

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 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，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51

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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 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	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	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	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证 180ETF
场内简称	180ETF(扩位简称:上证 180ETF)
基金主代码	510180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,812,557,679.00 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	2006 年 5 月 18 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	<p>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。</p> <p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p>
业绩比较基准	上证 180 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228
传真		021-68863414	021-60635778

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	张金良

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-195,710,700.58
本期利润	688,239,807.82
加权平均基金份额本期利润	0.1173
本期加权平均净值利润率	3.57%
本期基金份额净值增长率	3.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	12,947,089,657.34
期末可供分配基金份额利润	2.2274
期末基金资产净值	19,185,696,593.39
期末基金份额净值	3.3007
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	277.66%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相

关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

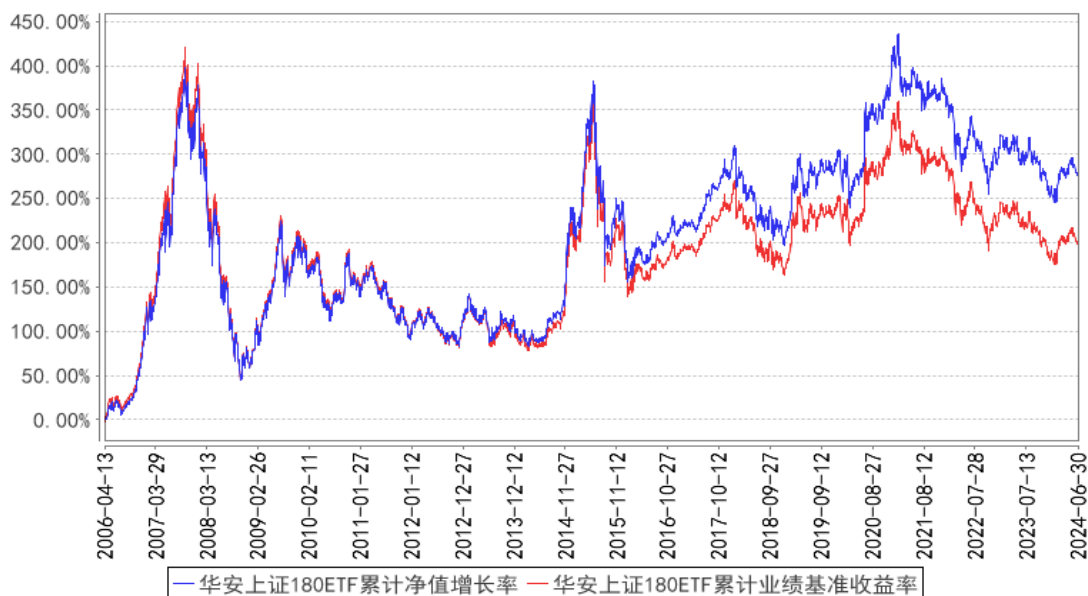
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.09%	0.45%	-2.80%	0.45%	0.71%	0.00%
过去三个月	-0.40%	0.68%	-1.08%	0.68%	0.68%	0.00%
过去六个月	3.59%	0.82%	3.03%	0.82%	0.56%	0.00%
过去一年	-3.82%	0.82%	-5.81%	0.82%	1.99%	0.00%
过去三年	-22.43%	0.99%	-27.51%	1.00%	5.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	277.66%	1.59%	199.58%	1.62%	78.08%	-0.03%

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

华安上证180ETF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。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 263 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,651.01 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	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	2009 年 9 月 5 日	-	20 年	理学博士，20 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

					<p>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月起,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月起,同时担任华安沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
许之彦	公募基金	9	74,221,550,688.64	2009年9月5日
	私募资产管理计划	1	211,884,247.19	2023年11月13日
	其他组合	-	-	-
	合计	10	74,433,434,935.83	-

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

2024 年上半年，国内经济平稳复苏，GDP 季度环比连续八个季度实现正增长，但二季度 GDP 环比增速有所放缓。国内有效需求的不足以及居民预期的低迷，使得经济数据阶段性偏弱，海外不确定性亦有所抬升。国内权益震荡分化，大盘价值走势稳健，小盘成长持续回撤，报告期内上证 180 指数上涨 3.03%。

本基金跟踪上证 180 指数，该指数由沪市 A 股中规模大、流动性好的 180 只股票组成，反映上海证券市场一批蓝筹公司的股票价格表现。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 3.3007 元，本报告期份额净值增长率为 3.59%，同期业绩比较基准增长率为 3.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前 A 股处于低估值区间，随着宏观经济长的正向变量逐步积累，财政与货币政策工具有序加码，国内市场风险偏好或触底回升，以上证 180 指数为代表的核心资产估值中枢有望抬升。

海外方面，全球经济转弱趋势已现，海外股市波动加剧，全球资金再配置或成为资本市场主旋律，为 A 股带来增量资金，核心宽基或率先受益。

上证 180 指数覆盖沪市各行业龙头公司，整体经营稳健，基本面优势显现。作为国内市场核心资产的代表，配置价值依然突出。

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、固定收益部负责人、绝对收益投资部负责人、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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	99,157,470.69	62,831,969.54
结算备付金		447,439.31	69,487.87
存出保证金		35,205.23	90,717.94
交易性金融资产	6.4.7.2	19,098,137,761.50	18,832,187,124.85
其中：股票投资		19,098,137,761.50	18,832,187,124.85
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		241,280.89	-
应收股利		27,208.80	40,800.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	18,169.01	268,848.65
资产总计		19,198,064,535.43	18,895,488,948.85
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		50,539.31	1,606,293.43
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		7,954,059.68	7,888,626.04
应付托管费		1,590,811.94	1,577,725.20
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	2,772,531.11	2,872,062.32
负债合计		12,367,942.04	13,944,706.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,238,606,936.05	6,360,426,266.94
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	12,947,089,657.34	12,521,117,974.92
净资产合计		19,185,696,593.39	18,881,544,241.86
负债和净资产总计		19,198,064,535.43	18,895,488,948.85

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.3007 元，基金份额总额 5,812,557,679.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		745,825,934.18	9,455,945.19
1. 利息收入		3,272,052.29	8,576,878.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	112,779.83	118,044.58
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		3,159,272.46	8,458,834.07
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-141,527,328.25	202,404,061.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-330,044,422.80	-55,401,559.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	358,169.74	1,088,118.68
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	188,158,924.81	256,717,502.60
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	883,950,508.40	-201,504,946.85
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	130,701.74	-20,047.99
减：二、营业总支出		57,586,126.36	59,895,605.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,871,803.80	49,792,068.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,574,360.78	9,958,413.76
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		1.04	5.83
8. 其他费用	6.4.7.17	139,960.74	145,117.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		688,239,807.82	-50,439,660.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		688,239,807.82	-50,439,660.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		688,239,807.82	-50,439,660.66

6.3 净资产变动表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	6,360,426,266.94	-	12,521,117,974.92	18,881,544,241.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,360,426,266.94	-	12,521,117,974.92	18,881,544,241.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	425,971,682.42	304,152,351.53
(一)、综合收益总额	121,819,330.89	-	688,239,807.82	688,239,807.82
(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)	-	-	-	-384,087,456.29
其中：1. 基金申购款	121,819,330.89	-	262,268,125.40	
2. 基金赎回款	359,554,853.12	-	734,328,913.27	1,093,883,766.39
	-	-	-	-
	481,374,184.01	-	996,597,038.67	1,477,971,222.68
(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	6,238,606,936.05	-	12,947,089,657.34	19,185,696,593.39
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	6,020,727,428.01	-	13,277,302,955.88	19,298,030,383.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,020,727,428.01	-	13,277,302,955.88	19,298,030,383.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	33,808,889.21	-	27,684,656.47	61,493,545.68
(一)、综合收益总额	-	-	-50,439,660.66	-50,439,660.66
(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)	33,808,889.21	-	78,124,317.13	111,933,206.34
其中：1. 基金申购款	266,177,921.17	-	623,680,499.38	889,858,420.55
2. 基金赎回款	- 232,369,031.96	-	- 545,556,182.25	-777,925,214.21
(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	6,054,536,317.22	-	13,304,987,612.35	19,359,523,929.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

朱学华

陈松一

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证 180 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”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,072,807,826.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,279.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为了与上证 180 指数进行对比,根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华安基金管理有限公司确定 2006 年 5 月 10 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2,919.214 点,本基金资产净值为 1,167,168,017.51 元,折算前基金份额总额为 1,072,822,105.00 份,折算前基金份额净值为 1.088 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.37268313,折算后基金份额总额为 399,822,674.00 份,折算后基金份额净值为 2.919 元。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 5 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2006]第 39 号文审核同意,本基金 399,822,674.00 份基金份额于 2006 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于华安上证 180ETF 实施份额拆分和修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于 2009 年 5 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 10:1,并于 2009 年 5 月 19 日进行了变更登记。

根据《关于上证 180ETF 基金份额合并结果及恢复交易和申购、赎回的公告》的有关规定，中国证券登记结算有限责任公司按合并比例 0.25 对 2013 年 12 月 19 日(权益登记日)登记在册的本基金的基金份额实施合并，减少基金份额持有人持有的基金份额数，并于 2013 年 12 月 20 日进行了变更登记。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数上证 180 指数的成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股(含存托凭证)、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金可以按照国家的有关规定进行融资及参与转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数。

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，于 2009 年 9 月 29 日募集成立了华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 180ETF 联接基金”)。上证 180ETF 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。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	99,157,470.69
等于：本金	99,149,589.83
加：应计利息	7,880.86
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	99,157,470.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,079,588,912.69	-	19,098,137,761.50	18,548,848.81
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	19,079,588,912.69	-	19,098,137,761.50	18,548,848.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	18,169.01
待摊费用	-
合计	18,169.01

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	2,597,180.59
其中：交易所市场	2,597,180.59
银行间市场	-
应付利息	-
应退替代款	16,619.20
可退替代款	19,862.18
预提费用	138,869.14
合计	2,772,531.11

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,926,057,679.00	6,360,426,266.94
本期申购	335,000,000.00	359,554,853.12
本期赎回（以“-”号填列）	-448,500,000.00	-481,374,184.01
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	5,812,557,679.00	6,238,606,936.05

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	22,917,190,575.34	-10,396,072,600.42	12,521,117,974.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	22,917,190,575.34	-10,396,072,600.42	12,521,117,974.92
本期利润	-195,710,700.58	883,950,508.40	688,239,807.82
本期基金	-437,840,012.04	175,571,886.64	-262,268,125.40

份额交易产生的变动数			
其中：基金申购款	1,292,409,594.53	-558,080,681.26	734,328,913.27
基金赎回款	-1,730,249,606.57	733,652,567.90	-996,597,038.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,283,639,862.72	-9,336,550,205.38	12,947,089,657.34

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	100,253.27
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	12,307.90
其他	218.66
合计	112,779.83

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-302,743,915.16
股票投资收益——赎回差价收入	-27,300,507.64
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	-330,044,422.80

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,312,467,659.21
减：卖出股票成本总额	1,611,782,127.86
减：交易费用	3,429,446.51
买卖股票差价收入	-302,743,915.16

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,477,971,222.68
减：现金支付赎回款总额	-60,566,586.32
减：赎回股票成本总额	1,565,838,316.64
减：交易费用	-
赎回差价收入	-27,300,507.64

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	294.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	357,875.25
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	358,169.74

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,895,255.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,537,000.00
减：应计利息总额	303.19
减：交易费用	76.60
买卖债券差价收入	357,875.25

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	188,158,924.81
其中：证券出借权益补偿收入	561,944.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	188,158,924.81

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	883,950,508.40
股票投资	883,950,508.40
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	-
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	883,950,508.40

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	130,701.74
合计	130,701.74

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

审计费用	79,196.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,091.60
合计	139,960.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

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(“华安基金公司”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国泰君安证券股份有限公司	2,745,689,698.04	100.00	2,940,081,855.56	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	3,432,255.04	100.00	14,730,483.62	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	2,597,151.33	100.00	2,597,151.33	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	2,738,119.23	100.00	2,738,119.23	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	47,871,803.80	49,792,068.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	70,520.01	-
应支付基金管理人的净管理费	47,801,283.79	49,792,068.66

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,574,360.78	9,958,413.76

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安	1,301,701,558.00	1,355,742.57	128,045,240.00	63,934.01

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	235,797,869.00	3.40	3.40	354,901.22	3,705,970.00	1,750.04
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	1,666,844,748.00	3.40	3.40	1,838,394.25	158,696,160.00	77,665.82

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

无。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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 (%)
国泰君安证券股份有限公司	3,002,444.00	0.05	2,909,069.00	0.05
中国建设银行股份有限公司—华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金	47,254,125.00	0.81	46,261,625.00	0.78

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国建设银行股份有限公司	99,157,470.69	100,253.27	133,811,737.40	104,507.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
国泰君安证券股份有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85

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（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	1-6 个月（含）	新股限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	1-6 个月（含）	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1-6 个月（含）	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	1-6 个月（含）	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	1-6 个月（含）	新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	1-6 个月（含）	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	1-6 个月（含）	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	1-6个月(含)	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	1-6个月(含)	新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	1-6个月(含)	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	1-6个月(含)	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	1-6个月(含)	新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	600009	上海机场	2024年7月9日-2024年7月9日	32.25	82,500	2,660,625.00
2	600026	中远海能	2024年7月9日-2024年7月9日	15.61	24,600	384,006.00
3	600027	华电国际	2024年7月9日-2024年7月9日	6.94	37,200	258,168.00
4	600089	特变电工	2024年7月9日-2024年7月9日	13.87	6,100	84,607.00
5	600104	上汽集团	2024年7月2日-2024年7月2日	13.86	2,000	27,720.00
6	600111	北方稀土	2024年7月9日-2024年7月9日	17.20	2,000	34,400.00
7	600188	兖矿能源	2024年7月1日-2024年7月9日	22.73	17,000	386,410.00
8	600196	复星医药	2024年7月2日-2024年7月2日	22.14	3,000	66,420.00
9	600298	安琪酵母	2024年7月1日-2024年7月1日	27.93	5,000	139,650.00
10	600415	小商品城	2024年7月1日-2024年7月1日	7.42	38,300	284,186.00
11	600418	江淮汽车	2024年7月1日-2024年7月9日	15.84	59,800	947,232.00
12	600426	华鲁恒升	2024年7月9日-2024年7月9日	26.64	3,000	79,920.00
13	600438	通威股份	2024年7月9日-2024年7月9日	19.11	10,000	191,100.00
14	600460	士兰微	2024年7月9日-2024年7月9日	17.51	36,500	639,115.00
15	600588	用友网络	2024年7月9日-2024年7月9日	10.00	2,000	20,000.00
16	600732	爱旭股份	2024年7月1日-2024年7月9日	9.05	114,000	1,031,700.00
17	600760	中航沈飞	2024年7月9日-2024年7月9日	40.10	3,000	120,300.00
18	600872	中炬高新	2024年7月1日-2024年7月1日	22.69	35,000	794,150.00
19	600895	张江高科	2024年7月1日-2024年7月9日	18.48	37,000	683,760.00
20	600988	赤峰黄	2024年7月1日-2024	16.34	30,000	490,200.00

		金	年 7 月 1 日			0
21	600989	宝丰能源	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	17.33	1,000	17,330.00
22	601012	隆基绿能	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	14.02	20,000	280,400.00
23	601059	信达证券	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	14.21	7,000	99,470.00
24	601100	恒立液压	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	46.58	24,000	1,117,920.00
25	601117	中国化学	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	8.24	124,000	1,021,760.00
26	601136	首创证券	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	20.46	12,000	245,520.00
27	601138	工业富联	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	27.40	39,900	1,093,260.00
28	601186	中国铁建	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	8.57	19,000	162,830.00
29	601238	广汽集团	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	7.74	300	2,322.00
30	601360	三六零	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	7.68	30,000	230,400.00
31	601555	东吴证券	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	5.90	40,000	236,000.00
32	601600	中国铝业	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	7.63	14,000	106,820.00
33	601607	上海医药	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	19.11	7,400	141,414.00
34	601633	长城汽车	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	25.30	105,300	2,664,090.00
35	601696	中银证券	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	9.08	28,000	254,240.00
36	601698	中国卫通	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	14.09	6,000	84,540.00
37	601800	中国交建	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	8.94	36,000	321,840.00
38	601868	中国能建	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	2.12	171,000	362,520.00
39	601872	招商轮船	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	8.45	32,000	270,400.00
40	601995	中金公司	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	29.61	30,000	888,300.00
41	601998	中信银行	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	6.70	4,000	26,800.00
42	603345	安井食	2024 年 7 月 9 日-2024	74.31	4,000	297,240.00

		品	年 7 月 9 日			0
43	603589	口子窖	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	39.19	3,000	117,570.00
44	603596	伯特利	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	38.90	11,200	435,680.00
45	603605	珀莱雅	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	110.99	1,100	122,089.00
46	603606	东方电缆	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	48.81	43,000	2,098,830.00
47	603688	石英股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	29.61	23,500	695,835.00
48	603799	华友钴业	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	22.13	9,000	199,170.00
49	603806	福斯特	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	14.70	78,400	1,152,480.00
50	603939	益丰药房	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	24.55	27,600	677,580.00
51	605117	德业股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	74.34	7,000	520,380.00
52	688036	传音控股	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	76.54	9,800	750,092.00
53	688223	晶科能源	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 1 日	7.10	1,000	7,100.00
54	688271	联影医疗	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	109.70	22,000	2,413,400.00
55	688363	华熙生物	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	56.57	11,000	622,270.00
56	688599	天合光能	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	16.92	114,800	1,942,416.00
合计	-	-	-	-	1,665,300	31,003,977.00

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数。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，追求尽可能贴近目标指数的表现。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合

规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对于借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；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。

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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不

计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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》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。

本基金所持大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，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面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超过经确认的当日净赎回金额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。

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受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时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	99,157,470.69	-	-	-	99,157,470.69
结算备付金	447,439.31	-	-	-	447,439.31
存出保证金	35,205.23	-	-	-	35,205.23
交易性金融资产	-	-	-	-19,098,137,761.50	19,098,137,761.50
应收股利	-	-	-	27,208.80	27,208.80
应收清算款	-	-	-	241,280.89	241,280.89
其他资产	-	-	-	18,169.01	18,169.01
资产总计	99,640,115.23	-	-	-19,098,424,420.20	19,198,064,535.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,954,059.68	7,954,059.68
应付托管费	-	-	-	1,590,811.94	1,590,811.94
应付清算款	-	-	-	50,539.31	50,539.31
其他负债	-	-	-	2,772,531.11	2,772,531.11
负债总计	-	-	-	12,367,942.04	12,367,942.04
利率敏感度缺口	99,640,115.23	-	-	-19,086,056,478.16	19,185,696,593.39
上年度末 2023 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	62,831,969.54	-	-	-	62,831,969.54
结算备付金	69,487.87	-	-	-	69,487.87
存出保证金	90,717.94	-	-	-	90,717.94
交易性金融资产	-	-	-	-18,832,187,124.85	18,832,187,124.85
应收股利	-	-	-	40,800.00	40,800.00
其他资产	-	-	-	268,848.65	268,848.65
资产总计	62,992,175.35	-	-	-18,832,496,773.50	18,895,488,948.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,888,626.04	7,888,626.04
应付托管费	-	-	-	1,577,725.20	1,577,725.20
应付清算款	-	-	-	1,606,293.43	1,606,293.43
其他负债	-	-	-	2,872,062.32	2,872,062.32
负债总计	-	-	-	13,944,706.99	13,944,706.99
利率敏感度缺口	62,992,175.35	-	-	-18,818,552,066.51	18,881,544,241.86

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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2023 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 (2023 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，上证 180 指数成份股和备选成份股股票 (含存托凭证) 投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股 (含存托凭证)、债券及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	19,098,137,761.50	99.54	18,832,187,124.85	99.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

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	19,098,137,761.50	99.54	18,832,187,124.85	99.74

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	954,572,429.04	939,429,405.97
	业绩比较基准下降5%	-954,572,429.04	-939,429,405.97

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	19,097,958,181.13	18,829,331,198.11
第二层次	45,611.11	-

第三层次	133,969.26	2,855,926.74
合计	19,098,137,761.50	18,832,187,124.85

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。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	19,098,137,761.50	99.48
	其中：股票	19,098,137,761.50	99.48
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	99,604,910.00	0.52
8	其他各项资产	321,863.93	0.00
9	合计	19,198,064,535.43	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,772,860,021.81	9.24
C	制造业	7,721,120,215.27	40.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,208,485,121.62	6.30
E	建筑业	633,082,289.95	3.30
F	批发和零售业	60,653,522.37	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	701,109,375.25	3.65
H	住宿和餐饮业	17,694,600.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	999,574,388.24	5.21
J	金融业	5,530,197,434.87	28.82
K	房地产业	129,766,105.20	0.68
L	租赁和商务服务业	136,790,787.32	0.71
M	科学研究和技术服务业	166,303,627.18	0.87
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	20,320,692.05	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,097,958,181.13	99.54

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	112,521.67	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	179,580.37	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,055,268	1,548,489,710.52	8.07
2	601318	中国平安	18,082,597	747,896,211.92	3.90
3	600036	招商银行	20,798,425	711,098,150.75	3.71
4	600900	长江电力	20,559,763	594,588,345.96	3.10
5	601899	紫金矿业	27,672,410	486,204,243.70	2.53
6	601166	兴业银行	24,431,495	430,482,941.90	2.24
7	601328	交通银行	46,153,614	344,767,496.58	1.80

8	601398	工商银行	58,880,628	335,619,579.60	1.75
9	600030	中信证券	16,399,863	298,969,502.49	1.56
10	600276	恒瑞医药	7,505,024	288,643,223.04	1.50
11	600887	伊利股份	10,695,324	276,367,172.16	1.44
12	600309	万华化学	3,165,300	255,946,158.00	1.33
13	601088	中国神华	5,541,764	245,888,068.68	1.28
14	601288	农业银行	53,617,515	233,772,365.40	1.22
15	601816	京沪高铁	41,244,476	221,482,836.12	1.15
16	601857	中国石油	19,043,798	196,531,995.36	1.02
17	601668	中国建筑	34,959,730	185,636,166.30	0.97
18	600919	江苏银行	24,667,694	183,280,966.42	0.96
19	601138	工业富联	6,674,900	182,892,260.00	0.95
20	600690	海尔智家	6,360,836	180,520,525.68	0.94
21	600809	山西汾酒	820,200	172,963,776.00	0.90
22	601985	中国核电	15,862,834	169,097,810.44	0.88
23	600406	国电南瑞	6,744,702	168,347,761.92	0.88
24	601225	陕西煤业	6,517,935	167,967,184.95	0.88
25	603259	药明康德	4,243,522	166,303,627.18	0.87
26	601919	中远海控	10,725,354	166,135,733.46	0.87
27	600031	三一重工	9,984,067	164,737,105.50	0.86
28	601988	中国银行	35,401,333	163,554,158.46	0.85
29	600941	中国移动	1,517,700	163,152,750.00	0.85
30	600000	浦发银行	19,729,030	162,369,916.90	0.85
31	601728	中国电信	26,099,843	160,514,034.45	0.84
32	601601	中国太保	5,752,519	160,265,179.34	0.84
33	600028	中国石化	24,539,891	155,092,111.12	0.81
34	601766	中国中车	20,435,300	153,469,103.00	0.80
35	600150	中国船舶	3,758,797	153,020,625.87	0.80
36	688981	中芯国际	3,315,794	152,858,103.40	0.80
37	600050	中国联通	32,038,837	150,582,533.90	0.78
38	601169	北京银行	24,865,233	145,212,960.72	0.76
39	601012	隆基绿能	10,185,994	142,807,635.88	0.74
40	603501	韦尔股份	1,430,996	142,198,072.52	0.74
41	600837	海通证券	16,227,372	138,906,304.32	0.72
42	600016	民生银行	35,742,637	135,464,594.23	0.71
43	600660	福耀玻璃	2,691,783	128,936,405.70	0.67
44	600089	特变电工	8,483,550	117,666,838.50	0.61
45	600938	中国海油	3,518,425	116,108,025.00	0.61
46	601390	中国中铁	17,261,840	112,547,196.80	0.59
47	688041	海光信息	1,560,781	109,754,119.92	0.57
48	600104	上汽集团	7,786,498	107,920,862.28	0.56
49	603986	兆易创新	1,121,064	107,196,139.68	0.56
50	601688	华泰证券	8,601,407	106,571,432.73	0.56

51	600048	保利发展	12,065,962	105,697,827.12	0.55
52	601006	大秦铁路	14,740,310	105,540,619.60	0.55
53	600436	片仔癀	506,306	104,891,414.02	0.55
54	600905	三峡能源	24,055,563	104,882,254.68	0.55
55	688012	中微公司	728,747	102,942,801.22	0.54
56	601211	国泰君安	7,576,480	102,661,304.00	0.54
57	601888	中国中免	1,640,868	102,537,841.32	0.53
58	603019	中科曙光	2,460,261	102,100,831.50	0.53
59	601600	中国铝业	13,324,900	101,668,987.00	0.53
60	603993	洛阳钼业	11,878,220	100,964,870.00	0.53
61	601818	光大银行	31,176,376	98,829,111.92	0.52
62	600019	宝钢股份	14,861,281	98,827,518.65	0.52
63	603288	海天味业	2,801,422	96,565,016.34	0.50
64	600585	海螺水泥	4,031,398	95,100,678.82	0.50
65	601658	邮储银行	18,658,800	94,600,116.00	0.49
66	601989	中国重工	19,149,821	94,408,617.53	0.49
67	600886	国投电力	5,011,200	91,404,288.00	0.48
68	600795	国电电力	14,973,500	89,691,265.00	0.47
69	688111	金山办公	388,487	88,380,792.50	0.46
70	688008	澜起科技	1,532,554	87,600,786.64	0.46
71	601628	中国人寿	2,797,797	86,871,596.85	0.45
72	600438	通威股份	4,542,250	86,802,397.50	0.45
73	600999	招商证券	6,238,340	86,775,309.40	0.45
74	601939	建设银行	11,288,772	83,536,912.80	0.44
75	600547	山东黄金	3,038,345	83,189,886.10	0.43
76	600893	航发动力	2,238,095	81,802,372.25	0.43
77	601669	中国电建	14,464,459	80,856,325.81	0.42
78	600584	长电科技	2,404,000	76,230,840.00	0.40
79	600760	中航沈飞	1,853,431	74,322,583.10	0.39
80	600111	北方稀土	4,253,007	73,151,720.40	0.38
81	600489	中金黄金	4,883,048	72,269,110.40	0.38
82	600011	华能国际	7,381,881	71,013,695.22	0.37
83	601916	浙商银行	25,348,000	69,960,480.00	0.36
84	688256	寒武纪	350,218	69,577,810.06	0.36
85	600009	上海机场	2,091,775	67,459,743.75	0.35
86	600958	东方证券	8,791,355	66,814,298.00	0.35
87	600426	华鲁恒升	2,498,998	66,573,306.72	0.35
88	601186	中国铁建	7,740,774	66,338,433.18	0.35
89	601901	方正证券	8,290,700	64,087,111.00	0.33
90	600989	宝丰能源	3,694,149	64,019,602.17	0.33
91	601058	赛轮轮胎	4,421,600	61,902,400.00	0.32
92	688271	联影医疗	554,306	60,807,368.20	0.32
93	688169	石头科技	154,839	60,789,791.40	0.32

94	601377	兴业证券	11,592,237	58,656,719.22	0.31
95	688036	传音控股	760,006	58,170,859.24	0.30
96	601111	中国国航	7,821,664	57,723,880.32	0.30
97	600160	巨化股份	2,264,000	54,630,320.00	0.28
98	601800	中国交建	5,986,844	53,522,385.36	0.28
99	600010	包钢股份	38,085,789	53,320,104.60	0.28
100	601633	长城汽车	2,093,222	52,958,516.60	0.28
101	600188	兖矿能源	2,312,750	52,568,807.50	0.27
102	601117	中国化学	6,167,100	50,816,904.00	0.26
103	603799	华友钴业	2,282,480	50,511,282.40	0.26
104	601168	西部矿业	2,807,100	50,387,445.00	0.26
105	600346	恒力石化	3,542,049	49,411,583.55	0.26
106	600372	中航机载	4,071,285	48,733,281.45	0.25
107	603369	今世缘	1,053,172	48,656,546.40	0.25
108	600023	浙能电力	6,766,912	48,112,744.32	0.25
109	601788	光大证券	3,279,829	47,951,099.98	0.25
110	688223	晶科能源	6,729,768	47,781,352.80	0.25
111	600196	复星医药	2,133,911	47,244,789.54	0.25
112	600418	江淮汽车	2,930,488	46,418,929.92	0.24
113	601872	招商轮船	5,482,620	46,328,139.00	0.24
114	601868	中国能建	21,767,500	46,147,100.00	0.24
115	601360	三六零	6,003,531	46,107,118.08	0.24
116	600988	赤峰黄金	2,796,100	45,688,274.00	0.24
117	600570	恒生电子	2,545,411	44,951,958.26	0.23
118	600176	中国巨石	4,043,693	44,682,807.65	0.23
119	600085	同仁堂	1,154,300	44,105,803.00	0.23
120	601995	中金公司	1,475,500	43,689,555.00	0.23
121	605499	东鹏饮料	201,700	43,516,775.00	0.23
122	600600	青岛啤酒	595,650	43,345,450.50	0.23
123	601336	新华保险	1,402,288	42,110,708.64	0.22
124	603392	万泰生物	639,144	42,106,806.72	0.22
125	601100	恒立液压	900,923	41,964,993.34	0.22
126	601689	拓普集团	782,600	41,955,186.00	0.22
127	601066	中信建投	2,179,524	41,934,041.76	0.22
128	600096	云天化	2,153,200	41,815,144.00	0.22
129	600745	闻泰科技	1,463,315	41,338,648.75	0.22
130	600362	江西铜业	1,744,400	41,307,392.00	0.22
131	688777	中控技术	1,061,987	40,036,909.90	0.21
132	600027	华电国际	5,719,700	39,694,718.00	0.21
133	601881	中国银河	3,654,777	39,690,878.22	0.21
134	601555	东吴证券	6,691,000	39,476,900.00	0.21
135	601618	中国中冶	12,005,735	37,217,778.50	0.19
136	603605	珀莱雅	333,340	36,997,406.60	0.19

137	600026	中远海能	2,334,300	36,438,423.00	0.19
138	600482	中国动力	1,841,221	35,866,985.08	0.19
139	601607	上海医药	1,868,287	35,702,964.57	0.19
140	600765	中航重机	1,741,615	35,528,946.00	0.19
141	601878	浙商证券	3,255,540	34,899,388.80	0.18
142	600332	白云山	1,178,400	34,562,472.00	0.18
143	600875	东方电气	1,870,900	34,518,105.00	0.18
144	601998	中信银行	5,149,216	34,499,747.20	0.18
145	600588	用友网络	3,446,139	34,461,390.00	0.18
146	600415	小商品城	4,616,300	34,252,946.00	0.18
147	603606	东方电缆	692,771	33,814,152.51	0.18
148	688599	天合光能	1,831,103	30,982,262.76	0.16
149	605117	德业股份	404,232	30,050,606.88	0.16
150	600460	士兰微	1,674,703	29,324,049.53	0.15
151	601238	广汽集团	3,713,696	28,744,007.04	0.15
152	600298	安琪酵母	1,018,826	28,455,810.18	0.15
153	688072	拓荆科技	233,293	28,020,822.23	0.15
154	600839	四川长虹	6,208,700	27,877,063.00	0.15
155	603596	伯特利	713,980	27,773,822.00	0.14
156	601319	中国人保	5,355,000	27,578,250.00	0.14
157	688180	君实生物	898,344	26,096,893.20	0.14
158	603806	福斯特	1,755,118	25,800,234.60	0.13
159	603345	安井食品	344,300	25,584,933.00	0.13
160	603659	璞泰来	1,798,903	25,418,499.39	0.13
161	601696	中银证券	2,791,504	25,346,856.32	0.13
162	603939	益丰药房	1,016,316	24,950,557.80	0.13
163	600132	重庆啤酒	406,528	24,676,249.60	0.13
164	600895	张江高科	1,302,396	24,068,278.08	0.13
165	600872	中炬高新	1,057,547	23,995,741.43	0.13
166	603589	口子窖	606,245	23,758,741.55	0.12
167	603087	甘李药业	506,700	23,470,344.00	0.12
168	601059	信达证券	1,637,600	23,270,296.00	0.12
169	600118	中国卫星	991,900	22,049,937.00	0.11
170	600763	通策医疗	375,961	20,320,692.05	0.11
171	600129	太极集团	654,400	18,925,248.00	0.10
172	601136	首创证券	915,200	18,724,992.00	0.10
173	603000	人民网	925,200	18,494,748.00	0.10
174	688363	华熙生物	323,112	18,278,445.84	0.10
175	600754	锦江酒店	770,000	17,694,600.00	0.09
176	603290	斯达半导	200,120	17,232,333.20	0.09
177	600732	爱旭股份	1,835,420	16,610,551.00	0.09
178	601698	中国卫通	1,062,213	14,966,581.17	0.08
179	603688	石英股份	456,250	13,509,562.50	0.07

180	600779	水井坊	327,466	12,322,545.58	0.06
-----	--------	-----	---------	---------------	------

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
4	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
5	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
6	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
7	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
8	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
9	688695	C中创	186	5,868.30	0.00
10	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
11	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
12	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
13	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
14	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
15	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600900	长江电力	106,743,453.50	0.57
2	601006	大秦铁路	106,373,171.30	0.56
3	600886	国投电力	91,276,716.00	0.48
4	601916	浙商银行	73,002,556.20	0.39
5	601901	方正证券	68,537,363.00	0.36
6	601058	赛轮轮胎	63,773,896.00	0.34
7	688169	石头科技	63,616,904.42	0.34
8	601998	中信银行	62,316,178.27	0.33
9	601168	西部矿业	60,577,122.00	0.32
10	600372	中航机载	50,006,675.66	0.26
11	600023	浙能电力	46,881,858.20	0.25
12	688777	中控技术	46,793,852.22	0.25
13	605499	东鹏饮料	45,903,009.00	0.24
14	600362	江西铜业	42,725,961.00	0.23
15	600482	中国动力	35,349,759.35	0.19
16	688072	拓荆科技	33,224,981.49	0.18
17	603259	药明康德	32,022,726.00	0.17

18	600839	四川长虹	29,674,749.00	0.16
19	688223	晶科能源	28,960,037.27	0.15
20	603087	甘李药业	24,379,643.28	0.13

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	600519	贵州茅台	62,850,815.00	0.33
2	600919	江苏银行	56,214,490.60	0.30
3	600028	中国石化	53,482,007.00	0.28
4	601998	中信银行	52,927,608.00	0.28
5	601877	正泰电器	37,698,697.18	0.20
6	688122	西部超导	33,117,626.87	0.18
7	601615	明阳智能	32,358,250.00	0.17
8	601318	中国平安	30,197,446.03	0.16
9	603260	合盛硅业	29,456,942.00	0.16
10	600016	民生银行	28,673,958.00	0.15
11	600036	招商银行	27,870,287.01	0.15
12	688303	大全能源	27,353,079.33	0.14
13	600521	华海药业	27,094,763.50	0.14
14	600021	上海电力	25,277,772.10	0.13
15	605358	立昂微	23,056,622.28	0.12
16	688036	传音控股	20,743,539.39	0.11
17	603833	欧派家居	20,462,494.00	0.11
18	688271	联影医疗	20,408,796.16	0.11
19	688390	固德威	20,173,069.52	0.11
20	603486	科沃斯	19,669,685.30	0.10

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	1,434,402,192.42
卖出股票收入（成交）总额	1,312,467,659.21

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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚；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外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局的处罚；交通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规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,205.23
2	应收清算款	241,280.89

3	应收股利	27,208.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	18,169.01
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,863.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股限售
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
3	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
4	601033	永兴股份	20,077.68	0.00	新股限售
5	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股限售

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
16,157	359,754.76	5,577,582,660.00	95.96	234,975,019.00	4.04

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.1.2 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 (%)
----	----------	------------

中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	47,254,125.00	0.81
--	---------------	------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中央汇金投资有限责任公司	5,231,571,046.00	90.00
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	116,256,700.00	2.00
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	77,029,700.00	1.33
4	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	28,490,000.00	0.49
5	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	22,103,600.00	0.38
6	三菱日联资产管理公司—MAXIS 华安中国股票（上证 180 指数）ETF	10,472,414.00	0.18
7	孙晓燕	7,150,000.00	0.12
8	中信建投证券股份有限公司	6,786,929.00	0.12
9	方正证券股份有限公司	6,326,444.00	0.11
10	李清	4,835,000.00	0.08
11	中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	47,254,125.00	0.81

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 4 月 13 日） 基金份额总额	1,072,822,105.00
本报告期期初基金份额总额	5,926,057,679.00
本报告期基金总申购份额	335,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	448,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,812,557,679.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2024 年 7 月 15 日起至 2024 年 7 月 30 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过《关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》，决议自 2024 年 7 月 31 日起生效，并按规定向中国证券监督管理委员会备案。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2024 年 8 月 1 日发布的《关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	4	2,745,689,698.04	100.00	2,597,151.33	100.00	-
招商证券	1	39,221.00	0.00	29.26	0.00	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，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) 研究服务能力较强，有较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，能够针对本基金投资运作管理需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

(3) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的尽职调查

由相关部门牵头依据上述交易单元选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调查。

(2) 完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

(3) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交

易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(4) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(5) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	3,432,255.04	100.00	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	上证 180ETF2023 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指定媒介	2024 年 1 月 19 日
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（龙旗科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 24 日
3	上证 180ETF 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指定媒介	2024 年 3 月 1 日
4	上证 180ETF 更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 1 日
5	华安基金管理有限公司关于副总统	中国证监会基金电子披	2024 年 3 月 12 日

	理任职的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
6	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 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指定媒介	2024 年 3 月 27 日
8	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指定媒介	2024 年 4 月 19 日
9	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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指定媒介	2024 年 4 月 22 日
10	华安上证 180ETF2024 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指定媒介	2024 年 4 月 22 日
11	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储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指定媒介	2024 年 6 月 7 日
12	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加爱建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指定媒介	2024 年 6 月 21 日
13	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 26 日
14	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 27 日
15	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 日
16	华安上证 180ETF 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指定媒介	2024 年 6 月 28 日
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（键邦股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 29 日
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（永兴股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 12 日
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（北自科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 24 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101~20240630	5,231,571,046.00	0.00	0.00	5,231,571,046.00	90.00
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准上证 180 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

2024 年 8 月 31 日