华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
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 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
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 57
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 57
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 57

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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
7.12 投资组合报告附注 57

§8 基金份额持有人信息 58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
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 59

§9 开放式基金份额变动 59

§10 重大事件揭示 59

10.1 基金份额持有人大会决议 59
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 59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 59
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 60
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 60
10.8 其他重大事件 62

§11 影响投资者决策的其他重要信息 64

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 64

§12 备查文件目录 64

12.1 备查文件目录 64
12.2 存放地点 64
12.3 查阅方式 64

§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	1,064,424,846.19 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	徐勇	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	77,507,058.86
本期利润	136,715,637.95
加权平均基金份额本期利润	0.1221
本期加权平均净值利润率	13.15%
本期基金份额净值增长率	13.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	696,289,608.98
期末可供分配基金份额利润	0.6541
期末基金资产净值	1,066,746,606.85
期末基金份额净值	1.0022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	598.09%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	16.16%	1.36%	14.26%	1.35%	1.90%	0.01%
过去六个月	13.82%	1.24%	10.82%	1.22%	3.00%	0.02%
过去一年	36.84%	1.09%	32.97%	1.08%	3.87%	0.01%
过去三年	29.54%	1.16%	33.96%	1.14%	-4.42%	0.02%
过去五年	-5.76%	1.16%	1.93%	1.11%	-7.69%	0.05%
过去七年	48.89%	1.20%	43.92%	1.15%	4.97%	0.05%
过去十年	76.63%	1.18%	46.34%	1.12%	30.29%	0.06%
自基金合同生效起至今	598.09%	1.49%	322.85%	1.46%	275.24%	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

§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、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份

有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金 ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等 303 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,198.27 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		
张序	量化投资部助理总监、本基金的基金经理	2025 年 7 月 21 日	-	9 年	硕士研究生，9 年金融、基金行业从业经验。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司量化分析师。2017 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部量化分析师、基金经理助理。2020 年 5 月起，担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月至 2025 年 3 月，同时担任华安创新医药锐选量化股票型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月至 2025 年 8 月，同时担任华安中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 8 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发起式联接基金的基金经理（由华安中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金转型而来）。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、华安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起，同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金、华安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起，同时担任华安智优量化选股股票型证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起，同时担任华安智享量化选股股票型证券

					投资基金的基金经理。
欧阳俊	本基金的基金经理	2026 年 3 月 2 日	-	7 年	硕士研究生，7 年证券、基金行业从业经验。曾任摩根士丹利高级分析师。2022 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2026 年 3 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。

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

2026 年一季度 A 股市场整体呈震荡运行态势，国内经济稳步复苏、通胀温和回升，有效提振市场投资者信心，支撑 A 股走出较强韧性行情。行业层面结构性机会凸显，AI 产业链、新能源、商业航天、化工等高景气细分赛道关注度持续走高，板块整体表现优异。外部环境方面，海外各类扰动因素明显增多，对全球风险资产形成压制，但国内 A 股受内部基本面支撑，波动幅度显著小于海外权益市场，整体表现相对稳健。

2026 年二季度 A 股市场结构性特征进一步放大，整体呈现 “行业主线极致演绎、风格因子剧烈切换” 的行情格局。行业端，半导体、PCB、光通信、国产算力等科技制造产业链贯穿整季，成为市场核心投资主线；季末受外部扰动与流动性博弈影响，资金避险情绪升温，煤炭、银行等红利防御板块及部分顺周期板块迎来阶段性超额收益。风格端，4-5 月市场极致演绎高换手、高波动、高估值的成长风格，相关标的收益突出，6 月底市场风格快速反转，高位题材回调，资金持续流向防御板块，风格博弈剧烈，市场整体波动率较一季度显著放大。

投资策略层面，上半年始终以多因子投资框架为核心基础，结合市场行情持续迭代优化投资与风控体系。一季度依托多因子框架，叠加机器学习模型优化选股策略，同时通过风险控制模型

动态跟踪组合与基准指数的跟踪误差，严控组合波动。二季度针对市场高波动、快切换的特征，进一步提升机器学习策略权重，投资目标聚焦提升选股胜率与信息比率，强化超额收益稳定性，同时持续迭代优化风控模型，进一步缩小组合跟踪误差，实现不同市场环境下收益与风险的动态平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0022 元，本报告期份额净值增长率为 13.82%，同期业绩比较基准增长率为 10.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年 A 股结构性分化显著，科技板块凭借产业趋势与业绩优势明显跑赢市场。展望下半年，市场将延续分化格局，行情由流动性驱动转向盈利驱动，业绩确定性成为核心选股逻辑。

国内外经济呈现明显 K 型分化，国内经济动能切换特征突出，科技高端制造持续领跑，传统内需相关板块整体偏弱。科技依旧是全年核心主线，AI 赛道进入去伪存真阶段，市场逐步脱离概念炒作，聚焦具备真实业绩与持续产业落地能力的标的。当前成长风格持续时间较长、机构抱团集中，下半年有望迎来成长向价值的风格切换拐点。

资金面整体边际改善，增量资金入市将对市场形成支撑。行业配置上，下半年重点围绕三条主线布局：一是 AI 科技产业链优质成长方向；二是高景气出口制造赛道；三是资源安全与能源重构领域，整体把握结构性行情机遇。

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

本报告期内实施了 2025 年度第一次分红，以 2025 年 12 月 31 日的可供分配利润 688,602,005.30 元为基准计算，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.13410 元。

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 2026 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	61,608,004.63	60,663,557.13
结算备付金		2,445,380.94	3,050,551.91
存出保证金		139,877.52	235,382.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,004,777,135.71	974,866,738.18
其中：股票投资		1,004,758,596.10	974,848,355.96
基金投资		-	-
债券投资		18,539.61	18,382.22
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		2,512,010.19	12,563,483.51
应收股利		-	-
应收申购款		174,664.52	36,368.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,071,657,073.51	1,051,416,082.46
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,292,046.36	3,134,699.02
应付管理人报酬		853,101.26	887,652.19
应付托管费		170,620.27	177,530.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,594,698.63	2,187,911.28
负债合计		4,910,466.66	6,387,792.93
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	324,354,564.21	356,426,284.23
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	742,392,042.64	688,602,005.30
净资产合计		1,066,746,606.85	1,045,028,289.53
负债和净资产总计		1,071,657,073.51	1,051,416,082.46

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0022 元，基金份额总额 1,064,424,846.19 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		142,998,206.56	13,474,320.25
1.利息收入		115,656.60	118,202.18
其中：存款利息收入	6.4.7.9	115,656.60	118,202.18
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）		83,668,576.05	6,195,158.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	74,726,216.97	-5,932,956.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14.49	41,938.62
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	8,942,344.59	12,086,176.47
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	59,208,579.09	7,155,956.23

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	5,394.82	5,003.04
减：二、营业总支出		6,282,568.61	6,211,567.26
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	5,152,147.88	5,092,962.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	1,030,429.61	1,018,592.49
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		0.01	0.14
8．其他费用	6.4.7.17	99,991.11	100,011.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		136,715,637.95	7,262,752.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		136,715,637.95	7,262,752.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		136,715,637.95	7,262,752.99

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	356,426,284.23	-	688,602,005.30	1,045,028,289.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	356,426,284.23	-	688,602,005.30	1,045,028,289.53
三、本期增减变	-32,071,720.02	-	53,790,037.34	21,718,317.32

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	136,715,637.95	136,715,637.95
（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）	-32,071,720.02	-	-67,852,848.90	-99,924,568.92
其中：1.基金申购款	30,488,920.47	-	61,686,701.34	92,175,621.81
2.基金赎回款	-62,560,640.49	-	-129,539,550.24	-192,100,190.73
（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）	-	-	-15,072,751.71	-15,072,751.71
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	324,354,564.21	-	742,392,042.64	1,066,746,606.85

项目	上年度可比期间 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	-32,770,968.37	-	-47,039,473.07	-79,810,441.44

金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
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	-	-112,581,834.09	-192,592,393.63
（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

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：

徐勇	任志浩	童欣
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”），系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》的核准，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，跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《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》，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：95%*MSCI 中国 A 股指数收益率+5%*金融同业存款利率。

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，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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》、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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	61,608,004.63
等于：本金	61,602,527.17
加：应计利息	5,477.46
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	61,608,004.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		886,745,446.89	-	1,004,758,596.10	118,013,149.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,500.00	1.78	18,539.61	7,037.83
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,500.00	1.78	18,539.61	7,037.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		886,756,946.89	1.78	1,004,777,135.71	118,020,187.04

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 2026 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	1,003,950.66
其中：交易所市场	1,001,519.47
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	59,507.37
合计	1,594,698.63

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,169,671,994.04	356,426,284.23
本期申购	100,055,427.50	30,488,920.47
本期赎回（以“-”号填列）	-205,302,575.35	-62,560,640.49
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	1,064,424,846.19	324,354,564.21

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	700,147,110.17	-11,545,104.87	688,602,005.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	700,147,110.17	-11,545,104.87	688,602,005.30
本期利润	77,507,058.86	59,208,579.09	136,715,637.95
本期基金份额交易产生的变动数	-66,291,808.34	-1,561,040.56	-67,852,848.90
其中：基金申购款	63,515,221.12	-1,828,519.78	61,686,701.34
基金赎回款	-129,807,029.46	267,479.22	-129,539,550.24
本期已分配利润	-15,072,751.71	-	-15,072,751.71
本期末	696,289,608.98	46,102,433.66	742,392,042.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	109,499.99
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	5,825.08
其他	331.53
合计	115,656.60

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	74,726,216.97
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	74,726,216.97

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,610,490,863.03
减：卖出股票成本总额	2,533,130,073.87
减：交易费用	2,634,572.19
买卖股票差价收入	74,726,216.97

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	14.49
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	14.49

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,942,344.59
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	8,942,344.59

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	59,208,579.09
股票投资	59,208,413.32
债券投资	165.77
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	59,208,579.09

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,299.83
基金转换费收入	1,094.99
合计	5,394.82

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	242.00
账户维护费	9,000.00
其他	1.14
合计	99,991.11

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

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、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	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：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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（%）
国泰海通证券股份有限公司	3,624,236.00	0.07	-	-

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 2026年1月1日至2026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（%）
国泰海通证券股份有限公司	709.59	0.07	709.59	0.07
关联方名称	上年度可比期间 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（%）
-	-	-	-	-

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》，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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,152,147.88	5,092,962.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,554,635.75	1,571,326.99
应支付基金管理人的净管理费	3,597,512.13	3,521,635.72

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×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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,030,429.61	1,018,592.49

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×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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	61,608,004.63	109,499.99	53,299,535.89	103,991.28

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
国泰海通证券股份有限公司	301666	大普微	网下申购	3,048	140,451.84
国泰海通证券股份有限公司	301696	三瑞智能	网下申购	2,157	53,234.76
国泰海通证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下申购	17,168	162,580.96
上年度可比期间 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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末投资于基金管理人股东国泰海通证券股份有限公司发行的股票——国泰海通(代码 601211)43,264.00 股，期末公允价值为人民币 787,404.80 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.07%。

本基金本报告期末投资于基金托管人中国工商银行股份有限公司发行的股票——工商银行(代码 601398)657,500.00 股，期末公允价值为人民币 4,648,525.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.44%。

本基金上年度末投资于基金管理人股东国泰海通证券股份有限公司发行的股票——国泰海通(代码 601211)43,264.00 股，期末公允价值为人民币 889,075.20 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.09%。

本基金上年度末投资于基金托管人中国工商银行股份有限公司发行的股票——工商银行(代

码 601398)699,800.00 股，期末公允价值为人民币 5,549,414.00 元，占本基金期末基金资产净值比例为 0.53%。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 3 月 12 日	-	2026 年 3 月 12 日	0.1341	4,557,485.49	10,515,266.22	15,072,751.71	-
合计	-	-	-	0.1341	4,557,485.49	10,515,266.22	15,072,751.71	-

6.4.12 期末（2026 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
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股限售	10.11	10.11	29,672	299,983.92	299,983.92	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	12,716	128,558.76	128,558.76	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股限售	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8	6 个月	新股限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

		日		售						
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股限售	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股限售	114.28	676.94	3,544	405,008.32	2,399,075.36	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐	2025	9个月	新	104.66	768.89	2,629	275,151.14	2,021,411.81	-

	曦股份	年12月9日		股限售						
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股限售	19.68	141.49	1,366	26,882.88	193,275.34	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项停牌	832.00	2026年7月13日	890.99	2,090	1,127,400.58	1,738,880.00	-
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、审计委员会、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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2026 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	61,608,004.63	-	-	-	61,608,004.63
结算备付金	2,445,380.94	-	-	-	2,445,380.94
存出保证金	139,877.52	-	-	-	139,877.52
交易性金融资产	18,539.61	-	-	1,004,758,596.10	1,004,777,135.71
应收申购款	-	-	-	174,664.52	174,664.52

应收清算款	-	-	-	2,512,010.19	2,512,010.19
资产总计	64,211,802.70	-	-	1,007,445,270.81	1,071,657,073.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,292,046.36	2,292,046.36
应付管理人报酬	-	-	-	853,101.26	853,101.26
应付托管费	-	-	-	170,620.27	170,620.27
应交税费	-	-	-	0.14	0.14
其他负债	-	-	-	1,594,698.63	1,594,698.63
负债总计	-	-	-	4,910,466.66	4,910,466.66
利率敏感度缺口	64,211,802.70	-	-	1,002,534,804.15	1,066,746,606.85
上年度末 2025 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	60,663,557.13	-	-	-	60,663,557.13
结算备付金	3,050,551.91	-	-	-	3,050,551.91
存出保证金	235,382.97	-	-	-	235,382.97
交易性金融资产	18,382.22	-	-	974,848,355.96	974,866,738.18
应收申购款	-	-	-	36,368.76	36,368.76
应收清算款	-	-	-	12,563,483.51	12,563,483.51
资产总计	63,967,874.23	-	-	987,448,208.23	1,051,416,082.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,134,699.02	3,134,699.02
应付管理人报酬	-	-	-	887,652.19	887,652.19
应付托管费	-	-	-	177,530.44	177,530.44
其他负债	-	-	-	2,187,911.28	2,187,911.28
负债总计	-	-	-	6,387,792.93	6,387,792.93
利率敏感度缺口	63,967,874.23	-	-	981,060,415.30	1,045,028,289.53

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 2026 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 0.002%(2025 年 12 月 31 日：0.002%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	1,004,758,596.10	94.19	974,848,355.96	93.28
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	18,539.61	0.00	18,382.22	0.00
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,004,777,135.71	94.19	974,866,738.18	93.29

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	53,807,627.13	50,351,715.60
	业绩比较基准下降 5%	-53,807,627.13	-50,351,715.60

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	996,631,227.76	963,645,825.53
第二层次	2,167,422.68	7,926,743.40
第三层次	5,978,485.27	3,294,169.25
合计	1,004,777,135.71	974,866,738.18

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 2026 年 08 月 26 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	1,004,758,596.10	93.76
	其中：股票	1,004,758,596.10	93.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,539.61	0.00
	其中：债券	18,539.61	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	64,053,385.57	5.98
8	其他各项资产	2,826,552.23	0.26
9	合计	1,071,657,073.51	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	3,130,443.00	0.29
B	采矿业	38,660,877.10	3.62
C	制造业	685,876,784.57	64.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,500,161.60	2.02
E	建筑业	6,742,233.53	0.63
F	批发和零售业	10,406,169.19	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	13,543,655.70	1.27
H	住宿和餐饮业	92,738.45	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,880,712.93	4.96
J	金融业	135,366,282.04	12.69
K	房地产业	4,861,835.00	0.46
L	租赁和商务服务业	8,647,319.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	12,366,995.07	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	981,859.20	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,778.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,227,172.20	0.12
S	综合	1,638,704.00	0.15
	合计	997,967,720.58	93.55

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	41,285.72	0.00
C	制造业	6,263,939.32	0.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	428,542.68	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	57,106.80	0.01
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	6,790,875.52	0.64

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	300308	中际旭创	28,700	36,449,000.00	3.42
2	300750	宁德时代	79,012	31,052,506.12	2.91
3	300502	新易盛	38,688	23,483,616.00	2.20
4	603986	兆易创新	22,400	18,256,000.00	1.71
5	600519	贵州茅台	14,600	17,308,154.00	1.62
6	688256	寒武纪	9,937	15,854,980.35	1.49

7	601318	中国平安	304,900	14,555,926.00	1.36
8	600036	招商银行	382,768	13,588,264.00	1.27
9	002384	东山精密	48,388	12,694,591.80	1.19
10	688008	澜起科技	39,947	12,379,575.30	1.16
11	000333	美的集团	161,300	12,182,989.00	1.14
12	600030	中信证券	418,900	12,034,997.00	1.13
13	601899	紫金矿业	471,400	11,850,996.00	1.11
14	601166	兴业银行	621,900	10,298,664.00	0.97
15	603259	药明康德	82,357	10,254,270.07	0.96
16	002475	立讯精密	127,932	9,006,412.80	0.84
17	600900	长江电力	335,600	8,883,332.00	0.83
18	688012	中微公司	18,919	8,863,551.50	0.83
19	688981	中芯国际	52,947	8,409,042.54	0.79
20	002371	北方华创	9,480	8,385,628.80	0.79
21	688041	海光信息	21,609	8,001,812.70	0.75
22	000725	京东方 A	873,700	7,583,716.00	0.71
23	002463	沪电股份	48,010	7,335,928.00	0.69
24	300476	胜宏科技	20,800	7,205,744.00	0.68
25	300274	阳光电源	45,060	7,165,441.20	0.67
26	600183	生益科技	41,300	7,161,420.00	0.67
27	600487	亨通光电	65,000	7,107,100.00	0.67
28	300394	天孚通信	21,552	6,523,359.36	0.61
29	300475	香农芯创	21,300	6,390,000.00	0.60
30	000988	华工科技	34,400	6,350,584.00	0.60
31	000338	潍柴动力	229,467	6,252,975.75	0.59
32	300661	圣邦股份	43,100	6,183,988.00	0.58
33	688002	睿创微纳	37,928	5,867,082.32	0.55
34	002049	紫光国微	65,300	5,795,375.00	0.54
35	300408	三环集团	34,600	5,774,740.00	0.54
36	600176	中国巨石	78,500	5,721,080.00	0.54
37	300857	协创数据	16,720	5,683,128.00	0.53
38	300059	东方财富	275,300	5,610,614.00	0.53
39	600584	长电科技	53,500	5,539,925.00	0.52
40	601328	交通银行	848,500	5,455,855.00	0.51
41	600919	江苏银行	494,700	5,332,866.00	0.50
42	688525	佰维存储	10,709	5,298,063.57	0.50
43	001309	德明利	5,600	5,280,240.00	0.49
44	601985	中国核电	577,600	5,215,728.00	0.49
45	002185	华天科技	231,500	5,164,765.00	0.48
46	600150	中国船舶	151,980	5,135,404.20	0.48
47	000651	格力电器	132,000	4,950,000.00	0.46
48	688498	源杰科技	2,613	4,928,118.00	0.46
49	600000	浦发银行	565,200	4,866,372.00	0.46

50	600276	恒瑞医药	93,060	4,842,842.40	0.45
51	002415	海康威视	138,900	4,750,380.00	0.45
52	601688	华泰证券	229,424	4,730,722.88	0.44
53	600887	伊利股份	197,300	4,727,308.00	0.44
54	601398	工商银行	657,500	4,648,525.00	0.44
55	601288	农业银行	754,400	4,579,208.00	0.43
56	600999	招商证券	214,000	4,515,400.00	0.42
57	603019	中科曙光	40,500	4,342,815.00	0.41
58	002916	深南电路	9,001	4,121,557.90	0.39
59	603993	洛阳钼业	230,900	4,052,295.00	0.38
60	002028	思源电气	23,300	4,030,900.00	0.38
61	601138	工业富联	55,800	4,025,970.00	0.38
62	600031	三一重工	227,400	3,929,472.00	0.37
63	001965	招商公路	428,300	3,923,228.00	0.37
64	301308	江波龙	5,571	3,920,869.80	0.37
65	600309	万华化学	57,300	3,919,893.00	0.37
66	688396	华润微	40,000	3,902,000.00	0.37
67	600522	中天科技	64,100	3,889,588.00	0.36
68	600104	上汽集团	396,100	3,865,936.00	0.36
69	002179	中航光电	77,605	3,585,351.00	0.34
70	000519	中兵红箭	170,000	3,581,900.00	0.34
71	300433	蓝思科技	65,900	3,536,194.00	0.33
72	600497	驰宏锌锗	291,900	3,534,909.00	0.33
73	001389	广合科技	14,600	3,463,850.00	0.32
74	300413	芒果超媒	235,800	3,449,754.00	0.32
75	002008	大族激光	22,700	3,407,497.00	0.32
76	002602	世纪华通	241,500	3,405,150.00	0.32
77	601009	南京银行	341,624	3,378,661.36	0.32
78	000977	浪潮信息	47,690	3,338,300.00	0.31
79	600875	东方电气	112,400	3,233,748.00	0.30
80	600938	中国海油	118,200	3,209,130.00	0.30
81	601012	隆基绿能	244,291	3,205,097.92	0.30
82	601127	赛力斯	52,200	3,197,250.00	0.30
83	300724	捷佳伟创	45,200	3,191,120.00	0.30
84	600885	宏发股份	91,800	3,166,182.00	0.30
85	300124	汇川技术	47,700	3,163,941.00	0.30
86	300395	菲利华	23,599	3,155,894.27	0.30
87	000858	五粮液	41,844	3,096,456.00	0.29
88	002600	领益智造	178,000	3,086,520.00	0.29
89	300033	同花顺	12,440	2,998,040.00	0.28
90	002714	牧原股份	85,100	2,977,649.00	0.28
91	688110	东芯股份	14,400	2,933,280.00	0.27
92	601601	中国太保	102,700	2,929,004.00	0.27

93	688578	艾力斯	26,802	2,926,778.40	0.27
94	603799	华友钴业	60,607	2,924,893.82	0.27
95	600498	烽火通信	38,800	2,855,680.00	0.27
96	300760	迈瑞医疗	20,600	2,798,098.00	0.26
97	300346	南大光电	30,200	2,798,030.00	0.26
98	601668	中国建筑	644,700	2,797,998.00	0.26
99	002353	杰瑞股份	18,319	2,793,647.50	0.26
100	000932	华菱钢铁	794,800	2,757,956.00	0.26
101	002230	科大讯飞	66,800	2,728,112.00	0.26
102	300001	特锐德	72,000	2,723,760.00	0.26
103	600160	巨化股份	50,900	2,698,209.00	0.25
104	601995	中金公司	74,300	2,685,945.00	0.25
105	002156	通富微电	35,400	2,685,798.00	0.25
106	600998	九州通	561,051	2,631,329.19	0.25
107	688111	金山办公	12,322	2,625,202.10	0.25
108	002594	比亚迪	32,700	2,606,190.00	0.24
109	688469	芯联集成	242,600	2,573,986.00	0.24
110	002736	国信证券	254,900	2,546,451.00	0.24
111	300757	罗博特科	4,000	2,476,000.00	0.23
112	601919	中远海控	184,860	2,451,243.60	0.23
113	300054	鼎龙股份	23,000	2,437,310.00	0.23
114	601088	中国神华	61,500	2,400,960.00	0.23
115	002027	分众传媒	496,000	2,400,640.00	0.23
116	300442	润泽科技	28,400	2,359,188.00	0.22
117	600153	建发股份	297,000	2,355,210.00	0.22
118	000776	广发证券	99,800	2,335,320.00	0.22
119	601225	陕西煤业	114,400	2,328,040.00	0.22
120	000733	振华科技	40,400	2,288,256.00	0.21
121	603083	剑桥科技	8,900	2,268,343.00	0.21
122	000547	航天发展	116,800	2,236,720.00	0.21
123	002558	巨人网络	80,800	2,226,848.00	0.21
124	000792	盐湖股份	73,500	2,218,965.00	0.21
125	002223	鱼跃医疗	84,760	2,174,941.60	0.20
126	002273	水晶光电	61,200	2,171,376.00	0.20
127	600089	特变电工	96,400	2,169,000.00	0.20
128	605499	东鹏饮料	17,479	2,157,432.97	0.20
129	688347	华虹宏力	6,414	2,157,028.20	0.20
130	000408	藏格矿业	31,100	2,155,852.00	0.20
131	000001	平安银行	212,000	2,130,600.00	0.20
132	000807	云铝股份	94,500	2,092,230.00	0.20
133	002487	大金重工	36,000	2,086,920.00	0.20
134	002352	顺丰控股	65,900	2,060,034.00	0.19
135	002851	麦格米特	12,200	2,039,596.00	0.19

136	000938	紫光股份	69,900	2,017,314.00	0.19
137	601816	京沪高铁	444,300	2,012,679.00	0.19
138	002340	格林美	300,800	1,988,288.00	0.19
139	002466	天齐锂业	32,100	1,968,372.00	0.18
140	603290	斯达半导	12,800	1,957,632.00	0.18
141	601728	中国电信	375,500	1,948,845.00	0.18
142	688411	海博思创	6,600	1,921,920.00	0.18
143	300548	长芯博创	6,900	1,918,200.00	0.18
144	600060	海信视像	68,200	1,900,734.00	0.18
145	002422	科伦药业	48,900	1,883,628.00	0.18
146	600989	宝丰能源	92,600	1,882,558.00	0.18
147	000002	万科 A	628,600	1,860,656.00	0.17
148	000596	古井贡酒	23,100	1,843,380.00	0.17
149	601117	中国化学	248,900	1,829,415.00	0.17
150	000629	钒钛股份	547,700	1,829,318.00	0.17
151	600741	华域汽车	117,700	1,826,704.00	0.17
152	600066	宇通客车	67,800	1,817,718.00	0.17
153	000021	深科技	27,900	1,793,133.00	0.17
154	600660	福耀玻璃	35,000	1,765,400.00	0.17
155	688506	百利天恒	5,991	1,761,533.73	0.17
156	600703	三安光电	82,800	1,757,016.00	0.16
157	002812	恩捷股份	26,100	1,746,351.00	0.16
158	000830	鲁西化工	145,100	1,741,200.00	0.16
159	688072	拓荆科技	2,090	1,738,880.00	0.16
160	300136	信维通信	14,300	1,705,275.00	0.16
161	300014	亿纬锂能	26,100	1,697,283.00	0.16
162	300058	蓝色光标	123,300	1,696,608.00	0.16
163	601857	中国石油	195,100	1,693,468.00	0.16
164	601939	建设银行	175,200	1,687,176.00	0.16
165	000426	兴业银锡	50,600	1,667,776.00	0.16
166	000538	云南白药	35,020	1,658,897.40	0.16
167	000783	长江证券	168,600	1,643,850.00	0.15
168	600673	东阳光	48,800	1,638,704.00	0.15
169	002648	卫星化学	69,400	1,630,206.00	0.15
170	600549	厦门钨业	19,100	1,627,320.00	0.15
171	600879	航天电子	76,100	1,620,169.00	0.15
172	300255	常山药业	68,800	1,611,296.00	0.15
173	002195	岩山科技	244,000	1,595,760.00	0.15
174	600893	航发动力	41,566	1,593,640.44	0.15
175	002064	华峰化学	166,800	1,582,932.00	0.15
176	600583	海油工程	314,400	1,581,432.00	0.15
177	688521	芯原股份	4,185	1,553,220.90	0.15
178	300017	网宿科技	118,100	1,536,481.00	0.14

179	300604	长川科技	4,500	1,536,390.00	0.14
180	002236	大华股份	91,510	1,508,999.90	0.14
181	600109	国金证券	171,100	1,502,258.00	0.14
182	002001	新和成	52,600	1,494,892.00	0.14
183	601238	广汽集团	294,100	1,494,028.00	0.14
184	600019	宝钢股份	273,000	1,482,390.00	0.14
185	600027	华电国际	332,100	1,477,845.00	0.14
186	002138	顺络电子	20,200	1,476,620.00	0.14
187	600601	方正科技	106,200	1,469,808.00	0.14
188	600563	法拉电子	7,700	1,469,160.00	0.14
189	000933	神火股份	68,700	1,456,440.00	0.14
190	002056	横店东磁	47,700	1,453,896.00	0.14
191	600028	中国石化	325,200	1,450,392.00	0.14
192	300207	欣旺达	76,000	1,443,240.00	0.14
193	300782	卓胜微	13,100	1,435,498.00	0.13
194	688777	中控技术	12,123	1,424,452.50	0.13
195	603179	新泉股份	28,500	1,415,025.00	0.13
196	688019	安集科技	4,165	1,413,850.90	0.13
197	600048	保利发展	305,100	1,412,613.00	0.13
198	600547	山东黄金	60,900	1,406,181.00	0.13
199	601567	三星电气	93,800	1,401,372.00	0.13
200	600515	海南机场	508,500	1,393,290.00	0.13
201	600406	国电南瑞	60,300	1,377,855.00	0.13
202	600733	北汽蓝谷	281,639	1,371,581.93	0.13
203	601077	渝农商行	220,100	1,344,811.00	0.13
204	600941	中国移动	15,600	1,343,628.00	0.13
205	600674	川投能源	94,600	1,340,482.00	0.13
206	000960	锡业股份	30,300	1,293,507.00	0.12
207	002429	兆驰股份	124,200	1,290,438.00	0.12
208	600482	中国动力	39,200	1,285,760.00	0.12
209	600050	中国联通	320,500	1,282,000.00	0.12
210	300496	中科创达	20,700	1,279,053.00	0.12
211	688385	复旦微电	17,720	1,263,258.80	0.12
212	600346	恒力石化	71,000	1,257,410.00	0.12
213	000066	中国长城	66,000	1,257,300.00	0.12
214	300347	泰格医药	26,100	1,252,800.00	0.12
215	000063	中兴通讯	34,500	1,248,555.00	0.12
216	601689	拓普集团	22,100	1,246,882.00	0.12
217	000975	山金国际	72,468	1,231,956.00	0.12
218	600039	四川路桥	155,900	1,219,138.00	0.11
219	688313	仕佳光子	6,600	1,218,690.00	0.11
220	002074	国轩高科	44,100	1,213,191.00	0.11
221	601869	长飞光纤	2,200	1,200,980.00	0.11

222	000893	亚钾国际	29,300	1,198,077.00	0.11
223	300223	北京君正	4,800	1,194,720.00	0.11
224	002409	雅克科技	5,300	1,189,850.00	0.11
225	002080	中材科技	13,134	1,182,060.00	0.11
226	601665	齐鲁银行	204,200	1,178,234.00	0.11
227	601916	浙商银行	444,930	1,170,165.90	0.11
228	002603	以岭药业	77,400	1,161,000.00	0.11
229	600196	复星医药	51,500	1,157,205.00	0.11
230	600460	士兰微	21,100	1,153,326.00	0.11
231	600988	赤峰黄金	43,600	1,147,552.00	0.11
232	601838	成都银行	64,500	1,141,650.00	0.11
233	688271	联影医疗	11,200	1,133,776.00	0.11
234	000039	中集集团	137,800	1,117,558.00	0.10
235	300251	光线传媒	100,400	1,113,436.00	0.10
236	300803	指南针	12,145	1,113,332.15	0.10
237	002414	高德红外	83,300	1,104,558.00	0.10
238	002837	英维克	13,860	1,102,701.60	0.10
239	301358	湖南裕能	14,500	1,100,115.00	0.10
240	002625	光启技术	35,700	1,082,424.00	0.10
241	600011	华能国际	142,600	1,082,334.00	0.10
242	002241	歌尔股份	47,900	1,079,187.00	0.10
243	002938	鹏鼎控股	10,200	1,074,876.00	0.10
244	603087	甘李药业	18,900	1,072,764.00	0.10
245	688187	时代电气	15,600	1,071,096.00	0.10
246	601198	东兴证券	78,600	1,068,174.00	0.10
247	688122	西部超导	17,000	1,067,770.00	0.10
248	302132	中航成飞	18,200	1,061,424.00	0.10
249	601699	潞安环能	74,100	1,058,148.00	0.10
250	601099	太平洋	310,800	1,047,396.00	0.10
251	000425	徐工机械	128,333	1,038,213.97	0.10
252	000983	山西焦煤	177,300	1,028,340.00	0.10
253	600177	雅戈尔	135,900	1,023,327.00	0.10
254	002131	利欧股份	215,400	1,023,150.00	0.10
255	000768	中航西飞	49,800	1,019,904.00	0.10
256	601825	沪农商行	135,700	1,016,393.00	0.10
257	603308	应流股份	16,800	1,014,720.00	0.10
258	603392	万泰生物	37,600	1,014,072.00	0.10
259	601229	上海银行	115,900	1,006,012.00	0.09
260	601058	赛轮轮胎	87,200	1,005,416.00	0.09
261	688220	翱捷科技	8,075	1,003,884.00	0.09
262	600015	华夏银行	157,100	1,003,869.00	0.09
263	688180	君实生物	29,400	994,308.00	0.09
264	600111	北方稀土	20,600	989,830.00	0.09

265	601577	长沙银行	112,865	983,054.15	0.09
266	603568	伟明环保	63,840	981,859.20	0.09
267	002202	金风科技	41,000	979,900.00	0.09
268	601360	三六零	112,300	975,887.00	0.09
269	600803	新奥股份	61,600	973,280.00	0.09
270	600711	盛屯矿业	88,700	973,039.00	0.09
271	688249	晶合集成	16,400	968,092.00	0.09
272	601456	国联民生	108,500	959,140.00	0.09
273	300003	乐普医疗	80,900	958,665.00	0.09
274	601128	常熟银行	163,830	953,490.60	0.09
275	601212	白银有色	186,300	946,404.00	0.09
276	600023	浙能电力	179,700	945,222.00	0.09
277	601991	大唐发电	129,500	916,860.00	0.09
278	600010	包钢股份	410,900	916,307.00	0.09
279	601336	新华保险	15,000	894,900.00	0.08
280	603806	福斯特	52,800	886,512.00	0.08
281	601888	中国中免	16,500	886,215.00	0.08
282	600352	浙江龙盛	72,700	880,397.00	0.08
283	002460	赣锋锂业	13,240	865,896.00	0.08
284	601933	永辉超市	300,600	853,704.00	0.08
285	688099	晶晨股份	8,230	846,867.00	0.08
286	002155	湖南黄金	35,400	844,998.00	0.08
287	601211	国泰海通	43,264	787,404.80	0.07
288	601872	招商轮船	44,700	785,379.00	0.07
289	603516	淳中科技	5,700	767,277.00	0.07
290	600096	云天化	25,200	766,080.00	0.07
291	600298	安琪酵母	20,700	749,340.00	0.07
292	000876	新希望	119,500	749,265.00	0.07
293	300896	爱美客	8,560	746,432.00	0.07
294	601555	东吴证券	93,060	737,035.20	0.07
295	300316	晶盛机电	12,100	730,840.00	0.07
296	600026	中远海能	40,400	724,776.00	0.07
297	600029	南方航空	139,300	721,574.00	0.07
298	688778	厦钨新能	13,200	718,080.00	0.07
299	601615	明阳智能	61,900	716,183.00	0.07
300	002493	荣盛石化	66,250	712,187.50	0.07
301	688213	思特威	6,537	699,916.59	0.07
302	300339	润和软件	17,900	689,329.00	0.06
303	601169	北京银行	139,000	681,100.00	0.06
304	601600	中国铝业	81,400	669,108.00	0.06
305	688676	金盘科技	7,739	655,028.96	0.06
306	600737	中粮糖业	52,800	651,024.00	0.06
307	600126	杭钢股份	102,100	625,873.00	0.06

308	600219	南山铝业	153,400	612,066.00	0.06
309	002797	第一创业	90,100	591,957.00	0.06
310	000100	TCL 科技	101,054	588,134.28	0.06
311	688629	华丰科技	3,100	581,281.00	0.05
312	600362	江西铜业	13,300	575,890.00	0.05
313	000157	中联重科	79,700	555,509.00	0.05
314	002261	拓维信息	19,800	554,598.00	0.05
315	688027	国盾量子	1,097	552,898.97	0.05
316	603659	璞泰来	18,500	535,205.00	0.05
317	002271	东方雨虹	44,704	530,636.48	0.05
318	600637	东方明珠	63,400	526,854.00	0.05
319	002459	晶澳科技	63,600	515,160.00	0.05
320	002180	奔图科技	31,400	513,704.00	0.05
321	002850	科达利	2,700	511,110.00	0.05
322	600760	中航沈飞	12,200	501,420.00	0.05
323	603298	杭叉集团	20,640	492,470.40	0.05
324	300037	新宙邦	5,300	492,105.00	0.05
325	300866	安克创新	4,700	491,150.00	0.05
326	600580	卧龙电驱	14,800	489,880.00	0.05
327	600438	通威股份	40,000	484,400.00	0.05
328	688472	阿特斯	44,600	482,572.00	0.05
329	300012	华测检测	34,700	480,942.00	0.05
330	301550	斯菱智驱	5,225	477,721.75	0.04
331	002738	中矿资源	8,040	474,279.60	0.04
332	600233	圆通速递	29,800	469,350.00	0.04
333	002402	和而泰	17,700	457,191.00	0.04
334	002709	天赐材料	8,800	452,584.00	0.04
335	600926	杭州银行	31,300	452,285.00	0.04
336	600016	民生银行	140,400	452,088.00	0.04
337	002281	光迅科技	1,700	436,798.00	0.04
338	688331	荣昌生物	3,344	435,589.44	0.04
339	000630	铜陵有色	67,300	428,028.00	0.04
340	688234	天岳先进	2,434	422,323.34	0.04
341	300699	光威复材	14,500	415,425.00	0.04
342	002444	巨星科技	13,300	413,630.00	0.04
343	002379	宏桥控股	27,800	410,606.00	0.04
344	688361	中科飞测	948	407,640.00	0.04
345	688617	惠泰医疗	2,232	405,241.92	0.04
346	603296	华勤技术	5,440	404,028.80	0.04
347	000657	中钨高新	4,200	402,024.00	0.04
348	601901	方正证券	54,900	395,280.00	0.04
349	601233	桐昆股份	18,100	391,865.00	0.04
350	600282	南钢股份	83,000	380,970.00	0.04

351	300759	康龙化成	13,100	378,983.00	0.04
352	002472	双环传动	9,100	377,741.00	0.04
353	600570	恒生电子	17,801	377,203.19	0.04
354	601611	中国核建	33,500	373,525.00	0.04
355	600141	兴发集团	7,900	371,063.00	0.03
356	000625	长安汽车	51,600	369,972.00	0.03
357	002465	海格通信	28,800	367,776.00	0.03
358	002532	天山铝业	34,100	365,893.00	0.03
359	688120	华海清科	1,129	363,741.22	0.03
360	002555	三七互娱	18,900	356,643.00	0.03
361	600418	江淮汽车	13,663	352,915.29	0.03
362	601878	浙商证券	36,600	347,700.00	0.03
363	603228	景旺电子	4,800	347,568.00	0.03
364	688082	盛美上海	800	345,600.00	0.03
365	600873	梅花生物	46,500	341,775.00	0.03
366	002152	广电运通	35,900	336,742.00	0.03
367	300454	深信服	3,500	336,700.00	0.03
368	603939	益丰药房	18,600	334,428.00	0.03
369	301269	华大九天	2,800	334,376.00	0.03
370	688169	石头科技	3,472	329,735.84	0.03
371	300487	蓝晓科技	5,500	323,675.00	0.03
372	603893	瑞芯微	1,700	320,212.00	0.03
373	300748	金力永磁	10,300	317,755.00	0.03
374	300628	亿联网络	8,800	297,616.00	0.03
375	603606	东方电缆	7,140	296,381.40	0.03
376	688036	传音控股	5,000	294,750.00	0.03
377	002252	上海莱士	66,900	290,346.00	0.03
378	600415	小商品城	28,100	285,496.00	0.03
379	600486	扬农化工	5,600	283,920.00	0.03
380	688235	百济神州	1,069	272,178.09	0.03
381	002050	三花智控	6,200	271,746.00	0.03
382	600970	中材国际	38,081	271,517.53	0.03
383	000400	许继电气	12,500	271,250.00	0.03
384	688195	腾景科技	1,400	269,612.00	0.03
385	600600	青岛啤酒	5,100	266,373.00	0.02
386	601988	中国银行	45,900	262,548.00	0.02
387	300763	锦浪科技	2,900	262,015.00	0.02
388	002078	太阳纸业	20,200	252,298.00	0.02
389	603288	海天味业	7,500	248,700.00	0.02
390	601179	中国西电	16,300	243,196.00	0.02
391	688568	中科星图	5,800	240,526.00	0.02
392	603596	伯特利	9,528	236,675.52	0.02
393	688188	柏楚电子	2,188	233,459.60	0.02

394	688183	生益电子	1,756	232,494.40	0.02
395	300418	昆仑万维	5,500	221,980.00	0.02
396	300450	先导智能	4,900	199,528.00	0.02
397	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.02
398	002653	海思科	2,900	192,386.00	0.02
399	688037	芯源微	422	185,279.10	0.02
400	300456	赛微电子	4,200	178,374.00	0.02
401	688608	恒玄科技	1,020	170,533.80	0.02
402	600905	三峡能源	45,800	169,918.00	0.02
403	600118	中国卫星	2,000	164,100.00	0.02
404	603338	浙江鼎力	3,800	161,500.00	0.02
405	600535	天士力	12,200	161,406.00	0.02
406	600143	金发科技	10,400	160,680.00	0.02
407	300765	石药创新	5,900	160,657.00	0.02
408	300115	长盈精密	5,600	156,464.00	0.01
409	601006	大秦铁路	30,600	141,066.00	0.01
410	600795	国电电力	30,200	141,034.00	0.01
411	688615	合合信息	1,187	134,249.70	0.01
412	601998	中信银行	18,100	125,433.00	0.01
413	002456	欧菲光	13,000	122,980.00	0.01
414	600392	盛和资源	4,000	119,080.00	0.01
415	002085	万丰奥威	10,600	117,554.00	0.01
416	600765	中航重机	9,000	116,280.00	0.01
417	601788	光大证券	7,900	113,997.00	0.01
418	002739	儒意电影	11,787	113,155.20	0.01
419	601766	中国中车	21,640	112,528.00	0.01
420	601108	财通证券	13,000	112,450.00	0.01
421	603160	汇顶科技	1,800	111,078.00	0.01
422	000708	中信特钢	8,800	111,056.00	0.01
423	601628	中国人寿	3,000	106,050.00	0.01
424	600909	华安证券	9,500	105,545.00	0.01
425	688065	凯赛生物	2,200	105,270.00	0.01
426	002129	TCL 中环	8,650	103,973.00	0.01
427	002821	凯莱英	640	103,680.00	0.01
428	002966	苏州银行	14,800	103,008.00	0.01
429	300474	景嘉微	1,700	102,816.00	0.01
430	605117	德业股份	960	101,932.80	0.01
431	601958	金钼股份	3,600	101,196.00	0.01
432	601319	中国人保	14,800	100,048.00	0.01
433	000831	中国稀土	1,800	99,882.00	0.01
434	603501	豪威集团	1,030	97,695.50	0.01
435	600489	中金黄金	5,402	97,506.10	0.01
436	600699	均胜电子	4,500	97,245.00	0.01

437	600690	海尔智家	4,700	95,927.00	0.01
438	603369	今世缘	4,000	94,840.00	0.01
439	002128	电投能源	4,100	94,792.00	0.01
440	002311	海大集团	2,100	93,681.00	0.01
441	600348	华阳股份	12,200	93,330.00	0.01
442	600754	锦江酒店	5,155	92,738.45	0.01
443	600021	上海电力	6,100	91,927.00	0.01
444	300919	中伟新材	2,080	91,000.00	0.01
445	600642	申能股份	10,420	90,966.60	0.01
446	600845	宝信软件	5,400	89,802.00	0.01
447	600863	华能蒙电	19,100	89,770.00	0.01
448	000738	航发控制	4,900	89,621.00	0.01
449	603119	浙江荣泰	1,350	89,559.00	0.01
450	000166	申万宏源	20,100	88,440.00	0.01
451	688223	晶科能源	18,600	88,350.00	0.01
452	603345	安井食品	1,100	88,209.00	0.01
453	600398	海澜之家	16,800	87,864.00	0.01
454	688126	沪硅产业	2,200	87,758.00	0.01
455	688599	天合光能	6,200	87,544.00	0.01
456	688387	信科移动	4,400	87,296.00	0.01
457	000423	东阿阿胶	1,919	87,045.84	0.01
458	600958	东方证券	9,200	86,848.00	0.01
458	601168	西部矿业	3,200	86,848.00	0.01
459	002294	信立泰	2,700	86,103.00	0.01
460	601100	恒立液压	800	86,048.00	0.01
461	600115	中国东航	22,300	84,963.00	0.01
462	601111	中国国航	14,032	84,893.60	0.01
463	600188	兖矿能源	4,700	83,519.00	0.01
464	300498	温氏股份	6,700	82,544.00	0.01
465	601021	春秋航空	1,800	82,044.00	0.01
466	000963	华东医药	2,900	81,548.00	0.01
467	600886	国投电力	6,100	81,191.00	0.01
468	600372	中航机载	7,400	80,290.00	0.01
469	601377	兴业证券	13,225	79,879.00	0.01
470	601658	邮储银行	16,100	79,373.00	0.01
471	600061	国投资本	12,000	78,600.00	0.01
472	600436	片仔癀	700	76,496.00	0.01
473	600895	张江高科	2,000	74,500.00	0.01
474	002244	滨江集团	9,800	74,480.00	0.01
475	002142	宁波银行	2,500	74,225.00	0.01
476	600038	中直股份	2,900	73,341.00	0.01
477	000559	万向钱潮	5,600	72,408.00	0.01
478	301236	软通动力	1,700	72,165.00	0.01

479	603979	金诚信	1,200	70,836.00	0.01
480	002157	正邦科技	25,000	70,250.00	0.01
481	600332	白云山	3,500	70,140.00	0.01
482	000301	东方盛虹	6,100	69,845.00	0.01
483	601066	中信建投	2,400	69,768.00	0.01
484	601186	中国铁建	11,600	69,020.00	0.01
485	601818	光大银行	23,800	68,782.00	0.01
486	600170	上海建工	30,200	67,044.00	0.01
487	603486	科沃斯	1,300	65,975.00	0.01
488	000729	燕京啤酒	6,500	65,845.00	0.01
489	600809	山西汾酒	600	65,622.00	0.01
490	000009	中国宝安	10,400	64,792.00	0.01
491	601162	天风证券	19,200	64,704.00	0.01
492	600585	海螺水泥	3,800	64,410.00	0.01
493	300122	智飞生物	5,500	64,295.00	0.01
494	600588	用友网络	7,000	64,260.00	0.01
495	600901	江苏金租	10,800	62,100.00	0.01
496	601717	中创智领	4,400	61,204.00	0.01
497	002304	洋河股份	1,600	61,040.00	0.01
498	000878	云南铜业	3,800	60,344.00	0.01
499	601868	中国能建	22,600	60,342.00	0.01
500	601881	中国银河	4,800	60,336.00	0.01
501	002517	恺英网络	3,700	60,125.00	0.01
502	600085	同仁堂	2,600	60,086.00	0.01
503	601607	上海医药	3,800	58,520.00	0.01
504	000999	华润三九	2,600	58,474.00	0.01
505	000895	双汇发展	2,600	58,240.00	0.01
506	603816	顾家家居	2,600	58,136.00	0.01
507	600704	物产中大	12,000	56,640.00	0.01
508	600985	淮北矿业	3,900	54,795.00	0.01
509	600256	广汇能源	10,800	53,352.00	0.01
510	000661	长春高新	800	53,280.00	0.00
511	601800	中国交建	9,300	53,103.00	0.00
512	688303	大全能源	2,800	48,804.00	0.00
513	601777	千里科技	5,900	48,144.00	0.00
514	601877	正泰电器	1,900	47,633.00	0.00
515	000568	泸州老窖	600	46,512.00	0.00
516	001979	招商蛇口	7,200	46,296.00	0.00
517	600536	中国软件	1,600	44,992.00	0.00
518	002673	西部证券	6,900	44,781.00	0.00
519	300015	爱尔眼科	5,300	43,778.00	0.00
520	600426	华鲁恒升	1,818	43,486.56	0.00
521	002595	豪迈科技	870	40,542.00	0.00

522	600862	中航高科	1,900	34,257.00	0.00
523	000981	山子高科	11,600	33,408.00	0.00
524	601698	中国卫通	1,000	30,250.00	0.00
525	000728	国元证券	3,900	29,211.00	0.00
526	000513	丽珠集团	924	26,694.36	0.00
527	603260	合盛硅业	500	24,130.00	0.00
528	600521	华海药业	1,500	21,600.00	0.00
529	601231	环旭电子	600	19,440.00	0.00
530	002601	龙佰集团	1,100	18,128.00	0.00
531	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.00
532	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
533	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
534	600009	上海机场	105	2,425.50	0.00
535	000786	北新建材	100	1,809.00	0.00
536	601696	中银证券	100	1,265.00	0.00
537	002007	华兰生物	100	1,219.00	0.00
538	600161	天坛生物	100	1,158.00	0.00
539	002939	长城证券	100	834.00	0.00
540	002920	德赛西威	10	815.00	0.00
541	601727	上海电气	100	700.00	0.00
542	600839	四川长虹	100	698.00	0.00
543	000617	中油资本	100	659.00	0.00
544	601990	南京证券	100	657.00	0.00
545	300144	宋城演艺	100	581.00	0.00
546	600918	中泰证券	100	532.00	0.00
547	601669	中国电建	100	470.00	0.00
548	600390	五矿资本	100	456.00	0.00
549	601216	君正集团	100	446.00	0.00
550	601390	中国中铁	100	417.00	0.00
551	600369	西南证券	100	402.00	0.00
552	000750	国海证券	100	368.00	0.00
553	600008	首创环保	100	272.00	0.00
554	601618	中国中冶	100	244.00	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	688795	摩尔线程	3,562	2,411,972.18	0.23
2	688802	沐曦股份	2,644	2,033,836.31	0.19
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
4	001248	华润新能源	42,388	428,542.68	0.04
5	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
6	688820	盛合晶微	1,366	193,275.34	0.02

7	688809	强一股份	284	176,932.00	0.02
8	688818	电科蓝天	1,768	124,212.03	0.01
9	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
10	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
11	688807	优迅股份	203	81,693.29	0.01
12	688785	恒运昌	155	72,602.57	0.01
13	688712	北芯生命	1,598	57,533.44	0.01
14	688796	百奥赛图	522	57,106.80	0.01
15	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
16	688811	有研复材	1,200	31,470.42	0.00
17	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
18	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
19	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
20	001280	中国铀业	77	5,135.90	0.00
21	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	13,962,971.00	1.34
2	002603	以岭药业	12,488,262.20	1.20
3	688008	澜起科技	12,131,055.84	1.16
4	300476	胜宏科技	12,017,940.00	1.15
5	600150	中国船舶	11,967,461.97	1.15
6	600030	中信证券	11,867,658.75	1.14
7	000988	华工科技	11,026,752.74	1.06
8	000063	中兴通讯	10,868,503.00	1.04
9	001965	招商公路	10,847,939.56	1.04
10	300724	捷佳伟创	10,761,093.06	1.03
11	300001	特锐德	10,446,775.51	1.00
12	300255	常山药业	10,379,343.26	0.99
13	002837	英维克	10,072,294.60	0.96
14	600298	安琪酵母	10,041,275.00	0.96
15	601665	齐鲁银行	9,946,305.00	0.95
16	603993	洛阳钼业	9,832,297.00	0.94
17	300604	长川科技	9,806,931.00	0.94
18	002409	雅克科技	9,787,550.00	0.94
19	002738	中矿资源	9,670,408.60	0.93
20	601138	工业富联	9,613,528.48	0.92

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	300476	胜宏科技	13,939,517.84	1.33
2	300502	新易盛	13,817,020.00	1.32
3	000063	中兴通讯	12,997,784.00	1.24
4	601665	齐鲁银行	12,898,459.00	1.23
5	603259	药明康德	12,577,868.39	1.20
6	600282	南钢股份	12,409,927.00	1.19
7	300750	宁德时代	12,375,285.40	1.18
8	601138	工业富联	12,182,657.96	1.17
9	300604	长川科技	12,089,768.00	1.16
10	002594	比亚迪	12,033,497.00	1.15
11	601155	新城控股	11,814,540.00	1.13
12	002409	雅克科技	11,596,299.00	1.11
13	002603	以岭药业	10,976,379.00	1.05
14	601615	明阳智能	10,784,002.00	1.03
15	002709	天赐材料	10,701,583.30	1.02
16	600183	生益科技	10,516,519.68	1.01
17	300408	三环集团	10,510,546.00	1.01
18	601991	大唐发电	10,033,910.00	0.96
19	601899	紫金矿业	9,952,783.99	0.95
20	002138	顺络电子	9,889,207.00	0.95

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	2,503,831,900.69
卖出股票收入（成交）总额	2,610,490,863.03

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）	18,539.61	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,539.61	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	16,306.25	0.00
2	123255	鼎龙转债	4	2,233.36	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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	139,877.52
2	应收清算款	2,512,010.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	174,664.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,826,552.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	16,306.25	0.00
2	123255	鼎龙转债	2,233.36	0.00

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

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	688795	摩尔线程	2,399,075.36	0.22	新股限售
2	688802	沐曦股份	2,021,411.81	0.19	新股限售
3	301666	大普微	565,262.60	0.05	新股限售
4	001248	华润新能源	428,542.68	0.04	新股限售
5	688808	联讯仪器	258,245.79	0.02	新股限售

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
68,523	15,533.83	10,022,181.67	0.94	1,054,402,664.52	99.06

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	278,407.85	0.03

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	3,094,001,262.00
本报告期期初基金份额总额	1,169,671,994.04
本报告期基金总申购份额	100,055,427.50
减：本报告期基金总赎回份额	205,302,575.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,064,424,846.19

§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：

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生离任本基金管理人的总经理，方一天先生新任本基金管理人的总经理。

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，严涛先生新任本基金管理人的首席市场官。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
银河证券	2	1,646,779,818.79	32.21	322,593.59	32.21	-
中信建投	1	1,155,386,890.55	22.60	226,329.33	22.60	-
东方财富	1	1,057,147,258.18	20.68	207,094.13	20.68	-
平安证券	1	367,416,970.52	7.19	71,975.22	7.19	-
招商证券	1	363,153,844.10	7.10	71,142.13	7.10	-
中金公司	1	133,019,306.71	2.60	26,059.03	2.60	-
国信证券	1	132,002,276.38	2.58	25,857.30	2.58	-
广发证券	1	102,108,737.05	2.00	20,005.77	2.00	-

申万宏源	2	86,044,655.15	1.68	16,858.38	1.68	-
中信证券	1	65,826,874.94	1.29	12,895.00	1.29	-
国泰海通	1	3,624,236.00	0.07	709.59	0.07	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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；

（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）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）证券公司的准入评估

对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）证券公司的审批程序

公司领导对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：浙商证券（031806）。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金 2025 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和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	华安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 30 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(电科蓝天)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 2 月 4 日
5	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和公司网站等规定媒介	2026 年 2 月 28 日
6	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和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 3 日
7	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（2026 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 3 日

8	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金暂停机构投资者大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 10 日
9	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金分红公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 10 日
10	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
11	华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
13	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(三瑞智能)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 1 日
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(大普微)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 9 日
15	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 22 日
16	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 22 日
17	华安基金管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 23 日
18	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
19	华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
20	2025 年度华安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
21	关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 6 月 6 日
22	华安基金管理有限公司关于终止浦	中国证监会基金电子披	2026 年 6 月 25 日

	领基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	露网站和公司网站等规定媒介	

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§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

2026 年 8 月 31 日