637,061,314.64	-48,672,879.79	588,388,434.85
-----	----------------	----------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	103,991.28
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	13,635.40
其他	575.50
合计	118,202.18

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,932,956.29
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	-5,932,956.29

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	5,816,643,945.75
减：卖出股票成本总额	5,816,663,435.49
减：交易费用	5,913,466.55
买卖股票差价收入	-5,932,956.29

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	34.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	41,903.83

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	41,938.62

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	256,249.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	214,300.00
减：应计利息总额	35.17
减：交易费用	10.29
买卖债券差价收入	41,903.83

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

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,086,176.47
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	12,086,176.47

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	7,155,956.23
股票投资	7,155,962.87
债券投资	-6.64
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	7,155,956.23

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,127.32
基金转换费收入	875.72
合计	5,003.04

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	259.00
账户维护费	9,000.00
其他	4.95
合计	100,011.92

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。

根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人、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
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	-	-	3,115,483,506.50	39.29
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	2,946,942.04	39.48	2,946,942.04	39.48

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。

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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,092,962.71	4,777,561.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,571,326.99	1,425,131.25
应支付基金管理人的净管理费	3,521,635.72	3,352,430.01

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1, 018, 592. 49	955, 512. 25

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 为每日应计提的基金托管费

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。

6. 4. 10. 2. 3 销售服务费

无。

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

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。

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		上年度可比期间	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 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
工商银行	53, 299, 535. 89	103, 991. 28	61, 578, 419. 94	108, 938. 92

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	688545	兴福电子	网下申购	9,940	116,099.20
上年度可比期间 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	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	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	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	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	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60

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（2025 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	1-6 个月（含）	新股限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-

001356	富岭股份	2025年1月16日	1-6个月(含)	新股限售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	1-6个月(含)	新股限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001395	亚联机械	2025年1月20日	1-6个月(含)	新股限售	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301458	钧崑电子	2025年1月2日	1-6个月(含)	新股限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025年3月6日	1-6个月(含)	新股限售	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025年5月28日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	1-6个月(含)	新股限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025年5月12日	1-6个月(含)	新股限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	1-6个月(含)	新股限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	1-6个月(含)	新股限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
603014	威高血净	2025年5月12日	1-6个月(含)	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-

603072	天和磁材	2024年12月24日	1-6个月(含)	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	1-6个月(含)	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	1-6个月(含)	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603382	海阳科技	2025年6月5日	1-6个月(含)	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
688411	海博思创	2025年1月20日	1-6个月(含)	新股限售	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	1-6个月(含)	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	1-6个月(含)	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	1-6个月(含)	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025年6月16日	1个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	111	11,100.00	11,100.73	-

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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	日期	原因	估值 单价	日期	开盘单 价	(股)	成本总 额	估值 总额	
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事 项停牌	0.01	-	-	100	297.00	1.00	-

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。

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之内。

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。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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的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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	53,299,535.89	-	-	-	53,299,535.89
结算备付金	7,857,091.80	-	-	-	7,857,091.80
存出保证金	245,885.69	-	-	-	245,885.69
交易性金融资产	11,651.33	-	-	-941,261,139.84	941,272,791.17
应收申购款	-	-	-	71,285.96	71,285.96
应收清算款	-	-	-	7,233,911.68	7,233,911.68
资产总计	61,414,164.71	-	-	-948,566,337.48	1,009,980,502.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,134,884.69	1,134,884.69
应付管理人报酬	-	-	-	812,770.32	812,770.32
应付托管费	-	-	-	162,554.07	162,554.07
应付清算款	-	-	-	7,550,319.89	7,550,319.89
其他负债	-	-	-	2,977,482.25	2,977,482.25
负债总计	-	-	-	12,638,011.22	12,638,011.22
利率敏感度缺口	61,414,164.71	-	-	-935,928,326.26	997,342,490.97
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2025 年 06 月 30 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 0.001% (2024 年 12 月 31 日: 0.0001%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2024 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。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	941,261,139.84	94.38	1,006,509,508.38	94.08

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,651.33	0.00	757.20	-
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	941,272,791.17	94.38	1,006,510,265.58	94.08

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。

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	46,819,061.88	53,053,968.91
	业绩比较基准下降5%	-46,819,061.88	-53,053,968.91

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	941,040,261.57	1,002,697,997.72
第二层次	11,101.73	3,322,945.50
第三层次	221,427.87	489,322.36
合计	941,272,791.17	1,006,510,265.58

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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	941,261,139.84	93.20
	其中：股票	941,261,139.84	93.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,651.33	0.00
	其中：债券	11,651.33	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	61,156,627.69	6.06
8	其他各项资产	7,551,083.33	0.75
9	合计	1,009,980,502.19	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	8,999,164.00	0.90
B	采矿业	26,386,768.93	2.65
C	制造业	426,658,780.34	42.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,578,424.78	2.77
E	建筑业	32,032,469.80	3.21
F	批发和零售业	6,608,014.02	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	26,460,508.48	2.65
H	住宿和餐饮业	152,592.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,365,632.41	4.95
J	金融业	256,311,234.94	25.70
K	房地产业	9,213,610.46	0.92
L	租赁和商务服务业	7,866,043.90	0.79
M	科学研究和技术服务业	6,433,363.43	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	25,357.32	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	2,982,720.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,052,102.98	0.21
S	综合	518,698.00	0.05
	合计	889,645,485.79	89.20

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	1,554,441.00	0.16
C	制造业	29,823,137.81	2.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,403,537.80	0.44
E	建筑业	899,131.00	0.09
F	批发和零售业	385,889.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,575,982.78	0.16
H	住宿和餐饮业	1,413.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,194,469.80	0.32
J	金融业	3,906,052.22	0.39
K	房地产业	1,693,239.00	0.17
L	租赁和商务服务业	1,252,486.40	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,679,149.24	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	33,579.00	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	336,283.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	876,863.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	51,615,654.05	5.18

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	600519	贵州茅台	22,533	31,760,714.16	3.18
2	300750	宁德时代	103,612	26,133,018.64	2.62
3	600036	招商银行	560,968	25,776,479.60	2.58
4	601318	中国平安	441,434	24,490,758.32	2.46
5	601166	兴业银行	659,000	15,381,060.00	1.54
6	000333	美的集团	192,385	13,890,197.00	1.39
7	600900	长江电力	446,750	13,465,045.00	1.35
8	300059	东方财富	564,498	13,056,838.74	1.31
9	600030	中信证券	457,233	12,628,775.46	1.27
10	002594	比亚迪	34,600	11,484,086.00	1.15
11	601899	紫金矿业	565,583	11,028,868.50	1.11
12	600000	浦发银行	676,200	9,385,656.00	0.94
13	601288	农业银行	1,550,300	9,115,764.00	0.91
14	601328	交通银行	1,117,850	8,942,800.00	0.90
15	000858	五粮液	74,944	8,910,841.60	0.89
16	000651	格力电器	198,000	8,894,160.00	0.89
17	601398	工商银行	1,144,200	8,684,478.00	0.87
18	600276	恒瑞医药	140,460	7,289,874.00	0.73
19	688981	中芯国际	79,432	7,003,519.44	0.70
20	000776	广发证券	379,945	6,386,875.45	0.64
21	600887	伊利股份	224,400	6,256,272.00	0.63
22	601816	京沪高铁	1,061,600	6,104,200.00	0.61
23	600941	中国移动	53,600	6,032,680.00	0.60
24	002371	北方华创	13,600	6,014,056.00	0.60
25	600919	江苏银行	501,100	5,983,134.00	0.60
26	601668	中国建筑	1,015,840	5,861,396.80	0.59
27	603259	药明康德	81,957	5,700,109.35	0.57
28	002230	科大讯飞	118,100	5,654,628.00	0.57
29	002475	立讯精密	162,932	5,652,111.08	0.57
30	000725	京东方 A	1,416,400	5,651,436.00	0.57
31	600016	民生银行	1,184,200	5,624,950.00	0.56
32	000063	中兴通讯	167,800	5,451,822.00	0.55
33	601688	华泰证券	305,124	5,434,258.44	0.54
34	688041	海光信息	38,326	5,415,080.54	0.54
35	601818	光大银行	1,295,200	5,375,080.00	0.54
36	601988	中国银行	931,020	5,232,332.40	0.52
37	601169	北京银行	760,764	5,196,018.12	0.52
38	601939	建设银行	550,200	5,193,888.00	0.52

39	600031	三一重工	288,400	5,176,780.00	0.52
40	600050	中国联通	924,900	4,938,966.00	0.50
41	601229	上海银行	456,600	4,844,526.00	0.49
42	688256	寒武纪	7,925	4,766,887.50	0.48
43	300502	新易盛	36,520	4,638,770.40	0.47
44	000338	潍柴动力	300,767	4,625,796.46	0.46
45	601728	中国电信	594,000	4,603,500.00	0.46
46	300760	迈瑞医疗	20,069	4,510,507.75	0.45
47	601658	邮储银行	820,100	4,485,947.00	0.45
48	601601	中国太保	118,700	4,452,437.00	0.45
49	688012	中微公司	22,559	4,112,505.70	0.41
50	603019	中科曙光	57,100	4,019,840.00	0.40
51	300308	中际旭创	27,289	3,980,373.54	0.40
52	300124	汇川技术	61,600	3,977,512.00	0.40
53	688111	金山办公	13,922	3,898,856.10	0.39
54	600406	国电南瑞	173,064	3,878,364.24	0.39
55	600089	特变电工	323,720	3,861,979.60	0.39
56	000100	TCL 科技	889,454	3,851,335.82	0.39
57	601766	中国中车	538,040	3,787,801.60	0.38
58	002415	海康威视	136,100	3,774,053.00	0.38
59	002352	顺丰控股	77,000	3,754,520.00	0.38
60	601186	中国铁建	465,800	3,731,058.00	0.37
61	601390	中国中铁	660,400	3,704,844.00	0.37
62	002714	牧原股份	87,600	3,680,076.00	0.37
63	603501	豪威集团	28,300	3,612,495.00	0.36
64	600660	福耀玻璃	60,600	3,454,806.00	0.35
65	601127	赛力斯	25,400	3,411,728.00	0.34
66	300274	阳光电源	49,260	3,338,350.20	0.33
67	601006	大秦铁路	501,700	3,311,220.00	0.33
68	600436	片仔癀	16,200	3,240,162.00	0.32
69	601800	中国交建	363,800	3,234,182.00	0.32
70	600309	万华化学	58,720	3,186,147.20	0.32
71	000001	平安银行	261,596	3,157,463.72	0.32
72	600999	招商证券	174,600	3,071,214.00	0.31
73	300015	爱尔眼科	239,000	2,982,720.00	0.30
74	601012	隆基绿能	197,791	2,970,820.82	0.30
75	688008	澜起科技	35,603	2,919,446.00	0.29
76	600153	建发股份	280,000	2,903,600.00	0.29
77	000568	泸州老窖	25,200	2,857,680.00	0.29
78	600115	中国东航	706,600	2,847,598.00	0.29
79	600690	海尔智家	112,820	2,795,679.60	0.28
80	000895	双汇发展	113,500	2,770,535.00	0.28
81	000932	华菱钢铁	625,000	2,750,000.00	0.28

82	601138	工业富联	128,300	2,743,054.00	0.28
83	601618	中国中冶	917,800	2,735,044.00	0.27
84	600176	中国巨石	238,100	2,714,340.00	0.27
85	600585	海螺水泥	126,100	2,707,367.00	0.27
86	601117	中国化学	350,600	2,689,102.00	0.27
87	601989	中国重工	578,900	2,686,096.00	0.27
88	603288	海天味业	68,588	2,668,759.08	0.27
89	601669	中国电建	545,100	2,654,637.00	0.27
90	000425	徐工机械	339,100	2,634,807.00	0.26
91	601088	中国神华	64,800	2,626,992.00	0.26
92	601919	中远海控	172,000	2,586,880.00	0.26
93	600905	三峡能源	606,300	2,582,838.00	0.26
94	000157	中联重科	351,900	2,544,237.00	0.26
95	600895	张江高科	98,400	2,528,880.00	0.25
96	601916	浙商银行	740,830	2,511,413.70	0.25
97	600909	华安证券	430,000	2,506,900.00	0.25
98	002142	宁波银行	91,210	2,495,505.60	0.25
99	002252	上海莱士	361,900	2,486,253.00	0.25
100	002463	沪电股份	58,010	2,470,065.80	0.25
101	600015	华夏银行	312,040	2,468,236.40	0.25
102	600737	中粮糖业	257,600	2,434,320.00	0.24
103	600809	山西汾酒	13,600	2,398,904.00	0.24
104	002736	国信证券	202,400	2,331,648.00	0.23
105	603986	兆易创新	18,100	2,290,193.00	0.23
106	300498	温氏股份	132,000	2,254,560.00	0.23
107	002027	分众传媒	307,100	2,241,830.00	0.22
108	601995	中金公司	63,200	2,234,752.00	0.22
109	688072	拓荆科技	14,403	2,213,885.13	0.22
110	600150	中国船舶	66,200	2,154,148.00	0.22
111	000938	紫光股份	89,600	2,149,504.00	0.22
112	600019	宝钢股份	322,200	2,123,298.00	0.21
113	002841	视源股份	61,300	2,120,980.00	0.21
114	601066	中信建投	87,600	2,106,780.00	0.21
115	300476	胜宏科技	15,600	2,096,328.00	0.21
116	600958	东方证券	214,692	2,078,218.56	0.21
117	601985	中国核电	222,300	2,071,836.00	0.21
118	600498	烽火通信	97,000	2,039,910.00	0.20
119	600885	宏发股份	90,495	2,018,943.45	0.20
120	002179	中航光电	49,946	2,015,820.56	0.20
121	002028	思源电气	26,800	1,953,988.00	0.20
122	600873	梅花生物	180,300	1,927,407.00	0.19
123	601933	永辉超市	392,100	1,921,290.00	0.19
124	601336	新华保险	32,200	1,883,700.00	0.19

125	688396	华润微	39,851	1,879,373.16	0.19
126	000728	国元证券	236,000	1,862,040.00	0.19
127	300014	亿纬锂能	40,400	1,850,724.00	0.19
128	601615	明阳智能	160,900	1,848,741.00	0.19
129	600170	上海建工	772,200	1,845,558.00	0.19
130	002939	长城证券	219,800	1,841,924.00	0.18
131	600109	国金证券	207,160	1,816,793.20	0.18
132	601628	中国人寿	43,600	1,795,884.00	0.18
133	601016	节能风电	617,400	1,784,286.00	0.18
134	601868	中国能建	791,600	1,765,268.00	0.18
135	600438	通威股份	105,300	1,763,775.00	0.18
136	601111	中国国航	223,032	1,759,722.48	0.18
137	600061	国投资本	233,852	1,758,567.04	0.18
138	002074	国轩高科	54,100	1,756,086.00	0.18
139	601009	南京银行	151,024	1,754,898.88	0.18
140	600584	长电科技	51,900	1,748,511.00	0.18
141	601997	贵阳银行	279,800	1,745,952.00	0.18
142	688538	和辉光电	741,538	1,735,198.92	0.17
143	601577	长沙银行	174,500	1,734,530.00	0.17
144	300474	景嘉微	23,500	1,715,500.00	0.17
145	600998	九州通	327,743	1,684,599.02	0.17
146	000977	浪潮信息	33,090	1,683,619.20	0.17
147	000783	长江证券	241,100	1,670,823.00	0.17
148	601991	大唐发电	518,800	1,644,596.00	0.16
149	601118	海南橡胶	346,200	1,634,064.00	0.16
150	000708	中信特钢	138,900	1,633,464.00	0.16
151	002244	滨江集团	167,500	1,633,125.00	0.16
152	300408	三环集团	48,800	1,629,920.00	0.16
153	600346	恒力石化	112,980	1,611,094.80	0.16
154	600418	江淮汽车	39,800	1,595,582.00	0.16
155	601360	三六零	155,000	1,581,000.00	0.16
156	300999	金龙鱼	53,500	1,579,855.00	0.16
157	002673	西部证券	199,078	1,568,734.64	0.16
158	000066	中国长城	105,500	1,561,400.00	0.16
159	600372	中航机载	128,280	1,547,056.80	0.16
160	601857	中国石油	180,900	1,546,695.00	0.16
161	001979	招商蛇口	176,000	1,543,520.00	0.15
162	000166	申万宏源	307,113	1,541,707.26	0.15
163	300496	中科创达	26,400	1,510,608.00	0.15
164	300803	指南针	18,545	1,495,839.70	0.15
165	600918	中泰证券	231,900	1,491,117.00	0.15
166	601108	财通证券	187,700	1,484,707.00	0.15
167	603993	洛阳钼业	174,900	1,472,658.00	0.15

168	300896	爱美客	8,420	1,471,900.20	0.15
169	000988	华工科技	31,200	1,466,712.00	0.15
170	301236	软通动力	26,800	1,464,352.00	0.15
171	600704	物产中大	277,300	1,461,371.00	0.15
172	601225	陕西煤业	75,900	1,460,316.00	0.15
173	600028	中国石化	258,400	1,457,376.00	0.15
174	601377	兴业证券	235,325	1,456,661.75	0.15
175	601099	太平洋	370,300	1,455,279.00	0.15
176	600536	中国软件	31,008	1,450,244.16	0.15
177	002558	巨人网络	61,300	1,443,615.00	0.14
178	600598	北大荒	99,200	1,430,464.00	0.14
179	600460	士兰微	57,600	1,429,632.00	0.14
180	600820	隧道股份	231,900	1,414,590.00	0.14
181	600588	用友网络	104,700	1,399,839.00	0.14
182	600637	东方明珠	186,777	1,395,224.19	0.14
183	601717	中创智领	83,700	1,391,094.00	0.14
184	002966	苏州银行	157,920	1,386,537.60	0.14
185	601877	正泰电器	60,800	1,378,336.00	0.14
186	600048	保利发展	168,700	1,366,470.00	0.14
187	600415	小商品城	65,900	1,362,812.00	0.14
188	600111	北方稀土	54,600	1,359,540.00	0.14
189	601888	中国中免	22,270	1,357,801.90	0.14
190	002625	光启技术	33,800	1,351,324.00	0.14
191	601901	方正证券	170,600	1,349,446.00	0.14
192	000625	长安汽车	105,600	1,347,456.00	0.14
193	002025	航天电器	26,200	1,346,942.00	0.14
194	600566	济川药业	51,100	1,345,463.00	0.13
195	002050	三花智控	50,800	1,340,104.00	0.13
196	002078	太阳纸业	99,114	1,334,074.44	0.13
197	600886	国投电力	90,200	1,329,548.00	0.13
198	600515	海南机场	370,100	1,310,154.00	0.13
199	002241	歌尔股份	55,700	1,298,924.00	0.13
200	600547	山东黄金	40,500	1,293,165.00	0.13
201	601319	中国人保	148,400	1,292,564.00	0.13
202	600039	四川路桥	130,300	1,289,970.00	0.13
203	600029	南方航空	217,300	1,282,070.00	0.13
204	000876	新希望	134,500	1,261,610.00	0.13
205	002236	大华股份	79,310	1,259,442.80	0.13
206	600893	航发动力	31,666	1,220,407.64	0.12
207	601600	中国铝业	173,100	1,218,624.00	0.12
208	002001	新和成	56,700	1,206,009.00	0.12
209	302132	中航成飞	13,700	1,204,778.00	0.12
210	600938	中国海油	46,100	1,203,671.00	0.12

211	000538	云南白药	21,320	1,189,442.80	0.12
212	605499	东鹏饮料	3,760	1,180,828.00	0.12
213	000598	兴蓉环境	161,918	1,167,428.78	0.12
214	688469	芯联集成	244,495	1,166,241.15	0.12
215	000301	东方盛虹	138,800	1,156,204.00	0.12
216	300699	光威复材	36,500	1,155,955.00	0.12
217	600862	中航高科	44,100	1,150,128.00	0.12
218	600582	天地科技	191,500	1,147,085.00	0.12
219	002797	第一创业	161,900	1,146,252.00	0.11
220	600563	法拉电子	10,400	1,134,536.00	0.11
221	600177	雅戈尔	154,590	1,128,507.00	0.11
222	600926	杭州银行	66,700	1,121,894.00	0.11
223	600008	首创环保	370,700	1,119,514.00	0.11
224	600332	白云山	42,200	1,112,392.00	0.11
225	600970	中材国际	129,000	1,106,820.00	0.11
226	001965	招商公路	91,848	1,102,176.00	0.11
227	600760	中航沈飞	18,700	1,096,194.00	0.11
228	600219	南山铝业	284,800	1,090,784.00	0.11
229	603833	欧派家居	19,100	1,078,195.00	0.11
230	600875	东方电气	62,100	1,039,554.00	0.10
231	002851	麦格米特	20,700	1,037,898.00	0.10
232	600298	安琪酵母	29,500	1,037,515.00	0.10
233	300033	同花顺	3,800	1,037,438.00	0.10
234	601665	齐鲁银行	163,600	1,033,952.00	0.10
235	600369	西南证券	236,300	1,027,905.00	0.10
236	600104	上汽集团	63,200	1,014,360.00	0.10
237	600839	四川长虹	103,700	1,007,964.00	0.10
238	603799	华友钴业	26,900	995,838.00	0.10
239	600009	上海机场	31,300	994,401.00	0.10
240	601128	常熟银行	134,500	991,265.00	0.10
241	000400	许继电气	45,400	988,358.00	0.10
242	000629	钒钛股份	382,000	977,920.00	0.10
243	600988	赤峰黄金	38,900	967,832.00	0.10
244	688303	大全能源	45,291	965,604.12	0.10
245	600570	恒生电子	28,701	962,631.54	0.10
246	002311	海大集团	16,300	955,017.00	0.10
247	600282	南钢股份	223,700	939,540.00	0.09
248	300144	宋城演艺	109,100	932,805.00	0.09
249	600497	驰宏锌锗	174,400	922,576.00	0.09
250	600521	华海药业	49,400	920,322.00	0.09
251	605117	德业股份	17,460	919,443.60	0.09
252	688363	华熙生物	17,888	918,548.80	0.09
253	601179	中国西电	149,300	916,702.00	0.09

254	000999	华润三九	29,270	915,565.60	0.09
255	688220	翱捷科技	11,677	914,309.10	0.09
256	000768	中航西飞	33,100	904,954.00	0.09
257	688223	晶科能源	173,613	901,051.47	0.09
258	300394	天孚通信	11,208	894,846.72	0.09
259	603160	汇顶科技	12,300	873,669.00	0.09
260	002508	老板电器	45,500	864,955.00	0.09
261	601990	南京证券	106,800	862,944.00	0.09
262	002281	光迅科技	17,300	853,236.00	0.09
263	601211	国泰海通	43,264	828,938.24	0.08
264	600685	中船防务	30,000	815,700.00	0.08
265	300765	新诺威	15,700	811,533.00	0.08
266	002384	东山精密	21,088	796,493.76	0.08
267	600352	浙江龙盛	77,800	790,448.00	0.08
268	000709	河钢股份	365,700	789,912.00	0.08
269	600004	白云机场	86,390	786,149.00	0.08
270	300017	网宿科技	73,300	785,776.00	0.08
271	601928	凤凰传媒	70,300	785,251.00	0.08
272	300782	卓胜微	10,911	778,718.07	0.08
273	000630	铜陵有色	226,800	757,512.00	0.08
274	000021	深科技	40,300	755,222.00	0.08
275	600118	中国卫星	26,300	751,391.00	0.08
276	601825	沪农商行	77,300	749,810.00	0.08
277	000002	万科 A	116,513	748,013.46	0.08
278	688082	盛美上海	6,427	732,292.38	0.07
279	600390	五矿资本	124,500	725,835.00	0.07
280	002414	高德红外	70,155	719,088.75	0.07
281	002422	科伦药业	19,700	707,624.00	0.07
282	601958	金钼股份	64,500	705,630.00	0.07
283	601727	上海电气	94,700	699,833.00	0.07
284	002138	顺络电子	24,600	691,752.00	0.07
285	002049	紫光国微	10,400	684,944.00	0.07
286	601077	渝农商行	94,100	671,874.00	0.07
287	603885	吉祥航空	49,700	669,459.00	0.07
288	601838	成都银行	33,186	667,038.60	0.07
289	000963	华东医药	16,500	665,940.00	0.07
290	300339	润和软件	13,100	665,873.00	0.07
291	603195	公牛集团	13,800	665,850.00	0.07
292	600795	国电电力	137,400	665,016.00	0.07
293	300433	蓝思科技	29,000	646,700.00	0.06
294	600522	中天科技	42,700	617,442.00	0.06
295	000683	博源化工	128,700	616,473.00	0.06
296	603000	人民网	30,400	614,384.00	0.06

297	002648	卫星化学	35,400	613,482.00	0.06
298	600060	海信视像	26,600	612,332.00	0.06
299	600362	江西铜业	26,100	611,523.00	0.06
300	600511	国药股份	20,700	603,612.00	0.06
301	300751	迈为股份	8,583	597,033.48	0.06
302	600803	新奥股份	31,500	595,350.00	0.06
303	300146	汤臣倍健	52,900	594,596.00	0.06
304	688235	百济神州	2,534	592,043.76	0.06
305	002064	华峰化学	89,316	590,378.76	0.06
306	002156	通富微电	23,000	589,260.00	0.06
307	600989	宝丰能源	36,500	589,110.00	0.06
308	601333	广深铁路	202,600	585,514.00	0.06
309	688271	联影医疗	4,581	585,176.94	0.06
310	688036	传音控股	7,241	577,107.70	0.06
311	601881	中国银河	32,900	564,235.00	0.06
312	600038	中直股份	14,500	562,745.00	0.06
313	002304	洋河股份	8,100	522,855.00	0.05
314	600673	东阳光	44,600	518,698.00	0.05
315	002465	海格通信	34,100	475,354.00	0.05
316	000933	神火股份	28,400	472,576.00	0.05
317	002460	赣锋锂业	13,940	470,753.80	0.05
318	600482	中国动力	20,200	466,014.00	0.05
319	600489	中金黄金	31,816	465,468.08	0.05
320	601100	恒立液压	6,400	460,800.00	0.05
321	002600	领益智造	52,100	447,539.00	0.04
322	600879	航天电子	42,300	442,881.00	0.04
323	603589	口子窖	12,600	438,480.00	0.04
324	300763	锦浪科技	7,500	430,425.00	0.04
325	600160	巨化股份	14,800	424,464.00	0.04
326	002185	华天科技	40,959	413,685.90	0.04
327	002202	金风科技	39,801	407,960.25	0.04
328	601689	拓普集团	8,580	405,405.00	0.04
329	603806	福斯特	31,000	401,760.00	0.04
330	688578	艾力斯	4,221	392,721.84	0.04
331	000733	振华科技	7,800	390,390.00	0.04
332	688187	时代电气	9,150	390,247.50	0.04
333	601136	首创证券	19,400	385,672.00	0.04
334	002466	天齐锂业	12,000	384,480.00	0.04
335	601456	国联民生	36,800	380,880.00	0.04
336	600426	华鲁恒升	17,518	379,615.06	0.04
337	600583	海油工程	66,000	360,360.00	0.04
338	600196	复星医药	14,354	360,141.86	0.04
339	300347	泰格医药	6,600	351,912.00	0.04

340	600126	杭钢股份	39,100	351,900.00	0.04
341	000975	山金国际	18,500	350,390.00	0.04
342	002372	伟星新材	33,376	345,775.36	0.03
343	300759	康龙化成	14,000	343,560.00	0.03
344	002444	巨星科技	13,100	334,181.00	0.03
345	002007	华兰生物	20,909	327,644.03	0.03
346	600066	宇通客车	13,000	323,180.00	0.03
347	002261	拓维信息	10,400	321,880.00	0.03
348	002601	龙佰集团	19,500	316,095.00	0.03
349	000423	东阿阿胶	5,800	303,340.00	0.03
350	600025	华能水电	31,500	300,825.00	0.03
351	601058	赛轮轮胎	22,600	296,512.00	0.03
352	600487	亨通光电	18,900	289,170.00	0.03
353	300413	芒果超媒	13,200	288,024.00	0.03
354	601788	光大证券	15,800	284,084.00	0.03
355	002821	凯莱英	3,200	282,400.00	0.03
356	002223	鱼跃医疗	7,760	276,256.00	0.03
357	002517	恺英网络	14,300	276,133.00	0.03
358	603893	瑞芯微	1,800	273,348.00	0.03
359	000807	云铝股份	17,100	273,258.00	0.03
360	300442	润泽科技	5,500	272,415.00	0.03
361	002493	荣盛石化	32,750	271,170.00	0.03
362	600183	生益科技	8,900	268,335.00	0.03
363	601607	上海医药	15,000	268,200.00	0.03
364	600188	兖矿能源	21,925	266,827.25	0.03
365	601168	西部矿业	16,000	266,080.00	0.03
366	000408	藏格矿业	6,100	260,287.00	0.03
367	600010	包钢股份	143,900	257,581.00	0.03
368	600021	上海电力	29,200	256,668.00	0.03
369	300661	圣邦股份	3,490	253,967.30	0.03
370	002152	广电运通	18,640	250,521.60	0.03
371	002938	鹏鼎控股	7,800	249,834.00	0.03
372	000661	长春高新	2,500	247,950.00	0.02
373	300724	捷佳伟创	4,500	244,350.00	0.02
374	688188	柏楚电子	1,836	241,727.76	0.02
375	600096	云天化	10,901	239,494.97	0.02
376	300207	欣旺达	11,800	236,708.00	0.02
377	603606	东方电缆	4,500	232,695.00	0.02
378	002353	杰瑞股份	6,619	231,665.00	0.02
379	300251	光线传媒	11,300	229,051.00	0.02
380	300418	昆仑万维	6,600	221,958.00	0.02
381	002008	大族激光	9,100	221,767.00	0.02
382	002340	格林美	34,900	221,615.00	0.02

383	000729	燕京啤酒	17,100	221,103.00	0.02
384	002080	中材科技	11,334	221,013.00	0.02
385	603979	金诚信	4,700	218,268.00	0.02
386	600765	中航重机	12,500	211,000.00	0.02
387	600535	天士力	13,300	208,145.00	0.02
388	600233	圆通速递	15,800	203,662.00	0.02
389	688180	君实生物	5,920	201,161.60	0.02
390	601021	春秋航空	3,600	200,340.00	0.02
391	600027	华电国际	36,600	200,202.00	0.02
392	601162	天风证券	40,000	197,200.00	0.02
393	300037	新宙邦	5,600	197,120.00	0.02
394	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.02
395	603345	安井食品	2,300	184,966.00	0.02
396	000617	中油资本	25,300	184,690.00	0.02
397	002595	豪迈科技	3,040	180,028.80	0.02
398	000513	丽珠集团	4,924	177,460.96	0.02
399	600141	兴发集团	8,600	176,558.00	0.02
400	603087	甘李药业	3,100	169,818.00	0.02
401	601555	东吴证券	19,260	168,525.00	0.02
402	600079	人福医药	7,700	161,546.00	0.02
403	300454	深信服	1,700	160,106.00	0.02
404	688169	石头科技	1,011	158,272.05	0.02
405	300373	扬杰科技	3,000	155,700.00	0.02
406	002129	TCL 中环	20,226	155,335.68	0.02
407	600085	同仁堂	4,300	155,058.00	0.02
408	603298	杭叉集团	7,400	155,030.00	0.02
409	600754	锦江酒店	6,800	152,592.00	0.02
410	600863	内蒙华电	36,800	151,248.00	0.02
411	688777	中控技术	3,321	149,146.11	0.01
412	688099	晶晨股份	2,081	147,771.81	0.01
413	601698	中国卫通	7,200	147,384.00	0.01
414	688506	百利天恒	496	146,875.52	0.01
415	002532	天山铝业	17,600	146,256.00	0.01
416	600674	川投能源	9,100	145,964.00	0.01
417	002916	深南电路	1,330	143,387.30	0.01
418	601666	平煤股份	19,110	141,605.10	0.01
419	002056	横店东磁	9,900	140,085.00	0.01
420	300223	北京君正	2,000	138,400.00	0.01
421	000960	锡业股份	8,900	136,170.00	0.01
422	603659	璞泰来	7,100	133,338.00	0.01
423	300122	智飞生物	6,800	133,212.00	0.01
424	300054	鼎龙股份	4,600	131,928.00	0.01
425	603392	万泰生物	2,120	129,320.00	0.01

426	601799	星宇股份	1,000	125,000.00	0.01
427	600026	中远海能	11,800	121,894.00	0.01
428	688120	华海清科	720	121,464.00	0.01
429	600745	闻泰科技	3,550	119,031.50	0.01
430	300316	晶盛机电	4,300	116,745.00	0.01
431	000786	北新建材	4,300	113,864.00	0.01
432	600968	海油发展	27,200	110,976.00	0.01
433	002603	以岭药业	7,800	109,980.00	0.01
434	002739	万达电影	9,186	104,995.98	0.01
435	000831	中国稀土	2,900	104,748.00	0.01
436	600486	扬农化工	1,800	104,400.00	0.01
437	688385	复旦微电	2,106	103,762.62	0.01
438	000738	航发控制	5,000	103,750.00	0.01
439	600985	淮北矿业	9,100	103,194.00	0.01
440	600348	华阳股份	15,300	101,898.00	0.01
441	600380	健康元	9,100	100,373.00	0.01
442	002709	天赐材料	5,300	96,036.00	0.01
443	002273	水晶光电	4,800	95,856.00	0.01
444	000750	国海证券	22,400	92,288.00	0.01
445	300487	蓝晓科技	1,800	90,540.00	0.01
446	601233	桐昆股份	8,500	90,100.00	0.01
447	600023	浙能电力	16,900	89,570.00	0.01
448	603290	斯达半导	1,100	89,397.00	0.01
449	603179	新泉股份	1,900	89,243.00	0.01
450	600329	达仁堂	2,600	86,736.00	0.01
451	688617	惠泰医疗	290	86,130.00	0.01
452	002429	兆驰股份	19,300	84,534.00	0.01
453	601155	新城控股	6,100	83,448.00	0.01
454	601699	潞安环能	7,600	80,180.00	0.01
455	601866	中远海发	31,300	77,311.00	0.01
456	601216	君正集团	13,900	76,728.00	0.01
457	002262	恩华药业	3,600	74,808.00	0.01
458	300832	新产业	1,300	73,736.00	0.01
459	000009	中国宝安	8,204	72,851.52	0.01
460	002920	德赛西威	710	72,512.30	0.01
461	002120	韵达股份	10,800	72,360.00	0.01
462	601001	晋控煤业	5,800	70,876.00	0.01
463	600600	青岛啤酒	1,000	69,460.00	0.01
464	688009	中国通号	13,179	67,740.06	0.01
465	688347	华虹公司	1,058	58,094.78	0.01
466	603605	珀莱雅	700	57,953.00	0.01
467	600062	华润双鹤	2,700	50,382.00	0.01
468	301269	华大九天	400	49,552.00	0.00

469	603899	晨光股份	1,700	49,283.00	0.00
470	601198	东兴证券	4,400	49,060.00	0.00
471	600741	华域汽车	2,700	47,655.00	0.00
472	601238	广汽集团	6,300	47,187.00	0.00
473	603816	顾家家居	1,800	45,936.00	0.00
474	601878	浙商证券	4,000	43,640.00	0.00
475	002653	海思科	1,000	42,220.00	0.00
476	601633	长城汽车	1,900	40,812.00	0.00
477	603296	华勤技术	498	40,178.64	0.00
478	603369	今世缘	1,000	38,930.00	0.00
479	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.00
480	002294	信立泰	800	37,864.00	0.00
481	300012	华测检测	3,232	37,782.08	0.00
482	002128	电投能源	1,800	35,604.00	0.00
483	603260	合盛硅业	700	33,180.00	0.00
483	603338	浙江鼎力	700	33,180.00	0.00
484	000039	中集集团	3,450	27,117.00	0.00
485	300628	亿联网络	780	27,112.80	0.00
486	600546	山煤国际	3,100	27,063.00	0.00
487	600161	天坛生物	1,400	26,866.00	0.00
488	688047	龙芯中科	200	26,678.00	0.00
489	603568	伟明环保	1,329	25,357.32	0.00
490	300450	先导智能	857	21,296.45	0.00
491	688213	思特威	200	20,444.00	0.00
492	688521	芯原股份	200	19,300.00	0.00
493	301358	湖南裕能	544	16,967.36	0.00
494	002459	晶澳科技	1,652	16,486.96	0.00
495	002180	纳思达	700	16,058.00	0.00
496	000983	山西焦煤	1,990	12,736.00	0.00
497	600256	广汇能源	2,000	12,040.00	0.00
498	603198	迎驾贡酒	300	11,829.00	0.00
499	688234	天岳先进	200	11,710.00	0.00
500	002850	科达利	100	11,317.00	0.00
501	002738	中矿资源	340	10,934.40	0.00
502	002456	欧菲光	900	10,665.00	0.00
503	002032	苏泊尔	200	10,478.00	0.00
504	688122	西部超导	200	10,376.00	0.00
505	000830	鲁西化工	1,000	10,300.00	0.00
506	600702	舍得酒业	200	10,280.00	0.00
507	300919	中伟股份	300	9,864.00	0.00
508	688065	凯赛生物	200	9,420.00	0.00
509	300136	信维通信	400	8,960.00	0.00
510	000703	恒逸石化	1,500	8,820.00	0.00

511	002812	恩捷股份	300	8,787.00	0.00
512	000519	中兵红箭	400	8,756.00	0.00
513	300003	乐普医疗	600	8,268.00	0.00
514	300001	特锐德	300	7,191.00	0.00
515	003816	中国广核	1,900	6,916.00	0.00
516	603486	科沃斯	100	5,823.00	0.00
517	002984	森麒麟	300	5,625.00	0.00
518	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.00
519	603596	伯特利	100	5,269.00	0.00
520	002085	万丰奥威	300	4,767.00	0.00
521	688249	晶合集成	200	4,054.00	0.00
522	688126	沪硅产业	200	3,744.00	0.00
523	600703	三安光电	300	3,726.00	0.00
524	600733	北汽蓝谷	400	2,948.00	0.00
525	688599	天合光能	200	2,906.00	0.00
526	603939	益丰药房	100	2,447.00	0.00
527	600845	宝信软件	100	2,362.00	0.00
528	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.00
529	603156	养元饮品	100	2,116.00	0.00
530	600549	厦门钨业	100	2,092.00	0.00
531	002430	杭氧股份	100	1,942.00	0.00
532	688472	阿特斯	200	1,830.00	0.00
533	600699	均胜电子	100	1,744.00	0.00
534	000792	盐湖股份	100	1,708.00	0.00
535	601865	福莱特	100	1,521.00	0.00
536	601966	玲珑轮胎	100	1,467.00	0.00
537	002271	东方雨虹	100	1,073.00	0.00
538	601696	中银证券	100	1,069.00	0.00
539	600642	申能股份	100	860.00	0.00
540	600011	华能国际	100	714.00	0.00
541	600398	海澜之家	100	696.00	0.00
542	601872	招商轮船	100	626.00	0.00
543	600655	豫园股份	100	555.00	0.00
544	601000	唐山港	100	406.00	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	688295	中复神鹰	97,738	2,032,950.40	0.20
2	688017	绿的谐波	14,211	1,774,811.79	0.18
3	003022	联泓新科	111,400	1,763,462.00	0.18
4	600517	国网英大	324,947	1,657,229.70	0.17
5	600516	方大炭素	354,800	1,646,272.00	0.17

6	603650	彤程新材	47,200	1,517,480.00	0.15
7	600925	苏能股份	282,700	1,478,521.00	0.15
8	600377	宁沪高速	95,700	1,468,038.00	0.15
9	001286	陕西能源	164,700	1,432,890.00	0.14
10	002572	索菲亚	88,900	1,245,489.00	0.12
11	600098	广州发展	194,500	1,215,625.00	0.12
12	000785	居然智家	396,800	1,210,240.00	0.12
13	600801	华新水泥	101,300	1,199,392.00	0.12
14	688819	天能股份	39,995	1,110,261.20	0.11
15	000898	鞍钢股份	458,200	1,063,024.00	0.11
16	300140	节能环境	166,200	1,025,454.00	0.10
17	603728	鸣志电器	17,200	988,484.00	0.10
18	000032	深桑达 A	44,400	898,212.00	0.09
19	688248	南网科技	28,145	885,441.70	0.09
20	600764	中国海防	25,500	867,000.00	0.09
21	002153	石基信息	99,100	858,206.00	0.09
22	600208	衢州发展	280,300	829,688.00	0.08
23	002065	东华软件	85,600	821,760.00	0.08
24	688425	铁建重工	200,943	819,847.44	0.08
25	002500	山西证券	140,200	818,768.00	0.08
26	603688	石英股份	23,000	810,060.00	0.08
27	600295	鄂尔多斯	91,600	797,836.00	0.08
28	601965	中国汽研	43,000	763,250.00	0.08
29	601106	中国一重	271,600	760,480.00	0.08
30	600007	中国国贸	36,600	753,228.00	0.08
31	600720	中交设计	96,300	744,399.00	0.07
32	002608	江苏国信	99,300	727,869.00	0.07
33	600528	中铁工业	92,700	684,126.00	0.07
34	000987	越秀资本	98,882	678,330.52	0.07
35	600872	中炬高新	33,086	628,634.00	0.06
36	601098	中南传媒	47,200	619,264.00	0.06
37	000027	深圳能源	96,200	613,756.00	0.06
38	600707	彩虹股份	94,500	610,470.00	0.06
39	688349	三一重能	24,231	604,321.14	0.06
40	000636	风华高科	42,400	582,576.00	0.06
41	300383	光环新网	40,200	574,860.00	0.06
42	002203	海亮股份	52,900	545,928.00	0.05
43	600299	安迪苏	52,800	509,520.00	0.05
44	300212	易华录	20,200	439,552.00	0.04
45	002926	华西证券	47,100	421,074.00	0.04
46	000825	太钢不锈	116,200	417,158.00	0.04
47	688032	禾迈股份	4,084	407,828.24	0.04
48	002507	涪陵榨菜	31,760	406,210.40	0.04

49	000959	首钢股份	108,080	367,472.00	0.04
50	601061	中信金属	42,800	338,548.00	0.03
51	002563	森马服饰	63,500	334,010.00	0.03
52	301267	华夏眼科	17,300	331,641.00	0.03
53	601998	中信银行	38,900	330,650.00	0.03
54	000537	中绿电	38,755	323,991.80	0.03
55	000060	中金岭南	69,550	318,539.00	0.03
56	600688	上海石化	103,500	294,975.00	0.03
57	688475	萤石网络	8,801	277,407.52	0.03
58	300888	稳健医疗	6,280	258,108.00	0.03
59	688563	航材股份	4,424	250,531.12	0.03
60	603129	春风动力	1,000	216,500.00	0.02
61	603927	中科软	10,900	210,806.00	0.02
62	601212	白银有色	65,900	206,267.00	0.02
63	600271	航天信息	20,900	193,116.00	0.02
64	000050	深天马 A	22,200	189,144.00	0.02
65	601858	中国科传	8,600	167,270.00	0.02
66	600612	老凤祥	1,700	84,575.00	0.01
67	600808	马钢股份	23,100	79,695.00	0.01
68	600529	山东药玻	3,300	73,062.00	0.01
69	600316	洪都航空	1,600	60,320.00	0.01
70	600848	上海临港	5,900	53,513.00	0.01
71	003031	中瓷电子	1,000	53,210.00	0.01
72	000800	一汽解放	7,200	49,392.00	0.00
73	300957	贝泰妮	1,100	48,642.00	0.00
74	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
75	002155	湖南黄金	2,600	46,410.00	0.00
76	000723	美锦能源	10,500	45,360.00	0.00
77	600325	华发股份	9,300	45,291.00	0.00
78	600373	中文传媒	4,300	44,161.00	0.00
79	300595	欧普康视	2,880	43,977.60	0.00
80	688301	奕瑞科技	494	43,279.34	0.00
81	300058	蓝色光标	6,440	42,246.40	0.00
82	300979	华利集团	800	42,056.00	0.00
83	601598	中国外运	8,500	41,905.00	0.00
84	300604	长川科技	900	40,419.00	0.00
85	601608	中信重工	8,900	38,893.00	0.00
86	000997	新大陆	1,200	38,856.00	0.00
87	600977	中国电影	3,600	38,592.00	0.00
88	300748	金力永磁	1,524	36,332.16	0.00
89	688052	纳芯微	200	34,898.00	0.00
90	600032	浙江新能	4,500	34,020.00	0.00
91	300070	碧水源	7,462	33,579.00	0.00

92	002568	百润股份	1,296	33,190.56	0.00
93	601228	广州港	10,100	32,623.00	0.00
94	601636	旗滨集团	6,400	32,064.00	0.00
95	300390	天华新能	1,670	31,846.90	0.00
96	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00
97	002318	久立特材	1,233	28,839.87	0.00
98	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
99	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
100	600859	王府井	1,700	23,613.00	0.00
101	000937	冀中能源	4,000	23,000.00	0.00
102	300601	康泰生物	1,480	22,481.20	0.00
103	002756	永兴材料	670	21,272.50	0.00
104	000559	万向钱潮	2,600	19,890.00	0.00
105	600166	福田汽车	7,300	19,783.00	0.00
106	600995	南网储能	2,000	19,560.00	0.00
107	000034	神州数码	500	18,820.00	0.00
108	688361	中科飞测	200	16,838.00	0.00
109	000887	中鼎股份	900	15,831.00	0.00
110	603077	和邦生物	8,700	15,225.00	0.00
111	688278	特宝生物	200	14,422.00	0.00
112	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
113	688002	睿创微纳	200	13,944.00	0.00
114	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
115	603194	中力股份	291	13,208.49	0.00
116	688114	华大智造	200	12,966.00	0.00
117	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
118	300567	精测电子	200	12,122.00	0.00
119	688281	华秦科技	200	12,102.00	0.00
120	000893	亚钾国际	401	12,086.14	0.00
121	688375	国博电子	200	12,002.00	0.00
122	689009	九号公司	200	11,834.00	0.00
123	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.00
124	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
125	600663	陆家嘴	1,300	11,518.00	0.00
126	688778	厦钨新能	200	11,184.00	0.00
127	603786	科博达	200	11,082.00	0.00
128	301498	乖宝宠物	100	10,937.00	0.00
129	688297	中无人机	200	10,680.00	0.00
130	300285	国瓷材料	600	10,410.00	0.00
131	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
132	300395	菲利华	200	10,220.00	0.00
133	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
134	300142	沃森生物	900	9,900.00	0.00

135	002487	大金重工	300	9,870.00	0.00
136	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
137	300573	兴齐眼药	180	9,322.20	0.00
138	600143	金发科技	887	9,144.97	0.00
139	000958	电投产融	1,300	8,892.00	0.00
140	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
141	301308	江波龙	100	8,749.00	0.00
142	600483	福能股份	900	8,676.00	0.00
143	301165	锐捷网络	140	8,604.40	0.00
144	000539	粤电力 A	1,800	8,172.00	0.00
145	600378	昊华科技	300	8,121.00	0.00
146	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
147	600578	京能电力	1,700	7,633.00	0.00
148	601019	山东出版	800	7,576.00	0.00
149	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
150	002408	齐翔腾达	1,600	7,168.00	0.00
151	002299	圣农发展	500	7,145.00	0.00
152	688561	奇安信	200	6,796.00	0.00
153	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
154	688153	唯捷创芯	200	6,202.00	0.00
155	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
156	600131	国网信通	300	5,310.00	0.00
157	603737	三棵树	140	5,159.00	0.00
158	300676	华大基因	100	4,977.00	0.00
159	603379	三美股份	100	4,812.00	0.00
160	002439	启明星辰	300	4,797.00	0.00
161	600580	卧龙电驱	240	4,744.80	0.00
162	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
163	300073	当升科技	100	4,387.00	0.00
164	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.00
165	600763	通策医疗	100	4,128.00	0.00
166	603341	龙旗科技	100	4,063.00	0.00
167	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
168	603658	安图生物	100	3,750.00	0.00
169	002432	九安医疗	100	3,643.00	0.00
170	603868	飞科电器	100	3,587.00	0.00
171	603529	爱玛科技	100	3,440.00	0.00
172	300024	机器人	200	3,436.00	0.00
173	002683	广东宏大	100	3,394.00	0.00
174	601231	环旭电子	200	2,926.00	0.00
175	688772	珠海冠宇	200	2,858.00	0.00
176	002019	亿帆医药	200	2,598.00	0.00
177	603556	海兴电力	100	2,547.00	0.00

178	300677	英科医疗	100	2,368.00	0.00
179	300002	神州泰岳	200	2,360.00	0.00
180	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
181	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
182	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
183	603233	大参林	100	1,630.00	0.00
184	600435	北方导航	100	1,559.00	0.00
185	600312	平高电气	100	1,539.00	0.00
186	002624	完美世界	100	1,517.00	0.00
187	603185	弘元绿能	100	1,485.00	0.00
188	600258	首旅酒店	100	1,413.00	0.00
189	000739	普洛药业	100	1,400.00	0.00
190	601808	中海油服	100	1,376.00	0.00
191	000883	湖北能源	300	1,353.00	0.00
192	601156	东航物流	100	1,309.00	0.00
193	002385	大北农	300	1,212.00	0.00
194	688387	信科移动	200	1,130.00	0.00
195	603707	健友股份	100	1,115.00	0.00
196	601898	中煤能源	100	1,094.00	0.00
197	002410	广联达	80	1,072.80	0.00
198	603225	新凤鸣	100	1,065.00	0.00
199	600056	中国医药	100	1,034.00	0.00
200	600499	科达制造	100	980.00	0.00
201	600884	杉杉股份	100	946.00	0.00
202	601611	中国核建	100	919.00	0.00
203	600867	通化东宝	100	820.00	0.00
204	601918	新集能源	100	646.00	0.00
205	601139	深圳燃气	100	636.00	0.00
206	600018	上港集团	100	571.00	0.00
207	002195	岩山科技	100	563.00	0.00
208	002044	美年健康	100	514.00	0.00
209	601158	重庆水务	100	464.00	0.00
210	002436	兴森科技	30	397.20	0.00
211	400174	中天 3	100	1.00	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	300750	宁德时代	19,832,846.00	1.85
2	600519	贵州茅台	18,363,486.30	1.72
3	600036	招商银行	17,602,481.88	1.65
4	600115	中国东航	17,581,715.00	1.64

5	601328	交通银行	17,428,252.00	1.63
6	601117	中国化学	17,297,499.00	1.62
7	601818	光大银行	17,286,883.00	1.62
8	601166	兴业银行	16,726,521.00	1.56
9	600029	南方航空	16,435,750.00	1.54
10	601728	中国电信	16,301,201.00	1.52
11	000728	国元证券	16,128,029.00	1.51
12	601816	京沪高铁	15,962,313.00	1.49
13	300059	东方财富	15,860,756.95	1.48
14	002001	新和成	15,825,895.18	1.48
15	002027	分众传媒	15,613,346.00	1.46
16	601169	北京银行	15,583,267.00	1.46
17	000166	申万宏源	15,559,801.00	1.45
18	601318	中国平安	15,434,339.00	1.44
19	601988	中国银行	15,428,207.00	1.44
20	001965	招商公路	15,277,674.73	1.43

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	300750	宁德时代	22,673,336.20	2.12
2	600519	贵州茅台	21,722,184.20	2.03
3	600036	招商银行	18,553,765.00	1.73
4	601166	兴业银行	18,157,407.00	1.70
5	002027	分众传媒	18,112,021.00	1.69
6	002001	新和成	17,870,001.00	1.67
7	600000	浦发银行	17,412,469.00	1.63
8	601818	光大银行	16,869,518.00	1.58
9	601328	交通银行	16,742,362.00	1.56
10	601728	中国电信	16,331,196.00	1.53
11	601169	北京银行	16,284,151.66	1.52
12	300059	东方财富	16,177,476.00	1.51
13	000166	申万宏源	16,076,510.97	1.50
14	601117	中国化学	16,021,521.00	1.50
15	001965	招商公路	15,884,319.00	1.48
16	601816	京沪高铁	15,753,724.00	1.47
17	002966	苏州银行	15,387,606.62	1.44
18	600029	南方航空	15,226,301.00	1.42
19	600900	长江电力	15,132,685.00	1.41
20	000683	博源化工	15,049,621.00	1.41

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	5,744,259,104.08
卖出股票收入（成交）总额	5,816,643,945.75

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

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）	11,651.33	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,651.33	0.00

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

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	123257	安克转债	111	11,100.73	0.00
2	123255	鼎龙转债	4	550.60	0.00

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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。

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	245,885.69
2	应收清算款	7,233,911.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,285.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,551,083.33

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

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	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（%）
76,067	17,643.02	10,878,073.63	0.81	1,331,173,356.07	99.19

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	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	581,151.56	0.04

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

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	1,449,592,847.71
本报告期基金总申购份额	155,026,626.86
减：本报告期基金总赎回份额	262,568,044.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,342,051,429.70

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：
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 (%)	
中金公司	1	2,786,742,056.14	24.11	545,939.77	24.11	-
申万宏源	2	2,358,670,542.62	20.41	462,063.44	20.41	-
中信建投	1	1,807,712,890.24	15.64	354,097.50	15.64	-
华泰证券	1	1,621,710,131.95	14.03	317,702.34	14.03	-
银河证券	2	1,441,809,635.07	12.47	282,444.35	12.47	-
国信证券	1	1,056,764,103.46	9.14	207,003.94	9.14	-
广发证券	1	374,495,956	3.24	73,364.74	3.24	-

		. 92				
东方财富	1	110, 691, 781 . 80	0. 96	21, 687. 01	0. 96	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：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，并经公司相关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：中金公司。

撤销交易单元的证券公司：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 (%)
中金公司	107,032.46	22.23	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	271,216.83	56.33	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	103,200.00	21.44	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 4 日

2	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（2025 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	2025 年 1 月 8 日
3	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 8 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（兴福电子）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 16 日
5	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2024 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	2025 年 1 月 22 日
6	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 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	2025 年 1 月 22 日
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票华大九天（301269）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	2025 年 3 月 27 日
8	华安基金管理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）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
10	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
11	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票海光信息估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 10 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 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；

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

2025 年 8 月 30 日