

华安沪深 300 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	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	10
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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	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	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46

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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安沪深 300ETF
场内简称	HS300(扩位简称: 沪深 300ETF 华安)
基金主代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 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	1,398,683,016.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 10 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、组合复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	沪深 300 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	上海证券报
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	52,248,179.54
本期利润	90,328,739.94
加权平均基金份额本期利润	0.1575
本期加权平均净值利润率	11.31%
本期基金份额净值增长率	8.30%
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	401,478,236.44
期末可供分配基金份额利润	0.2870
期末基金资产净值	2,035,564,936.32
期末基金份额净值	1.4553
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	45.53%

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）。

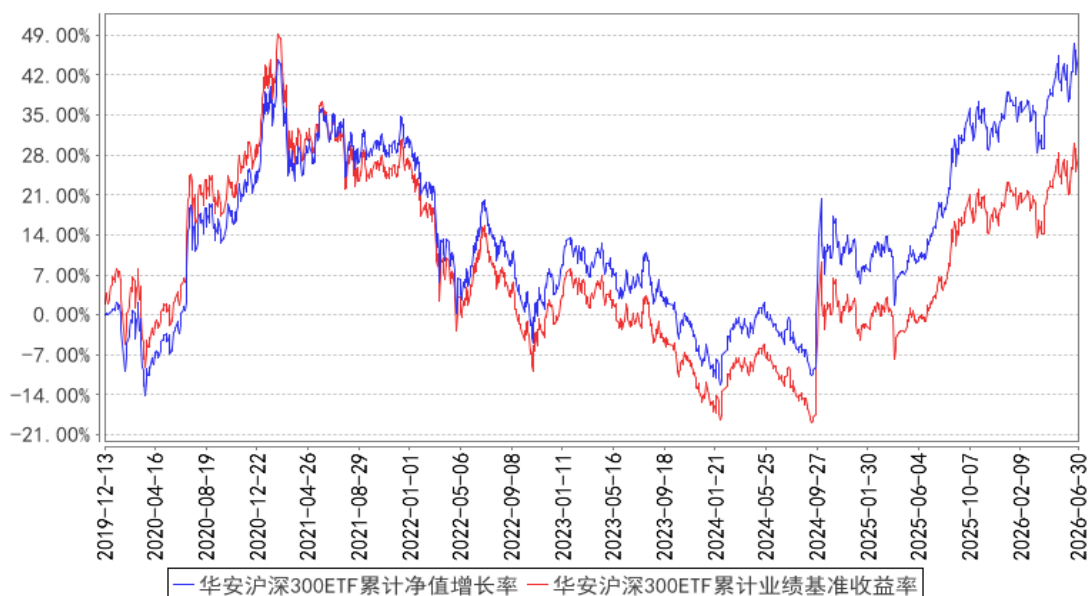
3.2 基金净值表现

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	12.53%	1.25%	11.90%	1.26%	0.63%	-0.01%
过去六个月	8.30%	1.12%	7.55%	1.13%	0.75%	-0.01%
过去一年	28.97%	1.02%	26.51%	1.02%	2.46%	0.00%
过去三年	38.44%	1.11%	29.59%	1.11%	8.85%	0.00%
过去五年	7.94%	1.11%	-4.68%	1.12%	12.62%	-0.01%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	45.53%	1.17%	27.97%	1.18%	17.56%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海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		
顾昕	本基金的 基金经理	2024 年 6 月 17 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中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，我国经济呈现“动能向新、结构向优”的发展态势，A 股市场是实体经济的重要映射，呈现科技领涨、指数整体震荡抬升的结构性特征，科技的强势地位得到了基本面与资金面的双重验证。报告期内，沪深 300 指数走强，硬科技产业链成为绝对的正贡献主力，而银行、食品饮料等传统权重板块则构成主要拖累。

本基金跟踪沪深 300 指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。

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 1.4553 元，本报告期份额净值增长率为 8.30%，同期业绩比较基准增长率为 7.55%。

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 2026 年下半年，资本市场平稳运行、长期向好的趋势不会轻易发生改变，沪深 300 指数作为 A 股市场的基准宽基指数，是国内核心资产的代表，配置价值不断强化。

经过 6 月的定期调样，沪深 300 指数成份股和权重已明显向电子、通信等科技领域迁移，而传统金融和消费等行业权重下降，指数的第一大权重股完成了从新能源龙头向 AI 算力龙头的交

接。

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合规守信、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：华安沪深 300 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	74,033,833.07	5,619,418.58
结算备付金		21,911,734.37	4,433,884.21
存出保证金		12,059,746.81	1,214,237.29
交易性金融资产	6.4.7.2	1,930,970,731.58	498,478,514.89
其中：股票投资		1,930,970,731.58	498,478,514.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		19,403,465.00	60,672.96
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		2,058,379,510.83	509,806,727.93
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		11,822,411.40	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		180,905.09	66,806.26
应付托管费		60,301.68	22,268.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		20,165.87	19,709.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	10,730,790.47	832,245.00
负债合计		22,814,574.51	941,029.83
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	1,398,683,016.00	378,683,016.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	636,881,920.32	130,182,682.10
净资产合计		2,035,564,936.32	508,865,698.10
负债和净资产总计		2,058,379,510.83	509,806,727.93

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4553 元，基金份额总额 1,398,683,016.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 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		91,209,881.89	8,121,377.03
1. 利息收入		62,185.90	42,566.32

其中：存款利息收入	6.4.7.9	62,185.90	42,566.32
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）		53,384,222.03	14,402,816.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	41,151,152.49	7,189,064.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	13,274.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	828,871.73	-361,020.39
股利收益	6.4.7.13	11,404,197.81	7,561,497.08
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	38,080,560.40	-6,400,683.10
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	-317,086.44	76,677.47
减：二、营业总支出		881,141.95	802,333.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	589,408.37	496,179.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	196,469.42	165,393.06
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		2,997.58	0.02
8. 其他费用	6.4.7.17	92,266.58	140,761.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,328,739.94	7,319,043.41
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90,328,739.94	7,319,043.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		90,328,739.94	7,319,043.41

6.3 净资产变动表

会计主体：华安沪深 300 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	378,683,016.00	-	130,182,682.10	508,865,698.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	378,683,016.00	-	130,182,682.10	508,865,698.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,020,000,000.00	-	506,699,238.22	1,526,699,238.22
（一）、综合收益总额	-	-	90,328,739.94	90,328,739.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,020,000,000.00	-	416,370,498.28	1,436,370,498.28
其中：1. 基金申购款	1,332,000,000.00	-	541,738,595.81	1,873,738,595.81
2. 基金赎回款	-312,000,000.00	-	-125,368,097.53	-437,368,097.53
（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	1,398,683,016.00	-	636,881,920.32	2,035,564,936.32
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	718,683,016.00	-	82,420,071.50	801,103,087.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	718,683,016.00	-	82,420,071.50	801,103,087.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-244,000,000.00	-	-21,448,148.91	-265,448,148.91
（一）、综合收益总额	-	-	7,319,043.41	7,319,043.41
（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）	-244,000,000.00	-	-28,767,192.32	-272,767,192.32
其中：1. 基金申购款	44,000,000.00	-	3,127,925.27	47,127,925.27
2. 基金赎回款	-288,000,000.00	-	-31,895,117.59	-319,895,117.59
（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	474,683,016.00	-	60,971,922.59	535,654,938.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>徐勇</u>	<u>任志浩</u>	<u>童欣</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1823 号文《关于准予华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2019 年 12 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 442,683,016.00 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，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、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（含分离交易可转债的纯债部分、可交换债）、短期融资券）、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。

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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% 的规定的征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	74,033,833.07
等于：本金	74,026,808.53
加：应计利息	7,024.54
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	74,033,833.07

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		1,825,527,304.65	-	1,930,970,731.58	105,443,426.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,825,527,304.65	-	1,930,970,731.58	105,443,426.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	96,411,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	96,411,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	96,411,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IF2609	IF2609	62.00	90,206,280.00	1,997,040.00
IF2612	IF2612	6.00	8,570,520.00	367,800.00
合计				2,364,840.00
减:可抵销期货 暂收款				2,364,840.00
净额				0.00

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	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	263,816.14
其中：交易所市场	263,816.14
银行间市场	—
应付利息	—
可退替代款	526,460.83
应付替代款	9,851,253.35
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	10,730,790.47

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	378,683,016.00	378,683,016.00
本期申购	1,332,000,000.00	1,332,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-312,000,000.00	-312,000,000.00
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	1,398,683,016.00	1,398,683,016.00

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	77,979,016.19	52,203,665.91	130,182,682.10
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	77,979,016.19	52,203,665.91	130,182,682.10
本期利润	52,248,179.54	38,080,560.40	90,328,739.94
本期基金份额交易产生的变动数	271,251,040.71	145,119,457.57	416,370,498.28
其中：基金申购款	351,147,471.39	190,591,124.42	541,738,595.81
基金赎回款	-79,896,430.68	-45,471,666.85	-125,368,097.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	401,478,236.44	235,403,683.88	636,881,920.32

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	28,863.67
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	33,174.17
其他	148.06
合计	62,185.90

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	29,958,015.38
股票投资收益——赎回差价收入	11,193,137.11
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	41,151,152.49

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	394,300,365.03
减：卖出股票成本总额	363,795,044.30
减：交易费用	547,305.35
买卖股票差价收入	29,958,015.38

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	437,368,097.53
减：现金支付赎回款总额	182,338,793.53
减：赎回股票成本总额	243,836,166.89
减：交易费用	—
赎回差价收入	11,193,137.11

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

无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	828,871.73

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	11,404,197.81
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	11,404,197.81

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	35,775,000.40
股票投资	35,775,000.40
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	2,305,560.00
权证投资	—
期货投资	2,305,560.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	38,080,560.40

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	-317,086.44
合计	-317,086.44

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	3,006.43
合计	92,266.58

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
华安沪深 300 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	589,408.37	496,179.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,191.78	62,862.74
应支付基金管理人的净管理费	508,216.59	433,316.49

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	196,469.42	165,393.06

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（%）
国泰海通证 券股份有限 公司	85,699,200.00	6.13	6,719,500.00	1.77
招商银行股 份有限公司 — 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	200,210,600.00	14.31	140,480,000.00	37.10

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	74,033,833.07	28,863.67	9,837,628.18	19,488.86

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

本基金本报告期末投资于基金托管人招商银行股份有限公司发行的股票——招商银行(代码 600036)847,028.00 股,期末公允价值为人民币 30,069,494.00 元,占本基金期末基金资产净值比例为 1.48%。

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)773,996.00 股,期末公允价值为人民币 14,086,727.20 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.69%。

本基金上年度末投资于基金托管人招商银行股份有限公司发行的股票——招商银行(代码 600036)244,228.00 股,期末公允价值为人民币 10,281,998.80 元,占本基金期末基金资产净值比例为 2.02%。

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)222,910.00 股,期末公允价值为人民币 4,580,800.50 元,占本基金期末基金资产净值比例为 0.90%。

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

无。

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	12,533	8,633,236.60	10,427,456.00	-

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。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金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（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，从而能够紧密跟踪标的指数，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同责任，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、结算备付金及存出保证金等。

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	74,033,833.07	-	-	-	74,033,833.07
结算备付金	21,911,734.37	-	-	-	21,911,734.37
存出保证金	206,530.81	-	-	11,853,216.00	12,059,746.81
交易性金融资产	-	-	-	1,930,970,731.58	1,930,970,731.58
应收清算款	-	-	-	19,403,465.00	19,403,465.00
资产总计	96,152,098.25	-	-	1,962,227,412.58	2,058,379,510.83
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	180,905.09	180,905.09
应付托管费	-	-	-	60,301.68	60,301.68
应付清算款	-	-	-	11,822,411.40	11,822,411.40
应交税费	-	-	-	20,165.87	20,165.87
其他负债	-	-	-	10,730,790.47	10,730,790.47
负债总计	-	-	-	22,814,574.51	22,814,574.51
利率敏感度缺口	96,152,098.25	-	-	1,939,412,838.07	2,035,564,936.32
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	5,619,418.58	-	-	-	5,619,418.58
结算备付金	4,433,884.21	-	-	-	4,433,884.21
存出保证金	56,750.89	-	-	1,157,486.40	1,214,237.29
交易性金融资产	-	-	-	498,478,514.89	498,478,514.89
应收清算款	-	-	-	60,672.96	60,672.96
资产总计	10,110,053.68	-	-	499,696,674.25	509,806,727.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	66,806.26	66,806.26
应付托管费	-	-	-	22,268.75	22,268.75
应交税费	-	-	-	19,709.82	19,709.82
其他负债	-	-	-	832,245.00	832,245.00
负债总计	-	-	-	941,029.83	941,029.83
利率敏感度缺口	10,110,053.68	-	-	498,755,644.42	508,865,698.10

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，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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，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(含存托凭证)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	1,930,970,731.58	94.86	498,478,514.89	97.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,930,970,731.58	94.86	498,478,514.89	97.96

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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%	101,192,942.73	25,483,099.60
	业绩比较基准下降 5%	-101,192,942.73	-25,483,099.60

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	1,920,543,275.58	495,152,335.25
第二层次	10,427,456.00	3,326,179.64
第三层次	—	—
合计	1,930,970,731.58	498,478,514.89

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	1,930,970,731.58	93.81
	其中：股票	1,930,970,731.58	93.81
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	95,945,567.44	4.66
8	其他各项资产	31,463,211.81	1.53
9	合计	2,058,379,510.83	100.00

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 1,175.28 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	11,024,954.20	0.54
B	采矿业	81,083,010.70	3.98
C	制造业	1,235,172,927.58	60.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,276,105.00	2.37
E	建筑业	22,194,623.60	1.09
F	批发和零售业	2,851,908.00	0.14
G	交通运输、仓储	46,970,461.94	2.31

	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	104,000,150.73	5.11
J	金融业	339,325,534.55	16.67
K	房地产业	6,355,365.72	0.31
L	租赁和商务服务业	8,878,058.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	21,082,033.20	1.04
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	2,632,115.08	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,122,308.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	1,930,969,556.30	94.86

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	76,060	96,596,200.00	4.75
2	300750	宁德时代	180,771	71,044,810.71	3.49
3	300502	新易盛	95,456	57,941,792.00	2.85
4	600519	贵州茅台	42,500	50,383,325.00	2.48
5	603986	兆易创新	42,844	34,917,860.00	1.72
6	601318	中国平安	729,608	34,831,485.92	1.71
7	688256	寒武纪	21,103	33,670,891.65	1.65
8	600036	招商银行	847,028	30,069,494.00	1.48
9	601899	紫金矿业	1,127,800	28,352,892.00	1.39
10	002371	北方华创	29,765	26,328,928.40	1.29
11	000333	美的集团	332,777	25,134,646.81	1.23

12	002475	立讯精密	348,959	24,566,713.60	1.21
13	688012	中微公司	51,376	24,069,656.00	1.18
14	688008	澜起科技	77,611	24,051,648.90	1.18
15	688041	海光信息	63,235	23,415,920.50	1.15
16	002384	东山精密	88,000	23,086,800.00	1.13
17	600900	长江电力	837,300	22,163,331.00	1.09
18	688981	中芯国际	138,951	22,068,197.82	1.08
19	000725	京东方 A	2,487,900	21,594,972.00	1.06
20	603259	药明康德	169,320	21,082,033.20	1.04
21	601138	工业富联	270,900	19,545,435.00	0.96
22	600030	中信证券	668,850	19,216,060.50	0.94
23	601166	兴业银行	1,158,200	19,179,792.00	0.94
24	300059	东方财富	867,402	17,677,652.76	0.87
25	600183	生益科技	99,900	17,322,660.00	0.85
26	600276	恒瑞医药	305,450	15,895,618.00	0.78
27	300274	阳光电源	99,420	15,809,768.40	0.78
28	601398	工商银行	2,217,100	15,674,897.00	0.77
29	300408	三环集团	91,900	15,338,110.00	0.75
30	002594	比亚迪	186,100	14,832,170.00	0.73
31	300476	胜宏科技	41,600	14,411,488.00	0.71
32	002463	沪电股份	92,300	14,103,440.00	0.69
33	601211	国泰海通	773,996	14,086,727.20	0.69
34	300394	天孚通信	42,260	12,791,256.80	0.63
35	000988	华工科技	68,700	12,682,707.00	0.62
36	301308	江波龙	17,700	12,457,260.00	0.61
37	600176	中国巨石	166,420	12,128,689.60	0.60
38	601288	农业银行	1,968,900	11,951,223.00	0.59
39	601328	交通银行	1,828,300	11,755,969.00	0.58
40	000651	格力电器	306,300	11,486,250.00	0.56
41	600522	中天科技	188,100	11,413,908.00	0.56
42	688521	芯原股份	29,300	10,874,402.00	0.53
43	600919	江苏银行	1,005,140	10,835,409.20	0.53
44	603019	中科曙光	100,080	10,731,578.40	0.53
45	603993	洛阳钼业	598,100	10,496,655.00	0.52
46	600150	中国船舶	308,773	10,433,439.67	0.51
47	688072	拓荆科技	12,533	10,427,456.00	0.51
48	600887	伊利股份	433,600	10,389,056.00	0.51
49	600584	长电科技	97,900	10,137,545.00	0.50
50	000338	潍柴动力	368,500	10,041,625.00	0.49
51	000858	五粮液	133,100	9,849,400.00	0.48
52	601816	京沪高铁	2,005,600	9,085,368.00	0.45
53	600309	万华化学	129,086	8,830,773.26	0.43
54	002916	深南电路	18,921	8,663,925.90	0.43

55	300124	汇川技术	130,200	8,636,166.00	0.42
56	002415	海康威视	251,000	8,584,200.00	0.42
57	600111	北方稀土	173,300	8,327,065.00	0.41
58	601688	华泰证券	400,200	8,252,124.00	0.41
59	000100	TCL 科技	1,398,790	8,140,957.80	0.40
60	000063	中兴通讯	220,500	7,979,895.00	0.39
61	600000	浦发银行	911,105	7,844,614.05	0.39
62	600089	特变电工	346,030	7,785,675.00	0.38
63	601857	中国石油	888,200	7,709,576.00	0.38
64	601088	中国神华	187,980	7,338,739.20	0.36
65	300433	蓝思科技	136,100	7,303,126.00	0.36
66	002028	思源电气	42,000	7,266,000.00	0.36
67	600031	三一重工	405,600	7,008,768.00	0.34
68	300014	亿纬锂能	104,100	6,769,623.00	0.33
69	002142	宁波银行	226,860	6,735,473.40	0.33
70	002050	三花智控	153,320	6,720,015.60	0.33
71	601601	中国太保	234,700	6,693,644.00	0.33
72	000001	平安银行	664,600	6,679,230.00	0.33
73	000792	盐湖股份	217,400	6,563,306.00	0.32
74	002714	牧原股份	186,916	6,540,190.84	0.32
75	600549	厦门钨业	75,800	6,458,160.00	0.32
76	002353	杰瑞股份	41,400	6,313,500.00	0.31
77	600406	国电南瑞	275,651	6,298,625.35	0.31
78	601668	中国建筑	1,414,500	6,138,930.00	0.30
79	000657	中钨高新	62,400	5,972,928.00	0.29
80	601229	上海银行	683,400	5,931,912.00	0.29
81	601919	中远海控	430,352	5,706,467.52	0.28
82	002602	世纪华通	403,000	5,682,300.00	0.28
83	601988	中国银行	983,100	5,623,332.00	0.28
84	601939	建设银行	582,000	5,604,660.00	0.28
85	300760	迈瑞医疗	40,900	5,555,447.00	0.27
86	603501	豪威集团	58,338	5,533,359.30	0.27
87	601728	中国电信	1,063,700	5,520,603.00	0.27
88	600016	民生银行	1,699,300	5,471,746.00	0.27
89	600660	福耀玻璃	108,300	5,462,652.00	0.27
90	601012	隆基绿能	415,672	5,453,616.64	0.27
91	601225	陕西煤业	265,300	5,398,855.00	0.27
92	002230	科大讯飞	132,000	5,390,880.00	0.26
93	600999	招商证券	255,190	5,384,509.00	0.26
94	600941	中国移动	62,200	5,357,286.00	0.26
95	600690	海尔智家	258,300	5,271,903.00	0.26
96	002352	顺丰控股	164,750	5,150,085.00	0.25
97	601985	中国核电	563,600	5,089,308.00	0.25

98	002460	赣锋锂业	77,000	5,035,800.00	0.25
99	002709	天赐材料	97,800	5,029,854.00	0.25
100	300033	同花顺	20,860	5,027,260.00	0.25
101	600926	杭州银行	346,900	5,012,705.00	0.25
102	603799	华友钴业	103,840	5,011,318.40	0.25
103	601169	北京银行	1,019,300	4,994,570.00	0.25
104	000977	浪潮信息	70,200	4,914,000.00	0.24
105	002938	鹏鼎控股	46,600	4,910,708.00	0.24
106	600160	巨化股份	92,200	4,887,522.00	0.24
107	000776	广发证券	201,600	4,717,440.00	0.23
108	300442	润泽科技	56,200	4,668,534.00	0.23
109	000425	徐工机械	561,610	4,543,424.90	0.22
110	300498	温氏股份	364,023	4,484,763.36	0.22
111	601600	中国铝业	545,400	4,483,188.00	0.22
112	600938	中国海油	164,200	4,458,030.00	0.22
113	000938	紫光股份	154,240	4,451,366.40	0.22
114	002202	金风科技	186,200	4,450,180.00	0.22
115	600028	中国石化	996,770	4,445,594.20	0.22
116	688126	沪硅产业	110,641	4,413,469.49	0.22
117	601766	中国中车	831,300	4,322,760.00	0.21
118	002466	天齐锂业	70,400	4,316,928.00	0.21
119	600050	中国联通	1,079,100	4,316,400.00	0.21
120	300661	圣邦股份	29,707	4,262,360.36	0.21
121	002600	领益智造	245,700	4,260,438.00	0.21
122	600460	士兰微	77,200	4,219,752.00	0.21
123	601009	南京银行	424,200	4,195,338.00	0.21
124	002837	英维克	52,630	4,187,242.80	0.21
125	688082	盛美上海	9,559	4,129,488.00	0.20
126	002049	紫光国微	45,680	4,054,100.00	0.20
127	002179	中航光电	87,018	4,020,231.60	0.20
128	601628	中国人寿	111,600	3,945,060.00	0.19
129	000568	泸州老窖	50,542	3,918,015.84	0.19
130	601100	恒立液压	36,204	3,894,102.24	0.19
131	601872	招商轮船	221,500	3,891,755.00	0.19
132	002241	歌尔股份	170,800	3,848,124.00	0.19
133	601006	大秦铁路	819,800	3,779,278.00	0.19
134	000408	藏格矿业	54,000	3,743,280.00	0.18
135	601658	邮储银行	753,700	3,715,741.00	0.18
136	603288	海天味业	111,872	3,709,675.52	0.18
137	601818	光大银行	1,283,400	3,709,026.00	0.18
138	605117	德业股份	34,885	3,704,089.30	0.18
139	688111	金山办公	17,341	3,694,500.05	0.18
140	600809	山西汾酒	33,700	3,685,769.00	0.18

141	600905	三峡能源	984,800	3,653,608.00	0.18
142	601888	中国中免	67,400	3,620,054.00	0.18
143	002625	光启技术	119,200	3,614,144.00	0.18
144	600489	中金黄金	198,900	3,590,145.00	0.18
145	688396	华润微	36,786	3,588,474.30	0.18
146	600893	航发动力	92,100	3,531,114.00	0.17
147	000630	铜陵有色	552,800	3,515,808.00	0.17
148	600010	宝钢股份	1,559,500	3,477,685.00	0.17
149	688271	联影医疗	34,321	3,474,314.83	0.17
150	601127	赛力斯	56,000	3,430,000.00	0.17
151	601336	新华保险	57,100	3,406,586.00	0.17
152	601689	拓普集团	60,070	3,389,149.40	0.17
153	600958	东方证券	357,600	3,375,744.00	0.17
154	002027	分众传媒	691,300	3,345,892.00	0.16
155	600019	宝钢股份	601,900	3,268,317.00	0.16
156	600118	中国卫星	39,100	3,208,155.00	0.16
157	000807	云铝股份	141,400	3,130,596.00	0.15
158	688183	生益电子	23,600	3,124,640.00	0.15
159	600760	中航沈飞	75,743	3,113,037.30	0.15
160	600989	宝丰能源	152,300	3,096,259.00	0.15
161	601838	成都银行	174,135	3,082,189.50	0.15
162	600104	上汽集团	314,900	3,073,424.00	0.15
163	600362	江西铜业	70,600	3,056,980.00	0.15
164	601727	上海电气	431,600	3,021,200.00	0.15
165	300450	先导智能	73,900	3,009,208.00	0.15
166	600875	东方电气	104,200	2,997,834.00	0.15
167	002001	新和成	105,156	2,988,533.52	0.15
168	601825	沪农商行	396,500	2,969,785.00	0.15
169	601390	中国中铁	706,000	2,944,020.00	0.14
170	000538	云南白药	61,380	2,907,570.60	0.14
171	002422	科伦药业	74,600	2,873,592.00	0.14
172	600795	国电电力	615,300	2,873,451.00	0.14
173	601377	兴业证券	475,690	2,873,167.60	0.14
174	600547	山东黄金	124,300	2,870,087.00	0.14
175	601669	中国电建	600,100	2,820,470.00	0.14
176	603296	华勤技术	37,880	2,813,347.60	0.14
177	600585	海螺水泥	165,700	2,808,615.00	0.14
178	600015	华夏银行	438,500	2,802,015.00	0.14
179	601995	中金公司	76,900	2,779,935.00	0.14
180	603893	瑞芯微	14,600	2,750,056.00	0.14
181	601916	浙商银行	1,039,200	2,733,096.00	0.13
182	000166	申万宏源	618,400	2,720,960.00	0.13
183	300316	晶盛机电	44,400	2,681,760.00	0.13

184	601698	中国卫通	88,000	2,662,000.00	0.13
185	002648	卫星化学	112,560	2,644,034.40	0.13
186	300015	爱尔眼科	318,658	2,632,115.08	0.13
187	601066	中信建投	89,246	2,594,381.22	0.13
188	601868	中国能建	967,000	2,581,890.00	0.13
189	002311	海大集团	57,039	2,544,509.79	0.13
190	600346	恒力石化	143,400	2,539,614.00	0.12
191	002558	巨人网络	91,500	2,521,740.00	0.12
192	601998	中信银行	362,600	2,512,818.00	0.12
193	300418	昆仑万维	62,100	2,506,356.00	0.12
194	600482	中国动力	75,500	2,476,400.00	0.12
195	600066	宇通客车	91,700	2,458,477.00	0.12
196	000625	长安汽车	341,090	2,445,615.30	0.12
197	600426	华鲁恒升	101,800	2,435,056.00	0.12
198	605499	东鹏饮料	19,581	2,416,882.83	0.12
199	002532	天山铝业	222,600	2,388,498.00	0.12
200	000157	中联重科	341,000	2,376,770.00	0.12
201	600221	海航控股	1,757,300	2,372,355.00	0.12
202	688036	传音控股	39,781	2,345,089.95	0.12
203	300803	指南针	25,200	2,310,084.00	0.11
204	600011	华能国际	304,200	2,308,878.00	0.11
205	600048	保利发展	496,600	2,299,258.00	0.11
206	600436	片仔癀	20,806	2,273,679.68	0.11
207	600438	通威股份	186,600	2,259,726.00	0.11
208	002236	大华股份	135,700	2,237,693.00	0.11
209	601077	渝农商行	363,700	2,222,207.00	0.11
210	600886	国投电力	166,900	2,221,439.00	0.11
211	002493	荣盛石化	206,250	2,217,187.50	0.11
212	600115	中国东航	581,400	2,215,134.00	0.11
213	600570	恒生电子	103,561	2,194,457.59	0.11
214	600188	兖矿能源	122,890	2,183,755.30	0.11
215	003816	中国广核	541,300	2,116,483.00	0.10
216	002736	国信证券	209,900	2,096,901.00	0.10
217	601360	三六零	239,600	2,082,124.00	0.10
218	688047	龙芯中科	13,400	2,072,578.00	0.10
219	000301	东方盛虹	180,200	2,063,290.00	0.10
220	601058	赛轮轮胎	178,500	2,058,105.00	0.10
221	601901	方正证券	280,200	2,017,440.00	0.10
222	600026	中远海能	112,100	2,011,074.00	0.10
223	002074	国轩高科	73,100	2,010,981.00	0.10
224	600009	上海机场	86,500	1,998,150.00	0.10
225	600196	复星医药	88,200	1,981,854.00	0.10
226	000768	中航西飞	95,000	1,945,600.00	0.10

227	601788	光大证券	134,600	1,942,278.00	0.10
228	600029	南方航空	371,700	1,925,406.00	0.09
229	601111	中国国航	317,800	1,922,690.00	0.09
230	600415	小商品城	188,200	1,912,112.00	0.09
231	600674	川投能源	134,200	1,901,614.00	0.09
232	000975	山金国际	111,400	1,893,800.00	0.09
233	600219	南山铝业	474,351	1,892,660.49	0.09
234	601456	国联民生	213,900	1,890,876.00	0.09
235	601186	中国铁建	314,600	1,871,870.00	0.09
236	600233	圆通速递	118,500	1,866,375.00	0.09
237	601117	中国化学	251,200	1,846,320.00	0.09
238	601881	中国银河	146,200	1,837,734.00	0.09
239	601877	正泰电器	72,500	1,817,575.00	0.09
240	301269	华大九天	15,200	1,815,184.00	0.09
241	600372	中航机载	166,700	1,808,695.00	0.09
242	601878	浙商证券	188,300	1,788,850.00	0.09
243	301236	软通动力	40,700	1,727,715.00	0.08
244	000963	华东医药	60,400	1,698,448.00	0.08
245	002920	德赛西威	20,700	1,687,050.00	0.08
246	600741	华域汽车	107,100	1,662,192.00	0.08
247	688506	百利天恒	5,600	1,646,568.00	0.08
248	000895	双汇发展	70,862	1,587,308.80	0.08
249	300866	安克创新	15,100	1,577,950.00	0.08
250	001979	招商蛇口	245,100	1,575,993.00	0.08
251	601898	中煤能源	127,900	1,557,822.00	0.08
252	601021	春秋航空	33,599	1,531,442.42	0.08
253	002304	洋河股份	40,000	1,526,000.00	0.07
254	601319	中国人保	219,100	1,481,116.00	0.07
255	600023	浙能电力	275,600	1,449,656.00	0.07
256	000002	万科 A	471,957	1,396,992.72	0.07
257	601800	中国交建	244,000	1,393,240.00	0.07
258	600039	四川路桥	176,980	1,383,983.60	0.07
259	688223	晶科能源	278,857	1,324,570.75	0.07
260	600600	青岛啤酒	25,000	1,305,750.00	0.06
261	601633	长城汽车	86,385	1,303,549.65	0.06
262	600588	用友网络	139,480	1,280,426.40	0.06
263	001965	招商公路	139,500	1,277,820.00	0.06
264	603369	今世缘	52,300	1,240,033.00	0.06
265	601618	中国中冶	497,500	1,213,900.00	0.06
266	600027	华电国际	271,000	1,205,950.00	0.06
267	603260	合盛硅业	24,900	1,201,674.00	0.06
268	600918	中泰证券	222,800	1,185,296.00	0.06
269	302132	中航成飞	20,300	1,183,896.00	0.06

270	300628	亿联网络	34,710	1,173,892.20	0.06
271	600025	华能水电	131,000	1,164,590.00	0.06
272	601607	上海医药	74,900	1,153,460.00	0.06
273	300832	新产业	27,300	1,146,600.00	0.06
274	000617	中油资本	173,000	1,140,070.00	0.06
275	600061	国投资本	173,604	1,137,106.20	0.06
276	300251	光线传媒	101,200	1,122,308.00	0.06
277	600930	华电新能	232,100	1,107,117.00	0.05
278	601059	信达证券	67,600	1,094,444.00	0.05
279	688472	阿特斯	100,800	1,090,656.00	0.05
280	600515	海南机场	395,300	1,083,122.00	0.05
281	600803	新奥股份	64,600	1,020,680.00	0.05
282	600085	同仁堂	43,900	1,014,529.00	0.05
283	600018	上港集团	209,100	986,952.00	0.05
284	600845	宝信软件	58,363	970,576.69	0.05
285	000999	华润三九	42,709	960,525.41	0.05
286	300896	爱美客	10,780	940,016.00	0.05
287	300122	智飞生物	79,450	928,770.50	0.05
288	000596	古井贡酒	11,600	925,680.00	0.05
289	300999	金龙鱼	39,300	914,118.00	0.04
290	000708	中信特钢	69,300	874,566.00	0.04
291	601018	宁波港	268,300	845,145.00	0.04
292	688009	中国通号	174,775	831,929.00	0.04
293	601238	广汽集团	156,700	796,036.00	0.04
294	688303	大全能源	45,617	795,104.31	0.04
295	001280	中国铀业	11,800	787,060.00	0.04
296	300413	芒果超媒	52,300	765,149.00	0.04
297	301165	锐捷网络	9,000	724,050.00	0.04
298	603392	万泰生物	26,583	716,943.51	0.04
299	601136	首创证券	36,800	513,360.00	0.03
300	001391	国货航	99,500	404,965.00	0.02

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	300750	宁德时代	78,919,778.60	15.51
2	300308	中际旭创	78,610,559.36	15.45
3	300502	新易盛	46,087,786.60	9.06
4	000333	美的集团	27,388,821.21	5.38

5	002475	立讯精密	24,040,473.00	4.72
6	688256	寒武纪	21,815,144.75	4.29
7	002384	东山精密	21,012,894.08	4.13
8	002371	北方华创	20,800,011.00	4.09
9	002594	比亚迪	18,665,387.00	3.67
10	300059	东方财富	17,518,225.19	3.44
11	300274	阳光电源	15,170,741.00	2.98
12	000725	京东方 A	14,128,137.00	2.78
13	301308	江波龙	13,451,189.00	2.64
14	300476	胜宏科技	13,135,507.00	2.58
15	002916	深南电路	12,468,659.40	2.45
16	000651	格力电器	12,182,365.00	2.39
17	002463	沪电股份	12,157,393.91	2.39
18	300394	天孚通信	11,897,297.60	2.34
19	000858	五粮液	11,593,371.57	2.28
20	000338	潍柴动力	11,533,591.56	2.27
21	300408	三环集团	11,356,370.45	2.23
22	000988	华工科技	11,141,154.00	2.19
23	600519	贵州茅台	10,816,408.00	2.13

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	25,585,419.15	5.03
2	300308	中际旭创	20,188,645.00	3.97
3	300502	新易盛	13,524,128.00	2.66
4	688111	金山办公	9,948,821.77	1.96
5	000333	美的集团	8,849,228.54	1.74
6	688012	中微公司	7,862,206.20	1.55
7	002384	东山精密	7,775,518.00	1.53
8	002371	北方华创	7,434,501.00	1.46
9	002916	深南电路	7,396,747.00	1.45
10	002475	立讯精密	7,200,412.33	1.41
11	002594	比亚迪	6,315,921.28	1.24
12	300059	东方财富	5,311,809.36	1.04
13	300033	同花顺	4,606,109.00	0.91
14	300274	阳光电源	4,480,152.00	0.88
15	600519	贵州茅台	4,209,359.50	0.83
16	000725	京东方 A	4,203,170.00	0.83
17	688256	寒武纪	4,108,986.81	0.81

18	002463	沪电股份	4,052,821.15	0.80
19	000651	格力电器	4,003,086.79	0.79
20	000338	潍柴动力	3,880,937.00	0.76

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	952,403,996.11
卖出股票收入（成交）总额	394,300,365.03

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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	12,059,746.81
2	应收清算款	19,403,465.00
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	31,463,211.81

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	户均持有的	持有人结构
------	-------	-------

数（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（%）
7,270	192,391.06	1,228,722,105.00	87.85	169,960,911.00	12.15

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— 华安沪深 300 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	200,210,600.00	14.31

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（2019 年 12 月 13 日） 基金份额总额	442,683,016.00
本报告期期初基金份额总额	378,683,016.00
本报告期基金总申购份额	1,332,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	312,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	1,398,683,016.00

§ 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 (%)	
招商证券	1	961,648,811.81	71.41	188,384.14	71.41	-
中信建投	2	334,030,923.96	24.80	65,436.66	24.80	-
平安证券	1	49,220,572.25	3.65	9,641.94	3.65	-
华泰证券	1	1,804,053.12	0.13	353.40	0.13	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

国联民生	1	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村东方 证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安沪深 300 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
2	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
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 分上交所 ETF 变更扩位证券简称的 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	华安沪深 300 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部分基	中国证监会基金电子披	2026 年 3 月 31 日

	金 2025 年年度报告的提示性公告	露网站和公司网站等规定媒介	
7	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
8	华安沪深 300 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	华安沪深 300 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

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	20260101~20260528	140,480,000.00	74,904,100.00	15,173,500.00	200,210,600.00	14.31
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、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

- 2、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沪深 300 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沪深 300 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