华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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遵规守信情况的说明 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遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
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 43
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 44

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 44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末上市基金前十名持有人 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 46
§9 开放式基金份额变动 46
§10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 50
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 50
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安中证沪港深科技100ETF
场内简称	AH科技(扩位简称:沪港深科技ETF)
基金主代码	517360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年6月18日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,583,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021年7月5日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。
投资策略	1、组合复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、港股通标的股票投资策略 8、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证沪港深科技100指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	任航
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临	北京市东城区建国门内大街69

	港新片区环湖西二路888号B楼2118室	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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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	14,216,759.57
本期利润	13,170,548.61
加权平均基金份额本期利润	0.2672
本期加权平均净值利润率	27.42%
本期基金份额净值增长率	19.77%
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	1,414,958.53
期末可供分配基金份额利润	0.0434
期末基金资产净值	33,997,958.53
期末基金份额净值	1.0434
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	4.34%

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	2.43%	1.03%	2.60%	1.04%	-0.17%	-0.01%
过去三个月	1.37%	2.30%	0.66%	2.33%	0.71%	-0.03%
过去六个月	19.77%	2.18%	19.96%	2.23%	-0.19%	-0.05%
过去一年	46.52%	1.88%	48.03%	1.92%	-1.51%	-0.04%
过去三年	30.95%	1.49%	31.82%	1.52%	-0.87%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.34%	1.48%	5.10%	1.52%	-0.76%	-0.04%

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

§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		
王超	本基金的基金经理	2025年3月31日	-	11年	硕士研究生，11年基金行业从业经验，2014年应届毕业加入华安基金，历任基金运营部基金会计，指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2025年3月起，王超先生同时担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金、华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）及其联接基金的基金经理。2025年6月起，同时担任华安中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金、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、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。
倪斌	指数投资部副总监、本基金的基金经理	2021年6月18日	2025年3月31日	14年	硕士研究生，14年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018年9月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018年9月至2025年3月，同时担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018年9月至2022年12月，同时担任华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2022年12月起，

					同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)(由华安纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来)的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金（QDII)的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2023 年 11 月，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 6 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车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 4 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利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。2024 年 5 月起，同时担任华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月起，同时担任华安法国 CAC40 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。2024 年 11 月至 2024 年 12 月，同时担任华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）（由华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型而来）的基金经理。2025 年 5 月起，同时担任华安恒指港股通交易型开放式指数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

上半年，国内经济总体保持稳健，生产、需求、就业等宏观指标维持向好态势，出口保持韧性。央行降准降息落地，流动性合理充裕。海外来看，美联储货币政策维持联邦基金利率不变。报告期内，受益于国内经济基本面稳重向好，南向资金持续流入、AI大模型技术突破等因素港股和 A 股的科技板块整体表现较好。期间受对等关税影响发生一定幅度的调整，后续随着不确定性逐渐缓和，市场重回基本面及产业趋势主线。

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1.0434元，本报告期份额净值增长率为19.77%，同期业绩比较基准增长率为19.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，国内经济将延续稳重向好态势，流动性保持合理宽松，政策层面仍有空间，关税影响缓和。海外来看，欧美央行仍然具备降息空间，港股市场的流动性有望进一步提升，国内货币政策空间或进一步打开。目前指数中港股占比相对更高，港股估值横向、纵向对比仍然相对合理，目前指数PE估值在23倍左右。同时，也需要关注不确定性事件对市场可能带来的扰动。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

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，本基金已出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形，报告期内的具体时间范围如下：

2025年3月11日-2025年5月30日。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金

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	1,411,159.74	3,815,070.68
结算备付金		1,019,827.03	4,023.26
存出保证金		7,638.04	4,365.73
交易性金融资产	6.4.7.2	32,544,518.64	62,605,444.75
其中：股票投资		32,541,818.46	62,605,444.75
基金投资		-	-
债券投资		2,700.18	-
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		120,457.47	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		35,103,600.92	66,428,904.42
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		14.34	39.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,697.71	27,995.34
应付托管费		2,939.56	5,599.05
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	1,087,990.78	110,919.37
负债合计		1,105,642.39	144,553.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,583,000.00	76,083,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,414,958.53	-9,798,648.58
净资产合计		33,997,958.53	66,284,351.42
负债和净资产总计		35,103,600.92	66,428,904.42

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值1.0434元，基金份额总额32,583,000.00份。

6.2 利润表

会计主体：华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金

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		13,369,126.79	1,512,901.63
1.利息收入		8,690.68	8,215.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,690.68	8,215.07
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）		14,359,618.58	-1,340,830.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	14,109,810.25	-1,872,808.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.18	1,904.95
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	-	-
股利收益	6.4.7.13	249,808.15	530,072.95
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	-1,046,210.96	2,828,964.04
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	47,028.49	16,553.07
减：二、营业总支出		198,578.18	247,030.96
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	120,506.02	149,659.00
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	24,101.22	29,931.78
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		-	-
8．其他费用	6.4.7.17	53,970.94	67,440.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,170,548.61	1,265,870.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,170,548.61	1,265,870.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,170,548.61	1,265,870.67

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金

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	76,083,000.00	-	-9,798,648.58	66,284,351.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	76,083,000.00	-	-9,798,648.58	66,284,351.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-43,500,000.00	-	11,213,607.11	-32,286,392.89
（一）、综合收益总额	-	-	13,170,548.61	13,170,548.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-43,500,000.00	-	-1,956,941.50	-45,456,941.50
其中：1.基金申购款	21,000,000.00	-	31,469.55	21,031,469.55

2.基金赎回款	-64,500,000.00	-	-1,988,411.05	-66,488,411.05
（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	32,583,000.00	-	1,414,958.53	33,997,958.53
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	82,083,000.00	-	-23,830,496.74	58,252,503.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	82,083,000.00	-	-23,830,496.74	58,252,503.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列）	-1,500,000.00	-	627,828.89	-872,171.11
（一）、综合收益总额	-	-	1,265,870.67	1,265,870.67
（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）	-1,500,000.00	-	-638,041.78	-2,138,041.78
其中：1.基金申购款	13,500,000.00	-	-4,813,532.01	8,686,467.99
2.基金赎回款	-15,000,000.00	-	4,175,490.23	-10,824,509.77
（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	80,583,000.00	-	-23,202,667.85	57,380,332.15

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：

朱学华	朱学华	陈松一
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

华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金（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[2021]1108号文《关于准予华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于2021年6月18日正式生效，首次设立募集规模为287,583,000.00份基金份额。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、港股通标的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不得低于非现金基金资产的80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证沪港深科技100指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	1,411,159.74
等于：本金	1,411,035.62
加：应计利息	124.12
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	1,411,159.74

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		27,482,734.89	-	32,541,818.46	5,059,083.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,700.00	0.18	2,700.18	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,700.00	0.18	2,700.18	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		27,485,434.89	0.18	32,544,518.64	5,059,083.57

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,005.84
其中：交易所市场	18,005.84
银行间市场	-
应付利息	-

应付替代款	1,020,396.37
预提审计费	9,916.99
预提信息披露费	39,671.58
合计	1,087,990.78

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	76,083,000.00	76,083,000.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-64,500,000.00	-64,500,000.00
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	32,583,000.00	32,583,000.00

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	-16,738,108.23	6,939,459.65	-9,798,648.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-16,738,108.23	6,939,459.65	-9,798,648.58
本期利润	14,216,759.57	-1,046,210.96	13,170,548.61
本期基金份额交易产生的变动数	4,699,039.77	-6,655,981.27	-1,956,941.50
其中：基金申购款	-860,982.50	892,452.05	31,469.55
基金赎回款	5,560,022.27	-7,548,433.32	-1,988,411.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,177,691.11	-762,732.58	1,414,958.53

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	8,021.66
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	647.41
其他	21.61
合计	8,690.68

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	13,882,662.02
股票投资收益——赎回差价收入	227,148.23
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	14,109,810.25

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	55,557,361.74
减：卖出股票成本总额	41,585,824.95
减：交易费用	88,874.77
买卖股票差价收入	13,882,662.02

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	66,488,411.05
减：现金支付赎回款总额	57,797,355.05
减：赎回股票成本总额	8,463,907.77
减：交易费用	-
赎回差价收入	227,148.23

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

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	0.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.18

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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	249,808.15
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	249,808.15

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	-1,046,210.96
股票投资	-1,046,210.96
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	-
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	-1,046,210.96

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	-
替代损益收入	47,028.49
合计	47,028.49

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,017.93
证券组合费	1,364.44
合计	53,970.94

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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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(“华安基金公司”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
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

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	120,506.02	149,659.00
其中:应支付销售机构的客户维护费	20,648.55	25,933.95
应支付基金管理人的净管理费	99,857.47	123,725.05

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/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 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
当期发生的基金应支付的托管费	24,101.22	29,931.78

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	1,411,159.74	8,021.66	3,658,073.37	7,422.23

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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
01211	比亚迪股份	2025年6月10日	1-6个月（含）	红股及资本公积转增股本未上市	77.73	111.71	16,000	1,243,696.36	1,787,422.00	-
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	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

				类型						
123257	安克转债	2025年6月16日	1-6个月（含）	配债未上市	100.00	100.01	27	2,700.00	2,700.18	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金属于股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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时间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、结算备付金和存出保证金等。

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	1,411,159.74	-	-	-	1,411,159.74
结算备付金	1,019,827.03	-	-	-	1,019,827.03
存出保证金	7,638.04	-	-	-	7,638.04

交易性金融资产	2,700.18	-	-	32,541,818.46	32,544,518.64
应收股利	-	-	-	120,457.47	120,457.47
资产总计	2,441,324.99	-	-	32,662,275.93	35,103,600.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,697.71	14,697.71
应付托管费	-	-	-	2,939.56	2,939.56
应付清算款	-	-	-	14.34	14.34
其他负债	-	-	-	1,087,990.78	1,087,990.78
负债总计	-	-	-	1,105,642.39	1,105,642.39
利率敏感度缺口	2,441,324.99	-	-	31,556,633.54	33,997,958.53
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	3,815,070.68	-	-	-	3,815,070.68
结算备付金	4,023.26	-	-	-	4,023.26
存出保证金	4,365.73	-	-	-	4,365.73
交易性金融资产	-	-	-	62,605,444.75	62,605,444.75
资产总计	3,823,459.67	-	-	62,605,444.75	66,428,904.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	27,995.34	27,995.34
应付托管费	-	-	-	5,599.05	5,599.05
应付清算款	-	-	-	39.24	39.24
其他负债	-	-	-	110,919.37	110,919.37
负债总计	-	-	-	144,553.00	144,553.00
利率敏感度缺口	3,823,459.67	-	-	62,460,891.75	66,284,351.42

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0.01%(2024年12月31日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	22,355,276.04	-	22,355,276.04
应收股利	-	120,457.47	-	120,457.47
资产合计	-	22,475,733.51	-	22,475,733.51
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	22,475,733.51	-	22,475,733.51
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	43,685,980.55	-	43,685,980.55
资产合计	-	43,685,980.55	-	43,685,980.55
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	43,685,980.55	-	43,685,980.55

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	港币相对人民币升值5%	1,123,786.68	2,184,299.03

	港币相对人民币贬值5%	-1,123,786.68	-2,184,299.03

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的股票，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。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。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 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	32,541,818.46	95.72	62,605,444.75	94.45
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	2,700.18	0.01	-	-
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	32,544,518.64	95.72	62,605,444.75	94.45

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%	1,659,763.77	3,224,478.22
	业绩比较基准下降5%	-1,659,763.77	-3,224,478.22

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	32,541,818.46	62,605,444.75
第二层次	2,700.18	-
第三层次	-	-
合计	32,544,518.64	62,605,444.75

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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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

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

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	32,541,818.46	92.70
	其中：股票	32,541,818.46	92.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,700.18	0.01
	其中：债券	2,700.18	0.01
	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	2,430,986.77	6.93
8	其他各项资产	128,095.51	0.36
9	合计	35,103,600.92	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为22,355,276.04元，占基金资产净值比例为65.75%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,104,105.02	23.84
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	2,082,437.40	6.13
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	10,186,542.42	29.96

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

本基金本报告期末未持有境内积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	621,752.92	1.83
非日常生活消费品	9,577,402.86	28.17
日常消费品	-	-
医疗保健	2,025,399.91	5.96
金融	43,682.41	0.13
信息技术	4,889,219.31	14.38
通信服务	5,197,818.63	15.29
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	22,355,276.04	65.75

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	01810	小米集团-W	67,400	3,684,852.53	10.84
2	00700	腾讯控股	7,100	3,256,847.04	9.58
3	09988	阿里巴巴-W	31,100	3,114,108.62	9.16
4	03690	美团-W	24,600	2,810,976.44	8.27
5	600276	恒瑞医药	27,000	1,401,300.00	4.12
6	01024	快手-W	18,500	1,067,939.05	3.14
7	02015	理想汽车-W	9,200	897,723.58	2.64
8	000725	京东方A	224,500	895,755.00	2.63
9	01801	信达生物	10,000	714,968.80	2.10
10	002230	科大讯飞	14,100	675,108.00	1.99
11	601127	赛力斯	5,000	671,600.00	1.98
12	600031	三一重工	36,300	651,585.00	1.92
13	002415	海康威视	22,200	615,606.00	1.81
14	00175	吉利汽车	37,000	538,524.71	1.58
15	600050	中国联通	94,600	505,164.00	1.49
16	00992	联想集团	52,000	446,709.59	1.31
17	000425	徐工机械	49,800	386,946.00	1.14
18	01093	石药集团	50,000	351,100.75	1.03
19	01177	中国生物制药	69,000	330,983.13	0.97
20	00268	金蝶国际	22,000	309,771.18	0.91

21	600570	恒生电子	9,160	307,226.40	0.90
22	09626	哔哩哔哩-W	1,800	275,281.23	0.81
23	01530	三生制药	12,000	258,811.41	0.76
24	002422	科伦药业	6,800	244,256.00	0.72
25	03888	金山软件	5,800	216,332.78	0.64
26	09863	零跑汽车	4,100	204,523.03	0.60
27	002001	新 和 成	9,400	199,938.00	0.59
28	000661	长春高新	1,900	188,442.00	0.55
29	600066	宇通客车	7,500	186,450.00	0.55
30	002236	大华股份	11,600	184,208.00	0.54
31	02338	潍柴动力	12,000	174,437.80	0.51
32	01357	美图公司	20,500	168,815.62	0.50
33	02018	瑞声科技	4,500	167,023.64	0.49
34	600487	亨通光电	10,900	166,770.00	0.49
35	00285	比亚迪电子	5,500	159,500.06	0.47
36	600482	中国动力	6,900	159,183.00	0.47
37	02333	长城汽车	14,000	154,228.98	0.45
38	688002	睿创微纳	2,116	147,527.52	0.43
39	601877	正泰电器	6,500	147,355.00	0.43
40	300454	深信服	1,500	141,270.00	0.42
41	300866	安克创新	1,200	136,320.00	0.40
42	002410	广联达	10,000	134,100.00	0.39
43	600143	金发科技	12,800	131,968.00	0.39
44	300115	长盈精密	5,700	121,980.00	0.36
45	01766	中国中车	27,000	116,711.36	0.34
46	688099	晶晨股份	1,600	113,616.00	0.33
47	600521	华海药业	5,500	102,465.00	0.30
48	00763	中兴通讯	4,600	101,937.77	0.30
49	002594	比亚迪	300	99,573.00	0.29
50	002139	拓邦股份	6,700	92,527.00	0.27
51	300724	捷佳伟创	1,700	92,310.00	0.27
52	603444	吉比特	300	90,585.00	0.27
53	03898	时代电气	3,100	89,334.62	0.26
54	09899	网易云音乐	400	87,911.98	0.26
55	300558	贝达药业	1,500	86,925.00	0.26
56	603236	移远通信	1,000	85,800.00	0.25
57	03933	联邦制药	6,000	82,184.93	0.24
58	688208	道通科技	2,631	80,508.60	0.24
59	02400	心动公司	1,800	79,202.86	0.23
60	600380	健康元	6,700	73,901.00	0.22
61	00512	远大医药	8,500	67,593.73	0.20
62	002396	星网锐捷	2,900	65,105.00	0.19
63	002249	大洋电机	9,800	64,484.00	0.19

64	00656	复星国际	15,000	63,882.10	0.19
65	002773	康弘药业	2,200	63,734.00	0.19
66	600216	浙江医药	4,100	60,639.00	0.18
67	02357	中航科工	15,000	60,599.08	0.18
68	600582	天地科技	9,800	58,702.00	0.17
69	00696	中国民航信息网络	6,000	57,452.85	0.17
70	002073	软控股份	6,200	55,118.00	0.16
71	02196	复星医药	3,500	53,878.01	0.16
72	002906	华阳集团	1,600	52,016.00	0.15
73	02096	先声药业	5,000	50,704.42	0.15
74	601126	四方股份	3,100	50,437.00	0.15
75	000682	东方电子	4,900	50,176.00	0.15
76	688063	派能科技	1,090	49,137.20	0.14
77	600062	华润双鹤	2,500	46,650.00	0.14
78	09636	九方智投控股	1,000	43,682.41	0.13
79	01302	先健科技	22,000	40,727.69	0.12
80	688425	铁建重工	9,659	39,408.72	0.12
81	603859	能科科技	1,100	35,552.00	0.10
82	002204	大连重工	5,800	34,626.00	0.10
83	02039	中集集团	5,700	32,228.31	0.09
84	002533	金杯电工	3,100	30,194.00	0.09
85	002970	锐明技术	600	29,640.00	0.09
86	00460	四环医药	28,000	28,343.41	0.08
87	01860	汇量科技	4,000	25,899.38	0.08
88	00631	三一国际	4,000	24,622.65	0.07
89	01072	东方电气	2,000	24,440.26	0.07
90	01513	丽珠医药	900	24,253.31	0.07
91	600268	国电南自	3,000	23,460.00	0.07
92	688717	艾罗能源	406	21,854.98	0.06
93	01789	爱康医疗	4,000	21,850.32	0.06
94	603111	康尼机电	3,300	21,714.00	0.06
95	00777	网龙	2,000	19,588.69	0.06
96	06869	长飞光纤光缆	1,000	19,424.54	0.06
97	00564	郑煤机	1,400	18,972.21	0.06
98	02155	森松国际	3,000	16,524.53	0.05
99	300206	理邦仪器	1,300	15,626.00	0.05
100	02285	泉峰控股	900	12,442.65	0.04

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	01211	比亚迪股份	16,000	1,787,422.00	5.26

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	01810	小米集团-W	2,395,938.27	3.61
2	03690	美团-W	1,753,301.98	2.65
3	09988	阿里巴巴-W	1,123,291.15	1.69
4	00700	腾讯控股	1,108,688.32	1.67
5	01211	比亚迪股份	734,976.22	1.11
6	002230	科大讯飞	709,902.00	1.07
7	601127	赛力斯	681,081.00	1.03
8	600031	三一重工	679,828.00	1.03
9	000725	京东方A	640,115.00	0.97
10	00992	联想集团	463,427.09	0.70
11	002415	海康威视	433,257.00	0.65
12	02015	理想汽车-W	292,938.46	0.44
13	00268	金蝶国际	281,675.87	0.42
14	000425	徐工机械	280,600.00	0.42
15	01024	快手-W	270,477.34	0.41
16	300866	安克创新	219,013.00	0.33
17	002001	新 和 成	217,008.00	0.33
18	09863	零跑汽车	212,530.01	0.32
19	002422	科伦药业	204,888.00	0.31
20	002594	比亚迪	204,054.00	0.31

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	01810	小米集团-W	9,583,721.59	14.46
2	09988	阿里巴巴-W	6,973,196.11	10.52
3	00700	腾讯控股	5,400,943.69	8.15
4	01211	比亚迪股份	4,473,005.55	6.75
5	03690	美团-W	4,139,244.97	6.24
6	000725	京东方A	1,974,500.00	2.98
7	01024	快手-W	1,560,402.62	2.35
8	02015	理想汽车-W	1,536,422.15	2.32
9	002415	海康威视	1,429,786.00	2.16
10	00728	中国电信	1,406,978.27	2.12
11	00175	吉利汽车	974,253.14	1.47

12	000425	徐工机械	893,231.00	1.35
13	02382	舜宇光学科技	848,310.33	1.28
14	01801	信达生物	722,402.75	1.09
15	002422	科伦药业	572,699.00	0.86
16	002517	恺英网络	540,751.00	0.82
17	300866	安克创新	447,222.00	0.67
18	03692	翰森制药	443,304.47	0.67
19	09626	哔哩哔哩-W	433,840.42	0.65
20	002236	大华股份	428,836.00	0.65

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	18,234,752.39
卖出股票收入（成交）总额	55,557,361.74

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）	2,700.18	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,700.18	0.01

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	27	2,700.18	0.01

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	7,638.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	120,457.47
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,095.51

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	01211	比亚迪股份	1,787,422.00	5.26	红股及资本公积转增股本未上市

§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（%）
1,109	29,380.52	4,366,490.00	13.40	28,216,510.00	86.60

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 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信建投证券股份有限公司	2,557,499.00	7.85
2	阎如一	2,030,000.00	6.23
3	罗金海	1,000,000.00	3.07
4	中信证券股份有限公司	961,900.00	2.95
5	公丕珂	707,300.00	2.17
6	华泰证券股份有限公司	647,091.00	1.99
7	周桂学	600,000.00	1.84
8	丘成倩	543,900.00	1.67
9	金良梅	500,000.00	1.53
10	李炳国	500,000.00	1.53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月18日）基金份额总额	287,583,000.00
本报告期期初基金份额总额	76,083,000.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	64,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,583,000.00

§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：

2025年2月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025年3月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025年4月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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(%)	
招商证券	4	58,180,581.66	78.84	14,947.58	83.02	-
中信证券	2	12,061,369.00	16.35	2,362.82	13.12	-
中信建投	3	3,550,163.47	4.81	695.44	3.86	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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：无。

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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,700.00	100.00	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年1月8日
2	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金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
3	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025年2月17日
4	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数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2月28日
5	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数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2月28日
6	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为一级交易商的公告	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20日
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	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20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	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数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3月29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	华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金2024年年度	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025年3月31日

	报告	站	
12	华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 2 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 2 日
13	华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数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 4 月 2 日
14	关于华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 15 日
15	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
16	华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金 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
17	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	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 16 日
18	关于华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告	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 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250603~20250603	0.00	16,500,000.00	16,500,000.00	0.00	0.00
个人	1	20250101~20250205	16,400,800.00	700,000.00	17,100,800.00	0.00	0.00
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、《华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

2、《华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准华安中证沪港深科技100交易型开放式指数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