

华安中证 A500 交易型开放式指数
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：招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。

基金托管人招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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 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	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52

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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 华安
基金主代码	159359
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 19 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	668,140,424.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 12 月 2 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。
投资策略	1、完全复制策略 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、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证 A500 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huanan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世	深圳市深南大道 7088 号招商银

	纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	徐勇	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	104,841,633.16
本期利润	112,249,300.54
加权平均基金份额本期利润	0.1618
本期加权平均净值利润率	12.28%
本期基金份额净值增长率	12.54%
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	219,317,592.65
期末可供分配基金份额利润	0.3283
期末基金资产净值	940,848,968.00
期末基金份额净值	1.4082
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	40.82%

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。

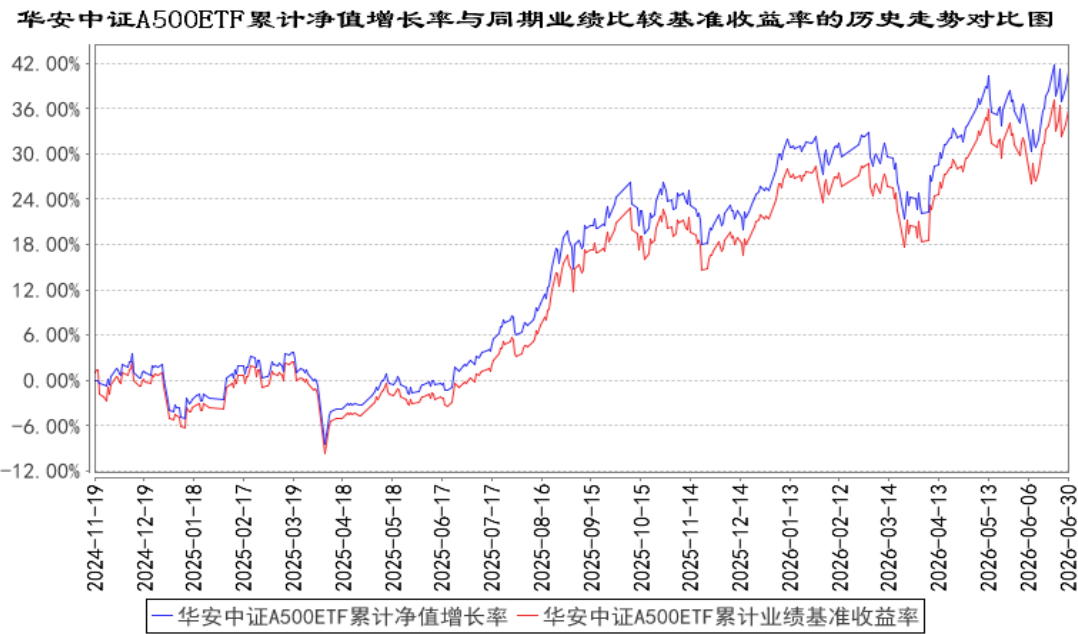
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	14.81%	1.39%	14.26%	1.41%	0.55%	-0.02%
过去六个月	12.54%	1.27%	11.91%	1.29%	0.63%	-0.02%
过去一年	38.19%	1.14%	36.38%	1.14%	1.81%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	40.82%	1.10%	35.86%	1.12%	4.96%	-0.02%

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		
许之彦	首席指数投资官、公司总经理助理、指数与量化投资部高级总监、本基金的基金经理	2024 年 11 月 19 日	-	22 年	理学博士，22 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）、华安中证银行指数型证券投资基金（由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金（由华安创业板 50 指数分级证券投

					资基金于 2021 年 1 月转型而来) 的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月至 2025 年 1 月, 同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起, 同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(由华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)转型而来)的基金经理。2019 年 12 月至 2024 年 6 月, 同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月至 2024 年 6 月, 同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月至 2024 年 6 月, 同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月至 2023 年 11 月, 同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月至 2024 年 6 月, 同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 12 月至 2025 年 6 月, 同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 7 月至 2025 年 3 月, 同时担任华安深证主板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月至 2026 年 3 月, 同时担任华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月起, 同时担任华安中证有色金属矿业主题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(由华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金转型而来)。2024 年 11 月至 2024 年 12 月, 同时担任华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起, 同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(由华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来)的基金经理。2024 年 11 月起, 同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证
--	--	--	--	--	---

					券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起，同时担任华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2026 年 2 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
顾昕	本基金的基金经理	2025 年 6 月 30 日	-	9 年	硕士研究生，9 年基金行业从业经验。2017 年 3 月应届毕业生加入华安基金，历任指数与量化投资部 ETF 研究员、基金经理助理。2023 年 11 月起，担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起，同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 5 月，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月起，同时担任华安沪深 300 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。2024 年 8 月至 2026 年 4 月，同时担任华安中证红利低波动指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起，同时担任华安北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月至 2026 年 4 月，同时担任华安中证云计算与大数据主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2026 年 3 月起，同时担任华安国证石油天然气交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起，同时担任华安中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 5 月起，同时担任华安中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 6 月起，同时担任华安中证畜牧养殖产业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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、

5 日内) 的本年度同向交易价差进行了专项分析, 未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内, 因组合流动性管理或投资策略调整需要, 除指数基金以外的所有投资组合参与的交易公开竞价交易中, 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 年上半年, 国内经济呈现 “一季度较快增长、二季度有所放缓” 的走势, 一季度 GDP 同比增长 5.0%, 二季度增长 4.3%, 总量平稳但边际承压、结构持续优化。报告期内中证 A500 指数震荡走强, 电子、通信、机械设备等行业表现亮眼, 金融、消费、地产链持续走弱。

本基金跟踪中证 A500 指数, 该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本, 涵盖 A 股各行业的核心资产, 对我国整体资本市场具有较强的代表性。

投资管理上, 基金采取完全复制的管理方法跟踪指数, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整, 从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

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 1.4082 元, 本报告期份额净值增长率为 12.54%, 同期业绩比较基准增长率为 11.91%。

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, 市场仍在寻找 “盈利增长” 的确定方向, “去伪存真” 进一步强化。以中证 A500 指数为代表的核心宽基, 汇集了各行业的龙头, 盈利的稳定性与兑现能力更佳。此外, 十年期国债收益率来到 1.75% 以下位置, 权益类资产虽绝对估值已经不低, 但仍有较大风险补偿空间, 在利率偏低的环境里, 核心宽基的配置价值依然突出。

中证 A500 指数汇集中国核心资产, 500 只成份股基本实现中证三级行业基本全覆盖, 聚焦新质生产力。通过类似中证 A500 指数这类核心宽基去捕捉各个行业龙头公司的走势, 不失为广大投资者去分享本轮市场红利的理想方式。

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

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	10,035,244.25	7,502,978.10
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	933,006,337.26	917,342,692.05
其中：股票投资		932,949,336.51	917,342,692.05
基金投资		-	-
债券投资		57,000.75	-
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		2,680.85	115,636.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		943,044,262.36	924,961,306.45

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		-	-
应付管理人报酬		114,833.83	121,162.73
应付托管费		38,277.94	40,387.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,042,182.59	2,438,509.82
负债合计		2,195,294.36	2,600,060.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	668,140,424.00	737,140,424.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	272,708,544.00	185,220,822.34
净资产合计		940,848,968.00	922,361,246.34
负债和净资产总计		943,044,262.36	924,961,306.45

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4082 元，基金份额总额 668,140,424.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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		113,238,682.21	36,897,562.29
1. 利息收入		7,678.37	27,426.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,678.37	27,426.82
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）		105,616,238.56	-23,101,640.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	97,321,073.17	-60,605,493.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	0.75	97,922.36
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	8,295,164.64	37,405,930.89
以摊余成本计		-	-
量的金融资产终		-	-
止确认产生的		-	-
收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益		-	-
（损失以“-”号		-	-
填列）	6.4.7.14	7,407,667.38	58,183,519.80
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	207,097.90	1,788,256.02
减：二、营业总支出		989,381.67	3,645,441.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	678,689.31	2,665,899.88
其中：暂估管理人报		-	-
酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	226,229.80	888,633.31
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		-	0.22
8. 其他费用	6.4.7.17	84,462.56	90,907.97
三、利润总额（亏损		112,249,300.54	33,252,120.91
总额以“-”号填列）		112,249,300.54	33,252,120.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损		112,249,300.54	33,252,120.91
以“-”号填列）		112,249,300.54	33,252,120.91
五、其他综合收益的		-	-
税后净额		-	-
六、综合收益总额		112,249,300.54	33,252,120.91

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	737,140,424.00	-	185,220,822.34	922,361,246.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	737,140,424.00	-	185,220,822.34	922,361,246.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,000,000.00	-	87,487,721.66	18,487,721.66
（一）、综合收益总额	-	-	112,249,300.54	112,249,300.54
（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）	-69,000,000.00	-	-24,761,578.88	-93,761,578.88
其中：1. 基金申购款	345,000,000.00	-	113,185,002.26	458,185,002.26
2. 基金赎回款	-414,000,000.00	-	-137,946,581.14	-551,946,581.14
（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	668,140,424.00	-	272,708,544.00	940,848,968.00

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	5,150,140,424.00	-	15,163,461.14	5,165,303,885.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,150,140,424.00	-	15,163,461.14	5,165,303,885.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 2,691,000,000.00	-	31,508,951.93	- 2,659,491,048.07
（一）、综合收益总额	-	-	33,252,120.91	33,252,120.91
（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）	- 2,691,000,000.00	-	-1,743,168.98	- 2,692,743,168.98
其中：1. 基金申购款	693,000,000.00	-	-16,435,998.42	676,564,001.58
2. 基金赎回款	- 3,384,000,000.00	-	14,692,829.44	- 3,369,307,170.56
（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	2,459,140,424.00	-	46,672,413.07	2,505,812,837.07

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

华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（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”）证监许可[2024]1525 号《关于准予华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2024 年 11 月 19 日生效，首次设立募集规模为 2,000,140,424.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2024]995 号文核准，本基金 2,000,140,424.00 份基金份额于 2024 年 12 月 2 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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、超短期融资券等）、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，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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	9,717.21
等于：本金	9,716.31
加：应计利息	0.90
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	10,025,527.04
等于：本金	10,024,867.07
加：应计利息	659.97

减：坏账准备	-
合计	10,035,244.25

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		783,513,925.48	-	932,949,336.51	149,435,411.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	57,000.00	0.75	57,000.75	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	57,000.00	0.75	57,000.75	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		783,570,925.48	0.75	933,006,337.26	149,435,411.03

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。

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	28,590.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
可退替代款	27,113.30
应付替代款	1,902,176.73
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	2,042,182.59

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	737,140,424.00	737,140,424.00
本期申购	345,000,000.00	345,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-414,000,000.00	-414,000,000.00
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	668,140,424.00	668,140,424.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	131,847,490.40	53,373,331.94	185,220,822.34
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	131,847,490.40	53,373,331.94	185,220,822.34
本期利润	104,841,633.16	7,407,667.38	112,249,300.54
本期基金份额交易产生的变动数	-17,371,530.91	-7,390,047.97	-24,761,578.88
其中：基金申购款	86,535,228.17	26,649,774.09	113,185,002.26
基	-103,906,759.08	-34,039,822.06	-137,946,581.14

金赎回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	219,317,592.65	53,390,951.35	272,708,544.00

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	298.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,380.29
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	7,678.37

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	43,319,695.17
股票投资收益——赎回差价收入	54,001,378.00
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	97,321,073.17

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	394,334,209.77
减：卖出股票成本总额	350,628,506.84
减：交易费用	386,007.76
买卖股票差价收入	43,319,695.17

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
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	551,946,581.14
减：现金支付赎回款总额	292,306,149.14
减：赎回股票成本总额	205,639,054.00
减：交易费用	—
赎回差价收入	54,001,378.00

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.75
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	0.75

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	8,295,164.64
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	8,295,164.64

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	7,407,667.38
股票投资	7,407,667.38
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	7,407,667.38

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	—
替代损益	207,097.90
合计	207,097.90

6.4.7.16 信用减值损失

无。

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	160.00
合计	84,462.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

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

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 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	678,689.31	2,665,899.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,895.05	293,813.53

应支付基金管理人的净管理费	636,794.26	2,372,086.35
---------------	------------	--------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	226,229.80	888,633.31

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
招商银行股份有限公司—华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	440,218,501.00	65.89	579,338,401.00	78.59

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
招商银行	9,717.21	298.08	1,298,008.91	4,881.68

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（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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月 内（含）	配债未上市	100.00	100.00	570	57,000.00	57,000.75	—

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	5,747	1,566,025.89	4,781,504.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其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、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之内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 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	10,035,244.25	-	-	-	10,035,244.25
交易性金融资产	57,000.75	-	-	-932,949,336.51	933,006,337.26
应收清算款	-	-	-	2,680.85	2,680.85
资产总计	10,092,245.00	-	-	-932,952,017.36	943,044,262.36
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	114,833.83	114,833.83
应付托管费	-	-	-	38,277.94	38,277.94
其他负债	-	-	-	2,042,182.59	2,042,182.59
负债总计	-	-	-	2,195,294.36	2,195,294.36
利率敏感度缺口	10,092,245.00	-	-	-930,756,723.00	940,848,968.00
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	7,502,978.10	-	-	-	7,502,978.10
交易性金融资产	-	-	-	-917,342,692.05	917,342,692.05
应收清算款	-	-	-	115,636.30	115,636.30
资产总计	7,502,978.10	-	-	-917,458,328.35	924,961,306.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	121,162.73	121,162.73
应付托管费	-	-	-	40,387.56	40,387.56
其他负债	-	-	-	2,438,509.82	2,438,509.82
负债总计	-	-	-	2,600,060.11	2,600,060.11
利率敏感度缺口	7,502,978.10	-	-	-914,858,268.24	922,361,246.34

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 0.01%(2025 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(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 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	932,949,336.51	99.16	917,342,692.05	99.46
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	57,000.75	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	933,006,337.26	99.17	917,342,692.05	99.46

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%	46,579,030.15	45,912,991.84
	业绩比较基准下降	-46,579,030.15	-45,912,991.84

	5%		
--	----	--	--

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	928,167,832.51	911,645,320.77
第二层次	4,838,504.75	5,697,371.28
第三层次	-	-
合计	933,006,337.26	917,342,692.05

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	932,949,336.51	98.93
	其中：股票	932,949,336.51	98.93
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	57,000.75	0.01
	其中：债券	57,000.75	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	10,035,244.25	1.06
8	其他各项资产	2,680.85	0.00
9	合计	943,044,262.36	100.00

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 3,946.00 元。

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	2,933,361.20	0.31
B	采矿业	38,331,156.28	4.07
C	制造业	659,630,263.54	70.11
D	电力、热力、燃	20,296,865.00	2.16

	气及水生产和供应业		
E	建筑业	11,328,609.00	1.20
F	批发和零售业	7,137,582.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	20,721,187.00	2.20
H	住宿和餐饮业	429,079.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,511,351.84	5.58
J	金融业	90,406,373.60	9.61
K	房地产业	5,206,892.56	0.55
L	租赁和商务服务业	6,741,159.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	11,159,585.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,590,163.20	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	311,580.00	0.03
Q	卫生和社会工作	1,822,885.29	0.19
R	文化、体育和娱乐业	712,601.00	0.08
S	综合	1,674,696.00	0.18
	合计	932,945,390.51	99.16

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

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	31,460	39,954,200.00	4.25
2	300750	宁德时代	74,580	29,310,685.80	3.12
3	300502	新易盛	39,224	23,808,968.00	2.53
4	600519	贵州茅台	17,520	20,769,784.80	2.21
5	603986	兆易创新	18,800	15,322,000.00	1.63
6	688256	寒武纪	9,032	14,411,007.60	1.53

7	601318	中国平安	300,000	14,322,000.00	1.52
8	600036	招商银行	348,500	12,371,750.00	1.31
9	601899	紫金矿业	464,100	11,667,474.00	1.24
10	002371	北方华创	12,115	10,716,444.40	1.14
11	000333	美的集团	137,100	10,355,163.00	1.10
12	002475	立讯精密	143,500	10,102,400.00	1.07
13	688008	澜起科技	32,240	9,991,176.00	1.06
14	688012	中微公司	20,850	9,768,225.00	1.04
15	688041	海光信息	26,028	9,638,168.40	1.02
16	002384	东山精密	36,100	9,470,835.00	1.01
17	600900	长江电力	344,200	9,110,974.00	0.97
18	688981	中芯国际	57,282	9,097,527.24	0.97
19	000725	京东方 A	1,023,800	8,886,584.00	0.94
20	603259	药明康德	69,700	8,678,347.00	0.92
21	600030	中信证券	274,800	7,895,004.00	0.84
22	601166	兴业银行	476,600	7,892,496.00	0.84
23	300059	东方财富	356,420	7,263,839.60	0.77
24	600183	生益科技	41,000	7,109,400.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	125,760	6,544,550.40	0.70
26	300274	阳光电源	40,900	6,503,918.00	0.69
27	601398	工商银行	910,700	6,438,649.00	0.68
28	300408	三环集团	37,795	6,307,985.50	0.67
29	002594	比亚迪	76,600	6,105,020.00	0.65
30	600487	亨通光电	55,500	6,068,370.00	0.64
31	300476	胜宏科技	17,200	5,958,596.00	0.63
32	002463	沪电股份	37,900	5,791,120.00	0.62
33	601211	国泰海通	317,500	5,778,500.00	0.61
34	300394	天孚通信	18,370	5,560,231.60	0.59
35	688498	源杰科技	2,825	5,327,950.00	0.57
36	688525	佰维存储	10,644	5,265,906.12	0.56
37	000988	华工科技	28,400	5,242,924.00	0.56
38	301308	江波龙	7,200	5,067,360.00	0.54
39	600176	中国巨石	67,500	4,919,400.00	0.52
40	601288	农业银行	809,000	4,910,630.00	0.52
41	601328	交通银行	751,600	4,832,788.00	0.51
42	688072	拓荆科技	5,747	4,781,504.00	0.51
43	000651	格力电器	126,000	4,725,000.00	0.50
44	600522	中天科技	76,900	4,666,292.00	0.50
45	603019	中科曙光	41,200	4,417,876.00	0.47
46	688521	芯原股份	11,846	4,396,524.44	0.47
47	603993	洛阳钼业	245,200	4,303,260.00	0.46
48	600150	中国船舶	126,982	4,290,721.78	0.46
49	600887	伊利股份	178,100	4,267,276.00	0.45

50	300604	长川科技	12,400	4,233,608.00	0.45
51	600584	长电科技	40,300	4,173,065.00	0.44
52	000338	潍柴动力	151,300	4,122,925.00	0.44
53	000858	五粮液	54,794	4,054,756.00	0.43
54	688347	华虹宏力	11,500	3,867,450.00	0.41
55	601816	京沪高铁	824,400	3,734,532.00	0.40
56	600309	万华化学	53,000	3,625,730.00	0.39
57	688120	华海清科	11,188	3,604,549.84	0.38
58	002916	深南电路	7,750	3,548,725.00	0.38
59	300124	汇川技术	53,500	3,548,655.00	0.38
60	002415	海康威视	103,100	3,526,020.00	0.37
61	002281	光迅科技	13,640	3,504,661.60	0.37
62	002008	大族激光	23,200	3,482,552.00	0.37
63	600111	北方稀土	71,200	3,421,160.00	0.36
64	000100	TCL 科技	584,700	3,402,954.00	0.36
65	000063	中兴通讯	90,500	3,275,195.00	0.35
66	300136	信维通信	27,300	3,255,525.00	0.35
67	300857	协创数据	9,500	3,229,050.00	0.34
68	600000	浦发银行	374,000	3,220,140.00	0.34
69	600089	特变电工	142,100	3,197,250.00	0.34
70	601857	中国石油	363,800	3,157,784.00	0.34
71	002028	思源电气	17,500	3,027,500.00	0.32
72	601088	中国神华	77,200	3,013,888.00	0.32
73	300433	蓝思科技	55,955	3,002,545.30	0.32
74	600031	三一重工	166,300	2,873,664.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	42,700	2,776,781.00	0.30
76	002050	三花智控	62,800	2,752,524.00	0.29
77	601601	中国太保	96,300	2,746,476.00	0.29
78	000001	平安银行	272,600	2,739,630.00	0.29
79	300475	香农芯创	9,100	2,730,000.00	0.29
80	300223	北京君正	10,887	2,709,774.30	0.29
81	000792	盐湖股份	89,200	2,692,948.00	0.29
82	600549	厦门钨业	31,500	2,683,800.00	0.29
83	002714	牧原股份	76,680	2,683,033.20	0.29
84	002353	杰瑞股份	17,200	2,623,000.00	0.28
85	002156	通富微电	34,100	2,587,167.00	0.27
86	600406	国电南瑞	112,800	2,577,480.00	0.27
87	601668	中国建筑	580,300	2,518,502.00	0.27
88	000657	中钨高新	25,700	2,460,004.00	0.26
89	002436	兴森科技	47,800	2,435,410.00	0.26
90	002602	世纪华通	166,000	2,340,600.00	0.25
91	601919	中远海控	176,300	2,337,738.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	17,000	2,309,110.00	0.25

93	601988	中国银行	402,100	2,300,012.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	45,000	2,269,800.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	21,400	2,267,758.00	0.24
96	601728	中国电信	435,800	2,261,802.00	0.24
97	603501	豪威集团	23,800	2,257,430.00	0.24
98	601012	隆基绿能	170,000	2,230,400.00	0.24
99	601225	陕西煤业	108,800	2,214,080.00	0.24
100	002230	科大讯飞	54,000	2,205,360.00	0.23
101	600941	中国移动	25,400	2,187,702.00	0.23
102	600690	海尔智家	105,800	2,159,378.00	0.23
103	002352	顺丰控股	67,400	2,106,924.00	0.22
104	002460	赣锋锂业	32,000	2,092,800.00	0.22
105	601985	中国核电	231,300	2,088,639.00	0.22
106	688777	中控技术	17,693	2,078,927.50	0.22
107	002709	天赐材料	40,000	2,057,200.00	0.22
108	603799	华友钴业	42,600	2,055,876.00	0.22
109	300033	同花顺	8,520	2,053,320.00	0.22
110	300757	罗博特科	3,300	2,042,700.00	0.22
111	002938	鹏鼎控股	19,300	2,033,834.00	0.22
112	000977	浪潮信息	29,000	2,030,000.00	0.22
113	600160	巨化股份	37,700	1,998,477.00	0.21
114	300442	润泽科技	23,000	1,910,610.00	0.20
115	002851	麦格米特	11,400	1,905,852.00	0.20
116	000425	徐工机械	230,400	1,863,936.00	0.20
117	000938	紫光股份	64,228	1,853,620.08	0.20
118	688126	沪硅产业	46,457	1,853,169.73	0.20
119	002202	金风科技	77,200	1,845,080.00	0.20
120	601600	中国铝业	222,600	1,829,772.00	0.19
121	600938	中国海油	67,200	1,824,480.00	0.19
122	600028	中国石化	408,900	1,823,694.00	0.19
123	600460	士兰微	33,000	1,803,780.00	0.19
124	300346	南大光电	19,380	1,795,557.00	0.19
125	002466	天齐锂业	29,200	1,790,544.00	0.19
126	300567	精测电子	5,600	1,778,560.00	0.19
127	601766	中国中车	341,700	1,776,840.00	0.19
128	002600	领益智造	101,900	1,766,946.00	0.19
129	600050	中国联通	438,900	1,755,600.00	0.19
130	300661	圣邦股份	12,130	1,740,412.40	0.18
131	002837	英维克	21,620	1,720,087.20	0.18
132	002080	中材科技	18,800	1,692,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	19,000	1,686,250.00	0.18
134	688002	睿创微纳	10,818	1,673,436.42	0.18
135	002185	华天科技	74,900	1,671,019.00	0.18

136	002138	顺络电子	22,700	1,659,370.00	0.18
137	601628	中国人寿	46,800	1,654,380.00	0.18
138	002179	中航光电	35,800	1,653,960.00	0.18
139	002407	多氟多	32,703	1,642,671.69	0.17
140	000568	泸州老窖	20,685	1,603,501.20	0.17
141	601100	恒立液压	14,900	1,602,644.00	0.17
142	601872	招商轮船	90,800	1,595,356.00	0.17
143	600879	航天电子	74,300	1,581,847.00	0.17
144	300395	菲利华	11,800	1,578,014.00	0.17
145	002241	歌尔股份	69,900	1,574,847.00	0.17
146	603288	海天味业	46,944	1,556,663.04	0.17
147	605117	德业股份	14,660	1,556,598.80	0.17
148	601006	大秦铁路	334,700	1,542,967.00	0.16
149	601658	邮储银行	309,600	1,526,328.00	0.16
150	000408	藏格矿业	22,000	1,525,040.00	0.16
151	300390	天华新能	16,200	1,514,862.00	0.16
152	688017	绿的谐波	3,600	1,504,296.00	0.16
153	688469	芯联集成	141,500	1,501,315.00	0.16
154	600905	三峡能源	401,400	1,489,194.00	0.16
155	601888	中国中免	27,600	1,482,396.00	0.16
156	600489	中金黄金	81,500	1,471,075.00	0.16
157	002625	光启技术	48,500	1,470,520.00	0.16
158	688396	华润微	15,011	1,464,323.05	0.16
159	000630	铜陵有色	226,000	1,437,360.00	0.15
160	600893	航发动力	37,200	1,426,248.00	0.15
161	688271	联影医疗	14,007	1,417,928.61	0.15
162	600673	东阳光	42,200	1,417,076.00	0.15
163	600010	宝钢股份	634,800	1,415,604.00	0.15
164	688111	金山办公	6,636	1,413,799.80	0.15
165	601127	赛力斯	23,000	1,408,750.00	0.15
166	300058	蓝色光标	100,500	1,382,880.00	0.15
167	601689	拓普集团	24,500	1,382,290.00	0.15
168	300037	新宙邦	14,800	1,374,180.00	0.15
169	002027	分众传媒	283,800	1,373,592.00	0.15
170	002273	水晶光电	38,700	1,373,076.00	0.15
171	300751	迈为股份	4,800	1,355,808.00	0.14
172	600118	中国卫星	16,500	1,353,825.00	0.14
173	600019	宝钢股份	244,700	1,328,721.00	0.14
174	600760	中航沈飞	32,100	1,319,310.00	0.14
175	000426	兴业银锡	39,768	1,310,753.28	0.14
176	000807	云铝股份	58,700	1,299,618.00	0.14
177	601168	西部矿业	46,900	1,272,866.00	0.14
178	600362	江西铜业	29,300	1,268,690.00	0.13

179	300450	先导智能	31,004	1,262,482.88	0.13
180	600104	上汽集团	129,000	1,259,040.00	0.13
181	600989	宝丰能源	61,700	1,254,361.00	0.13
182	688099	晶晨股份	12,123	1,247,456.70	0.13
183	601727	上海电气	177,100	1,239,700.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	46,800	1,231,776.00	0.13
185	600875	东方电气	42,800	1,231,356.00	0.13
186	002001	新和成	43,140	1,226,038.80	0.13
187	002422	科伦药业	31,400	1,209,528.00	0.13
188	600885	宏发股份	34,900	1,203,701.00	0.13
189	605589	圣泉集团	18,900	1,201,473.00	0.13
190	601390	中国中铁	287,500	1,198,875.00	0.13
191	600667	太极实业	41,000	1,196,380.00	0.13
192	002738	中矿资源	20,200	1,191,598.00	0.13
193	000960	锡业股份	27,900	1,191,051.00	0.13
194	000538	云南白药	25,100	1,188,987.00	0.13
195	002126	银轮股份	23,800	1,185,240.00	0.13
196	600547	山东黄金	50,900	1,175,281.00	0.12
197	600795	国电电力	250,600	1,170,302.00	0.12
198	600392	盛和资源	39,200	1,166,984.00	0.12
199	000831	中国稀土	20,800	1,154,192.00	0.12
200	600418	江淮汽车	44,300	1,144,269.00	0.12
201	600585	海螺水泥	67,400	1,142,430.00	0.12
202	601669	中国电建	241,800	1,136,460.00	0.12
203	002648	卫星化学	47,400	1,113,426.00	0.12
204	600141	兴发集团	23,700	1,113,189.00	0.12
205	002812	恩捷股份	16,600	1,110,706.00	0.12
206	300316	晶盛机电	18,300	1,105,320.00	0.12
207	002129	TCL 中环	90,900	1,092,618.00	0.12
208	600096	云天化	35,600	1,082,240.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	130,900	1,081,234.00	0.11
210	301358	湖南裕能	14,200	1,077,354.00	0.11
211	601179	中国西电	72,100	1,075,732.00	0.11
212	300782	卓胜微	9,700	1,062,926.00	0.11
213	600482	中国动力	32,100	1,052,880.00	0.11
214	601868	中国能建	392,700	1,048,509.00	0.11
215	600346	恒力石化	59,100	1,046,661.00	0.11
216	002195	岩山科技	159,300	1,041,822.00	0.11
217	000066	中国长城	54,600	1,040,130.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	84,800	1,026,928.00	0.11
219	002558	巨人网络	37,200	1,025,232.00	0.11
220	600580	卧龙电驱	30,900	1,022,790.00	0.11
221	300418	昆仑万维	25,300	1,021,108.00	0.11

222	000625	长安汽车	139,500	1,000,215.00	0.11
223	600066	宇通客车	37,100	994,651.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	41,500	992,680.00	0.11
225	600157	永泰能源	612,400	985,964.00	0.10
226	688036	传音控股	16,576	977,155.20	0.10
227	002532	天山铝业	91,000	976,430.00	0.10
228	600895	张江高科	26,200	975,950.00	0.10
229	600221	海航控股	721,600	974,160.00	0.10
230	000157	中联重科	139,700	973,709.00	0.10
231	605499	东鹏饮料	7,780	960,285.40	0.10
232	600711	盛屯矿业	86,700	951,099.00	0.10
233	600436	片仔癀	8,700	950,736.00	0.10
234	002340	格林美	143,100	945,891.00	0.10
235	002821	凯莱英	5,800	939,600.00	0.10
236	000933	神火股份	44,200	937,040.00	0.10
237	600011	华能国际	123,300	935,847.00	0.10
238	300803	指南针	10,200	935,034.00	0.10
239	600048	保利发展	201,700	933,871.00	0.10
240	600143	金发科技	59,900	925,455.00	0.10
241	600438	通威股份	76,100	921,571.00	0.10
242	300017	网宿科技	70,200	913,302.00	0.10
243	600115	中国东航	238,900	910,209.00	0.10
244	002236	大华股份	54,800	903,652.00	0.10
245	002493	荣盛石化	84,000	903,000.00	0.10
246	002131	利欧股份	189,900	902,025.00	0.10
247	600570	恒生电子	42,500	900,575.00	0.10
248	600886	国投电力	67,500	898,425.00	0.10
249	688047	龙芯中科	5,800	897,086.00	0.10
250	002456	欧菲光	94,400	893,024.00	0.09
251	600352	浙江龙盛	73,300	887,663.00	0.09
252	603659	璞泰来	30,200	873,686.00	0.09
253	688213	思特威	8,100	867,267.00	0.09
254	601233	桐昆股份	40,000	866,000.00	0.09
255	003816	中国广核	220,900	863,719.00	0.09
256	300339	润和软件	22,400	862,624.00	0.09
257	601360	三六零	98,500	855,965.00	0.09
258	601058	赛轮轮胎	74,100	854,373.00	0.09
259	000301	东方盛虹	74,500	853,025.00	0.09
260	688578	艾力斯	7,800	851,760.00	0.09
261	688235	百济神州	3,329	847,596.69	0.09
262	300759	康龙化成	29,200	844,756.00	0.09
263	002074	国轩高科	30,600	841,806.00	0.09
264	600026	中远海能	46,900	841,386.00	0.09

265	688122	西部超导	13,098	822,685.38	0.09
266	002555	三七互娱	43,500	820,845.00	0.09
267	300438	鹏辉能源	9,800	811,930.00	0.09
268	600009	上海机场	34,700	801,570.00	0.09
269	600196	复星医药	35,500	797,685.00	0.08
270	000768	中航西飞	38,900	796,672.00	0.08
271	000975	山金国际	46,800	795,600.00	0.08
272	603129	春风动力	3,100	792,980.00	0.08
273	601111	中国国航	130,800	791,340.00	0.08
274	600415	小商品城	77,600	788,416.00	0.08
275	300207	欣旺达	41,400	786,186.00	0.08
276	002472	双环传动	18,900	784,539.00	0.08
277	600029	南方航空	151,300	783,734.00	0.08
278	300001	特锐德	20,700	783,081.00	0.08
279	002517	恺英网络	48,100	781,625.00	0.08
280	600674	川投能源	55,100	780,767.00	0.08
281	002601	龙佰集团	46,900	772,912.00	0.08
282	600219	南山铝业	193,300	771,267.00	0.08
283	300458	全志科技	19,500	769,470.00	0.08
284	601186	中国铁建	129,100	768,145.00	0.08
285	601877	正泰电器	30,400	762,128.00	0.08
286	002128	电投能源	32,900	760,648.00	0.08
287	600233	圆通速递	48,200	759,150.00	0.08
288	601117	中国化学	102,700	754,845.00	0.08
289	002595	豪迈科技	16,100	750,260.00	0.08
290	300115	长盈精密	26,800	748,792.00	0.08
291	600372	中航机载	68,000	737,800.00	0.08
292	002155	湖南黄金	30,900	737,583.00	0.08
293	301236	软通动力	17,308	734,724.60	0.08
294	600839	四川长虹	103,500	722,430.00	0.08
295	300454	深信服	7,500	721,500.00	0.08
296	002465	海格通信	55,500	708,735.00	0.08
297	300568	星源材质	37,600	703,872.00	0.07
298	002920	德赛西威	8,600	700,900.00	0.07
299	603650	彤程新材	7,100	695,658.00	0.07
300	000963	华东医药	24,700	694,564.00	0.07
301	600741	华域汽车	44,300	687,536.00	0.07
302	300347	泰格医药	14,300	686,400.00	0.07
303	000547	航天发展	35,700	683,655.00	0.07
304	688506	百利天恒	2,299	675,974.97	0.07
305	300024	机器人	34,900	674,617.00	0.07
306	688676	金盘科技	7,898	668,486.72	0.07
307	002130	沃尔核材	35,100	665,496.00	0.07

308	688331	荣昌生物	5,100	664,326.00	0.07
309	002497	雅化集团	32,500	662,025.00	0.07
310	300012	华测检测	47,300	655,578.00	0.07
311	001979	招商蛇口	101,000	649,430.00	0.07
312	000878	云南铜业	40,800	647,904.00	0.07
313	300866	安克创新	6,200	647,900.00	0.07
314	002432	九安医疗	9,101	643,258.68	0.07
315	300474	景嘉微	10,600	641,088.00	0.07
316	002271	东方雨虹	53,900	639,793.00	0.07
317	002414	高德红外	48,100	637,806.00	0.07
318	300083	创世纪	46,800	637,416.00	0.07
319	300496	中科创达	10,300	636,437.00	0.07
320	000034	神州数码	22,820	633,255.00	0.07
321	002444	巨星科技	20,100	625,110.00	0.07
322	300763	锦浪科技	6,900	623,415.00	0.07
323	603979	金诚信	10,500	619,815.00	0.07
324	688266	泽璟制药	5,300	618,298.00	0.07
325	601021	春秋航空	13,500	615,330.00	0.07
326	601319	中国人保	89,700	606,372.00	0.06
327	000661	长春高新	9,100	606,060.00	0.06
328	002025	航天电器	7,900	602,138.00	0.06
329	000733	振华科技	10,600	600,384.00	0.06
330	600699	均胜电子	27,600	596,436.00	0.06
331	002756	永兴材料	10,500	594,720.00	0.06
332	601615	明阳智能	51,000	590,070.00	0.06
333	002078	太阳纸业	47,200	589,528.00	0.06
334	300748	金力永磁	19,100	589,235.00	0.06
335	300142	沃森生物	44,900	583,251.00	0.06
336	300432	富临精工	28,900	580,601.00	0.06
337	300919	中伟新材	13,200	577,500.00	0.06
338	300073	当升科技	12,000	576,480.00	0.06
339	601677	明泰铝业	34,700	576,020.00	0.06
340	600039	四川路桥	73,400	573,988.00	0.06
341	601800	中国交建	99,600	568,716.00	0.06
342	603606	东方电缆	13,680	567,856.80	0.06
343	603087	甘李药业	10,000	567,600.00	0.06
344	688169	石头科技	5,967	566,685.99	0.06
345	688608	恒玄科技	3,380	565,102.20	0.06
346	000002	万科 A	190,900	565,064.00	0.06
347	300724	捷佳伟创	8,000	564,800.00	0.06
348	000423	东阿阿胶	12,400	562,464.00	0.06
349	002252	上海莱士	129,500	562,030.00	0.06
350	600226	亨通股份	58,200	558,138.00	0.06

351	688599	天合光能	39,346	555,565.52	0.06
352	688223	晶科能源	115,590	549,052.50	0.06
353	688390	固德威	4,950	537,124.50	0.06
354	002064	华峰化学	55,500	526,695.00	0.06
355	600588	用友网络	57,300	526,014.00	0.06
356	601633	长城汽车	34,800	525,132.00	0.06
357	688180	君实生物	15,500	524,210.00	0.06
358	000786	北新建材	28,900	522,801.00	0.06
359	001965	招商公路	57,000	522,120.00	0.06
360	688188	柏楚电子	4,876	520,269.20	0.06
361	002831	裕同科技	14,300	508,508.00	0.05
362	302132	中航成飞	8,500	495,720.00	0.05
363	603806	福斯特	29,500	495,305.00	0.05
364	000519	中兵红箭	23,500	495,145.00	0.05
365	300677	英科医疗	12,600	493,542.00	0.05
366	002294	信立泰	15,400	491,106.00	0.05
367	601618	中国中冶	200,600	489,464.00	0.05
368	600177	雅戈尔	64,900	488,697.00	0.05
369	600516	方大炭素	78,900	486,813.00	0.05
370	601607	上海医药	31,600	486,640.00	0.05
371	300972	万辰集团	2,800	485,548.00	0.05
372	002176	江特电机	48,000	480,480.00	0.05
373	000623	吉林敖东	26,900	476,937.00	0.05
374	300558	贝达药业	7,300	475,011.00	0.05
375	688065	凯赛生物	9,900	473,715.00	0.05
376	000617	中油资本	71,100	468,549.00	0.05
377	300699	光威复材	16,200	464,130.00	0.05
378	603260	合盛硅业	9,600	463,296.00	0.05
379	002085	万丰奥威	41,700	462,453.00	0.05
380	002318	久立特材	19,100	456,490.00	0.05
381	300251	光线传媒	41,100	455,799.00	0.05
382	600499	科达制造	32,600	449,880.00	0.05
383	002459	晶澳科技	55,516	449,679.60	0.05
384	300832	新产业	10,700	449,400.00	0.05
385	002065	东华软件	62,600	446,964.00	0.05
386	300342	天银机电	9,500	446,500.00	0.05
387	002266	浙富控股	87,900	444,774.00	0.05
388	688617	惠泰医疗	2,444	443,732.64	0.05
389	600085	同仁堂	19,200	443,712.00	0.05
390	002044	美年健康	87,903	442,152.09	0.05
391	688472	阿特斯	40,800	441,456.00	0.05
392	688005	容百科技	14,389	440,303.40	0.05
393	600515	海南机场	160,600	440,044.00	0.05

394	301550	斯菱智驱	4,800	438,864.00	0.05
395	300409	道氏技术	22,000	438,460.00	0.05
396	603596	伯特利	17,492	434,501.28	0.05
397	000400	许继电气	20,000	434,000.00	0.05
398	605090	九丰能源	11,600	431,172.00	0.05
399	002405	四维图新	66,600	430,902.00	0.05
400	002223	鱼跃医疗	16,700	428,522.00	0.05
401	300003	乐普医疗	36,000	426,600.00	0.05
402	600521	华海药业	29,600	426,240.00	0.05
403	600862	中航高科	23,500	423,705.00	0.05
404	000415	渤海租赁	104,000	423,280.00	0.04
405	601216	君正集团	94,900	423,254.00	0.04
406	000683	博源化工	73,200	421,632.00	0.04
407	000039	中集集团	51,950	421,314.50	0.04
408	000032	深桑达 A	16,880	421,156.00	0.04
409	000999	华润三九	18,640	419,213.60	0.04
410	600803	新奥股份	26,200	413,960.00	0.04
411	603605	珀莱雅	6,900	413,448.00	0.04
412	600704	物产中大	87,100	411,112.00	0.04
413	603766	隆鑫通用	34,300	409,199.00	0.04
414	600312	平高电气	22,900	404,414.00	0.04
415	600018	上港集团	84,900	400,728.00	0.04
416	000887	中鼎股份	22,200	397,158.00	0.04
417	600765	中航重机	30,700	396,644.00	0.04
418	600332	白云山	19,700	394,788.00	0.04
419	000967	盈峰环境	37,400	393,822.00	0.04
420	300122	智飞生物	33,350	389,861.50	0.04
421	000830	鲁西化工	32,400	388,800.00	0.04
422	600153	建发股份	49,000	388,570.00	0.04
423	600166	福田汽车	133,400	388,194.00	0.04
424	688116	天奈科技	10,100	385,820.00	0.04
425	300896	爱美客	4,400	383,680.00	0.04
426	002410	广联达	46,400	378,624.00	0.04
427	002007	华兰生物	31,000	377,890.00	0.04
428	601799	星宇股份	4,100	371,542.00	0.04
429	600323	瀚蓝环境	13,500	370,710.00	0.04
430	688114	华大智造	7,200	367,776.00	0.04
431	603568	伟明环保	23,040	354,355.20	0.04
432	600398	海澜之家	67,500	353,025.00	0.04
433	002603	以岭药业	23,500	352,500.00	0.04
434	600486	扬农化工	6,950	352,365.00	0.04
435	688009	中国通号	72,770	346,385.20	0.04
436	601000	唐山港	83,100	344,865.00	0.04

437	601018	宁波港	109,200	343,980.00	0.04
438	688166	博瑞医药	9,799	343,062.99	0.04
439	002389	航天彩虹	19,300	342,961.00	0.04
440	600529	山东药玻	18,500	341,325.00	0.04
441	603486	科沃斯	6,700	340,025.00	0.04
442	600208	衢州发展	119,700	338,751.00	0.04
443	000738	航发控制	18,400	336,536.00	0.04
444	600008	首创环保	123,400	335,648.00	0.04
445	000932	华菱钢铁	96,000	333,120.00	0.04
446	600998	九州通	70,900	332,521.00	0.04
447	600170	上海建工	149,600	332,112.00	0.04
448	600316	洪都航空	11,800	329,692.00	0.04
449	600161	天坛生物	27,900	323,082.00	0.03
450	600820	隧道股份	61,700	321,457.00	0.03
451	300118	东方日升	25,700	319,965.00	0.03
452	603885	吉祥航空	30,900	317,961.00	0.03
453	601238	广汽集团	62,100	315,468.00	0.03
454	002607	中公教育	173,100	311,580.00	0.03
455	603816	顾家家居	13,600	304,096.00	0.03
456	603939	益丰药房	16,900	303,862.00	0.03
457	688303	大全能源	17,259	300,824.37	0.03
458	600763	通策医疗	8,840	299,499.20	0.03
459	300573	兴齐眼药	7,262	295,999.12	0.03
460	300676	华大基因	8,400	294,504.00	0.03
461	601567	三星电气	19,700	294,318.00	0.03
462	601880	辽港股份	207,000	285,660.00	0.03
463	600038	中直股份	11,200	283,248.00	0.03
464	603392	万泰生物	10,300	277,791.00	0.03
465	600535	天士力	20,900	276,507.00	0.03
466	300049	福瑞医科	7,000	272,160.00	0.03
467	600816	建元信托	110,600	269,864.00	0.03
468	600511	国药股份	10,300	268,212.00	0.03
469	688063	派能科技	5,003	266,509.81	0.03
470	002244	滨江集团	34,700	263,720.00	0.03
471	601155	新城控股	25,500	261,630.00	0.03
472	300100	双林股份	9,300	258,354.00	0.03
473	002120	韵达股份	40,600	258,216.00	0.03
474	000833	粤桂股份	11,000	257,620.00	0.03
475	300144	宋城演艺	44,200	256,802.00	0.03
476	000998	隆平高科	33,200	250,328.00	0.03
477	601866	中远海发	109,500	241,995.00	0.03
478	600064	南京高科	33,700	240,281.00	0.03
479	002544	普天科技	13,100	238,682.00	0.03

480	600635	大众公用	54,700	234,116.00	0.02
481	000035	中国天楹	47,000	227,010.00	0.02
482	600754	锦江酒店	12,500	224,875.00	0.02
483	300457	赢合科技	10,600	223,448.00	0.02
484	600655	豫园股份	53,800	221,118.00	0.02
485	300601	康泰生物	18,700	212,058.00	0.02
486	600004	白云机场	29,100	211,266.00	0.02
487	600663	陆家嘴	33,500	210,380.00	0.02
488	603899	晨光股份	10,000	206,300.00	0.02
489	600258	首旅酒店	18,700	204,204.00	0.02
490	600859	王府井	22,100	202,878.00	0.02
491	002091	江苏国泰	27,600	199,548.00	0.02
492	300070	碧水源	60,600	193,314.00	0.02
493	000069	华侨城 A	112,954	185,244.56	0.02
494	600864	哈投股份	34,800	180,612.00	0.02
495	301078	孩子王	24,900	168,324.00	0.02
496	002292	奥飞娱乐	25,000	164,000.00	0.02
497	603833	欧派家居	5,300	159,583.00	0.02
498	600325	华发股份	61,700	142,527.00	0.02
499	002891	中宠股份	5,000	133,600.00	0.01
500	002572	索菲亚	16,100	117,530.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600519	贵州茅台	18,041,028.00	1.96
2	688012	中微公司	13,959,511.33	1.51
3	601318	中国平安	9,616,549.00	1.04
4	601899	紫金矿业	8,726,679.00	0.95
5	688041	海光信息	8,131,005.95	0.88
6	688521	芯原股份	7,904,582.55	0.86
7	600036	招商银行	7,185,719.00	0.78
8	688008	澜起科技	5,004,612.64	0.54
9	600900	长江电力	4,990,497.00	0.54
10	601166	兴业银行	4,693,440.00	0.51
11	688981	中芯国际	4,576,441.58	0.50
12	603986	兆易创新	4,363,769.00	0.47
13	688498	源杰科技	4,252,262.71	0.46
14	600030	中信证券	4,058,470.00	0.44

15	301308	江波龙	3,956,459.00	0.43
16	600276	恒瑞医药	3,899,258.00	0.42
17	688525	佰维存储	3,830,196.72	0.42
18	603259	药明康德	3,668,200.00	0.40
19	601398	工商银行	3,582,750.00	0.39
20	600183	生益科技	3,170,357.00	0.34

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	600519	贵州茅台	21,125,289.15	2.29
2	688012	中微公司	14,095,418.80	1.53
3	601318	中国平安	12,030,025.00	1.30
4	601899	紫金矿业	10,778,963.88	1.17
5	688041	海光信息	9,139,743.04	0.99
6	600036	招商银行	8,961,355.00	0.97
7	688521	芯原股份	7,897,160.92	0.86
8	600900	长江电力	6,250,243.00	0.68
9	688008	澜起科技	6,007,665.57	0.65
10	601166	兴业银行	5,892,591.00	0.64
11	603986	兆易创新	5,671,663.00	0.61
12	688981	中芯国际	5,478,630.21	0.59
13	600030	中信证券	5,060,472.00	0.55
14	600276	恒瑞医药	4,769,041.00	0.52
15	603259	药明康德	4,621,990.00	0.50
16	601398	工商银行	4,486,813.00	0.49
17	601088	中国神华	4,056,055.00	0.44
18	300308	中际旭创	3,930,530.00	0.43
19	601211	国泰海通	3,830,072.76	0.42
20	601288	农业银行	3,710,534.00	0.40

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	360,951,055.97
卖出股票收入（成交）总额	394,334,209.77

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）	57,000.75	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,000.75	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	111025	圣泉转债	570	57,000.75	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	-
2	应收清算款	2,680.85
3	应收股利	-
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	2,680.85

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

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
2,043	327,038.88	605,778,528.00	90.67	62,361,896.00	9.33

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
招商银行股份有限公司— 华安中证 A500 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	440,218,501.00	65.89

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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(2024 年 11 月 19 日) 基金份额总额	2,000,140,424.00
本报告期期初基金份额总额	737,140,424.00
本报告期基金总申购份额	345,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	414,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	668,140,424.00

§ 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：

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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 (%)	
国信证券	5	755,285,265.74	100.00	140,406.05	100.00	-

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：无。

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 (%)
国信证券	57,000.00	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司旗下部分基金 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	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 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部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	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 5 日
5	华安中证 A500 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和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 6 日
6	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
7	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
8	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 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
9	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
10	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 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
11	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
12	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
13	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
14	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	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 5 月 7 日
15	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华源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和公司网站等规定媒介	2026 年 6 月 2 日
16	关于华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商	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 10 日

	的公告	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

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(%)
联接基金	1	20260101~20260630	579,338,401.00	784,300.00	139,904,200.00	440,218,501.00	65.89
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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中证 A500 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 A500 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

2026 年 8 月 31 日