

华安沪深 300 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
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 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
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 .....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
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 .....	47
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 .....	47

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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 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 指数基金)
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	414,683,016.00 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
	联系电话	021-38969999
	电子邮箱	service@huaan.com.cn
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	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	-2,270,291.67
本期利润	10,713,071.31
加权平均基金份额本期利润	0.0275
本期加权平均净值利润率	2.85%
本期基金份额净值增长率	1.75%
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	-14,422,668.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0348
期末基金资产净值	400,260,347.80
期末基金份额净值	0.9652
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	-3.48%

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）。

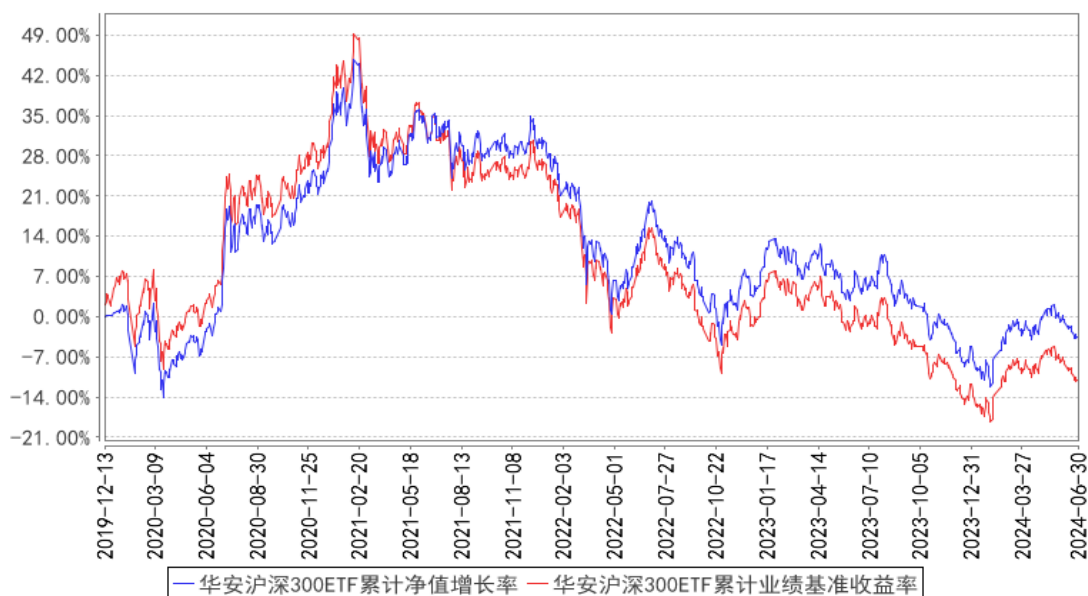
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-2.64%	0.47%	-3.30%	0.48%	0.66%	-0.01%
过去三个月	-1.19%	0.75%	-2.14%	0.76%	0.95%	-0.01%
过去六个月	1.75%	0.89%	0.89%	0.90%	0.86%	-0.01%
过去一年	-8.18%	0.87%	-9.91%	0.87%	1.73%	0.00%
过去三年	-28.41%	1.04%	-33.74%	1.05%	5.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-3.48%	1.15%	-11.03%	1.17%	7.55%	-0.02%

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

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		
顾昕	本基金的基金经理	2024 年 6 月 17 日	-	7 年	硕士研究生，7 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及其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。
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	2019 年 12 月 13 日	2024 年 6 月 17 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



				<p>安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金(由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来)、华安中证银行指数型证券投资基金(由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来)的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金(由华安创业板 50 指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来)的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起,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。

## 4.2 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，宏观经济平稳复苏，但整体动能偏缓。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。多种因素影响之下，A 股市场在今年上半年走势较为震荡，呈现出明显的结构性行情。指数之间分化显著，大盘价值类指数表现较为稳健，其权重行业银行是上半年领涨的行业，亦是不确定较强的市场中资金确定性的配置方向。

沪深 300 指数报告期内上涨 0.89%，本基金上涨 1.75%，跑赢同期业绩比较基准，超额主要得益于报告期内成份股的分红。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9652 元，本报告期份额净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准增长率为 0.89%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济转弱趋势已现，近期我们也观察到部分资产的一致预期被打破，海外股市出现大幅波动。在此背景之下，全球资金再配置或成为资本市场主旋律，而 A 股当前处于低估值区间，股权风险溢价来到历史极值位置，或吸引增量资金参与长期配置，以提升估值中枢。

沪深 300 指数作为最重要的基准宽基指数，是 A 股市场的稳定器，亦是国内核心资产的代表，配置价值突出。

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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度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

本年度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：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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	10,674,710.68	5,883,677.95
结算备付金		2,282,221.41	2,038,368.98
存出保证金		913,911.56	944,933.92
交易性金融资产	6.4.7.2	387,580,440.03	347,323,074.32
其中：股票投资		387,580,440.03	347,323,074.32
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		-	15,810,599.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	3.00
资产总计		401,451,283.68	372,000,657.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		673,293.22	14,498,831.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,250.75	36,568.02
应付托管费		15,750.24	12,189.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,267.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	444,373.77	2,024,697.23
负债合计		1,190,935.88	16,572,286.21
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	414,683,016.00	374,683,016.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-14,422,668.20	-19,254,645.04
净资产合计		400,260,347.80	355,428,370.96
负债和净资产总计		401,451,283.68	372,000,657.17

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9652 元，基金份额总额 414,683,016.00 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：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
<b>一、营业总收入</b>		11,249,646.61	6,572,839.59
1. 利息收入		31,952.07	47,708.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,952.07	47,708.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,882,918.08	-9,609,644.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,339,137.15	-12,137,481.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	11,049.56
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	305,213.12	95,997.83
股利收益	6.4.7.13	4,151,005.95	2,420,788.99
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	12,983,362.98	15,791,144.86
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	117,249.64	343,631.61
<b>减：二、营业总支出</b>		536,575.30	393,386.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	280,831.58	173,247.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	93,610.53	57,749.11
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		1,100.13	1,161.83
8. 其他费用	6.4.7.17	161,033.06	161,228.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,713,071.31	6,179,453.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,713,071.31	6,179,453.34
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		10,713,071.31	6,179,453.34

### 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：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	374,683,016.00	-	-19,254,645.04	355,428,370.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	374,683,016.00	-	-19,254,645.04	355,428,370.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	40,000,000.00	-	4,831,976.84	44,831,976.84
(一)、综合收益总额	-	-	10,713,071.31	10,713,071.31
(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)	40,000,000.00	-	-5,881,094.47	34,118,905.53
其中：1. 基金申购款	196,000,000.00	-	-9,934,068.13	186,065,931.87
2. 基金赎回款	-	-	4,052,973.66	-151,947,026.34
(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	414,683,016.00	-	-14,422,668.20	400,260,347.80
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	286,683,016.00	-	13,871,218.70	300,554,234.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	286,683,016.00	-	13,871,218.70	300,554,234.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,000,000.00	-	-2,465,200.51	-66,465,200.51
(一)、综合收益总额	-	-	6,179,453.34	6,179,453.34
(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)	-64,000,000.00	-	-8,644,653.85	-72,644,653.85
其中：1. 基金申购款	120,000,000.00	-	8,680,878.79	128,680,878.79
2. 基金赎回款	-	-	-17,325,532.64	-201,325,532.64
184,000,000.00				
(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	222,683,016.00	-	11,406,018.19	234,089,034.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

朱学华

陈松一

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安沪深 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]第 1823 号《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》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《华安沪深 300 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 442,683,016.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0677 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 442,683,016.00 份基金份额,无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]309 号文核准同意,本基金 442,683,016.00 份基金份额于 2020 年 1 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为沪深 300 指数,投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金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。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不得低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华安沪深 300ETF 联接基金”)。华安沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金，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》、《华安沪深 300 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	10,674,710.68
等于：本金	10,673,716.26
加：应计利息	994.42
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	10,674,710.68

##### 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	403,238,449.44	-	387,580,440.03	-15,658,009.41
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	403,238,449.44	-	387,580,440.03	-15,658,009.41

### 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 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,341,600.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	7,341,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,341,600.00	-	-	-

#### 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/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2412	IF2412	7.00	7,186,200.00	-155,400.00
合计				-155,400.00
减：可抵销期货暂收款				-155,400.00
净额				-

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	158,009.36
其中：交易所市场	158,009.36
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	70,000.00
应退替代款	126,856.81
预提费用	89,507.60
合计	444,373.77

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	374,683,016.00	374,683,016.00
本期申购	196,000,000.00	196,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-156,000,000.00	-156,000,000.00
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	414,683,016.00	414,683,016.00

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,025,727.03	-43,280,372.07	-19,254,645.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	24,025,727.03	-43,280,372.07	-19,254,645.04
本期利润	-2,270,291.67	12,983,362.98	10,713,071.31
本期基金份额交易产生的变动数	2,608,961.32	-8,490,055.79	-5,881,094.47
其中：基金申购款	10,854,528.44	-20,788,596.57	-9,934,068.13
基金赎回款	-8,245,567.12	12,298,540.78	4,052,973.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,364,396.68	-38,787,064.88	-14,422,668.20

#### 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	11,708.68
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	19,825.24
其他	418.15
合计	31,952.07

#### 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	-6,481,597.09
股票投资收益——赎回差价收入	142,459.94
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	-6,339,137.15

##### 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	76,841,481.79
减：卖出股票成本总额	83,115,842.44
减：交易费用	207,236.44
买卖股票差价收入	-6,481,597.09

#### 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	151,947,026.34
减：现金支付赎回款总额	54,686,681.34
减：赎回股票成本总额	97,117,885.06
减：交易费用	-
赎回差价收入	142,459.94

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	305,213.12

#### 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	4,151,005.95
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	4,151,005.95

## 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	13,298,542.98
股票投资	13,298,542.98
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	-315,180.00
权证投资	-
期货投资	-315,180.00
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	12,983,362.98

## 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	117,249.64
合计	117,249.64

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,525.46
指数使用费	70,000.00
合计	161,033.06

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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
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：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	7,795,577.03	4.63	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	7,295.78	4.62	7,295.78	4.62
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 (%)
-	-	-	-	-

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 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管理费	280,831.58	173,247.27
其中：应支付销售机构的客户维护 费	7,440.67	-
应支付基金管理人的净管理费	273,390.91	173,247.27

注：付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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	93,610.53	57,749.11

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

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自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	16,103,907.00	3.88	49,204,774.00	13.13
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	123,831,700.00	29.86	111,159,300.00	29.67

#### 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
招商银行股份有限公司	10,674,710.68	11,708.68	9,585,234.28	15,640.05

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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
-	-	-	-	-	-
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	127085	韵达转债	老股东配售	134	13,400.00
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
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
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13

#### 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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、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招商银行，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，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。

### 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
<b>资产</b>					
货币资金	10,674,710.68	-	-	-	10,674,710.68
结算备付金	2,282,221.41	-	-	-	2,282,221.41
存出保证金	44,381.36	-	-	869,530.20	913,911.56
交易性金融资产	-	-	-	-387,580,440.03	387,580,440.03
资产总计	13,001,313.45	-	-	-388,449,970.23	401,451,283.68
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	47,250.75	47,250.75
应付托管费	-	-	-	15,750.24	15,750.24
应付清算款	-	-	-	673,293.22	673,293.22
应交税费	-	-	-	10,267.90	10,267.90
其他负债	-	-	-	444,373.77	444,373.77
负债总计	-	-	-	1,190,935.88	1,190,935.88
利率敏感度缺口	13,001,313.45	-	-	-387,259,034.35	400,260,347.80
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
<b>资产</b>					
货币资金	5,883,677.95	-	-	-	5,883,677.95
结算备付金	2,038,368.98	-	-	-	2,038,368.98
存出保证金	67,475.80	-	-	877,458.12	944,933.92
交易性金融资产	-	-	-	-347,323,074.32	347,323,074.32
应收清算款	-	-	-	15,810,599.00	15,810,599.00
其他资产	-	-	-	3.00	3.00
资产总计	7,989,522.73	-	-	-364,011,134.44	372,000,657.17
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	36,568.02	36,568.02
应付托管费	-	-	-	12,189.34	12,189.34

应付清算款	-	-	-	14,498,831.62	14,498,831.62
其他负债	-	-	-	2,024,697.23	2,024,697.23
负债总计	-	-	-	16,572,286.21	16,572,286.21
利率敏感度缺口	7,989,522.73	-	-	-347,438,848.23	355,428,370.96

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，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%，权证、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。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	387,580,440.03	96.83	347,323,074.32	97.72
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	387,580,440.03	96.83	347,323,074.32	97.72

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。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(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%	19,849,618.48	17,643,003.87
业绩比较基准下降5%	-19,849,618.48	-17,643,003.87	

#### 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	387,580,440.03	347,323,074.32
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	387,580,440.03	347,323,074.32

##### 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	387,580,440.03	96.54

	其中：股票	387,580,440.03	96.54
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	12,956,932.09	3.23
8	其他各项资产	913,911.56	0.23
9	合计	401,451,283.68	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	4,900,815.46	1.22
B	采矿业	23,612,372.60	5.90
C	制造业	201,843,732.44	50.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,194,585.00	4.55
E	建筑业	8,675,223.20	2.17
F	批发和零售业	995,544.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	14,522,910.98	3.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,503,094.22	4.37
J	金融业	86,529,682.76	21.62
K	房地产业	3,569,292.01	0.89
L	租赁和商务服务业	3,112,331.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	3,070,713.80	0.77
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	1,050,142.56	0.26

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	387,580,440.03	96.83

### 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	600519	贵州茅台	13,700	20,103,243.00	5.02
2	300750	宁德时代	57,671	10,382,510.13	2.59
3	601318	中国平安	234,898	9,715,381.28	2.43
4	600036	招商银行	270,128	9,235,676.32	2.31
5	600900	长江电力	267,000	7,721,640.00	1.93
6	000333	美的集团	106,577	6,874,216.50	1.72
7	601899	紫金矿业	359,500	6,316,415.00	1.58
8	601166	兴业银行	317,400	5,592,588.00	1.40
9	000858	五粮液	42,400	5,428,896.00	1.36
10	002594	比亚迪	19,700	4,929,925.00	1.23
11	601328	交通银行	600,000	4,482,000.00	1.12
12	601398	工商银行	764,800	4,359,360.00	1.09
13	002475	立讯精密	109,759	4,314,626.29	1.08
14	600030	中信证券	212,950	3,882,078.50	0.97
15	000651	格力电器	98,300	3,855,326.00	0.96
16	300760	迈瑞医疗	13,200	3,840,012.00	0.96
17	600276	恒瑞医药	97,550	3,751,773.00	0.94
18	600887	伊利股份	139,000	3,591,760.00	0.90
19	600309	万华化学	41,086	3,322,213.96	0.83
20	000725	京东方 A	806,400	3,298,176.00	0.82
21	601088	中国神华	71,980	3,193,752.60	0.80
22	601288	农业银行	696,900	3,038,484.00	0.76
23	300059	东方财富	275,702	2,911,413.12	0.73
24	601816	京沪高铁	535,700	2,876,709.00	0.72
25	300308	中际旭创	19,560	2,696,932.80	0.67
26	002714	牧原股份	59,616	2,599,257.60	0.65
27	601857	中国石油	247,300	2,552,136.00	0.64

28	002415	海康威视	81,400	2,516,074.00	0.63
29	601668	中国建筑	454,200	2,411,802.00	0.60
30	600919	江苏银行	320,240	2,379,383.20	0.59
31	601138	工业富联	86,700	2,375,580.00	0.59
32	600690	海尔智家	82,600	2,344,188.00	0.59
33	000568	泸州老窖	16,142	2,316,215.58	0.58
34	300498	温氏股份	116,123	2,301,557.86	0.58
35	002371	北方华创	7,000	2,239,230.00	0.56
36	600809	山西汾酒	10,600	2,235,328.00	0.56
37	601985	中国核电	206,000	2,195,960.00	0.55
38	600406	国电南瑞	87,551	2,185,272.96	0.55
39	601225	陕西煤业	84,700	2,182,719.00	0.55
40	603259	药明康德	55,120	2,160,152.80	0.54
41	601919	中远海控	139,152	2,155,464.48	0.54
42	000001	平安银行	211,700	2,148,755.00	0.54
43	600031	三一重工	129,800	2,141,700.00	0.54
44	601988	中国银行	460,200	2,126,124.00	0.53
45	600941	中国移动	19,700	2,117,750.00	0.53
46	600000	浦发银行	256,205	2,108,567.15	0.53
47	300124	汇川技术	40,900	2,098,170.00	0.52
48	601601	中国太保	74,800	2,083,928.00	0.52
49	601728	中国电信	338,600	2,082,390.00	0.52
50	000792	盐湖股份	118,700	2,071,315.00	0.52
51	600028	中国石化	318,700	2,014,184.00	0.50
52	601766	中国中车	265,400	1,993,154.00	0.50
53	600150	中国船舶	48,800	1,986,648.00	0.50
54	688981	中芯国际	42,991	1,981,885.10	0.50
55	300274	阳光电源	31,720	1,967,591.60	0.49
56	600050	中国联通	416,800	1,958,960.00	0.49
57	000063	中兴通讯	69,500	1,943,915.00	0.49
58	000338	潍柴动力	118,400	1,922,816.00	0.48
59	002352	顺丰控股	53,450	1,907,630.50	0.48
60	601169	北京银行	323,100	1,886,904.00	0.47
61	601012	隆基绿能	132,172	1,853,051.44	0.46
62	603501	韦尔股份	18,638	1,852,058.06	0.46
63	600837	海通证券	211,000	1,806,160.00	0.45
64	000100	TCL 科技	410,090	1,771,588.80	0.44
65	600016	民生银行	464,600	1,760,834.00	0.44
66	002230	科大讯飞	40,400	1,735,180.00	0.43
67	600660	福耀玻璃	34,900	1,671,710.00	0.42
68	002142	宁波银行	71,960	1,587,437.60	0.40
69	601229	上海银行	217,100	1,576,146.00	0.39
70	600089	特变电工	110,330	1,530,277.10	0.38

71	600938	中国海油	45,700	1,508,100.00	0.38
72	601390	中国中铁	223,900	1,459,828.00	0.36
73	000625	长安汽车	108,390	1,455,677.70	0.36
74	688041	海光信息	20,231	1,422,643.92	0.36
75	600104	上汽集团	101,200	1,402,632.00	0.35
76	603986	兆易创新	14,544	1,390,697.28	0.35
77	601688	华泰证券	111,700	1,383,963.00	0.35
78	600048	保利发展	156,800	1,373,568.00	0.34
79	601006	大秦铁路	191,600	1,371,856.00	0.34
80	600436	片仔癀	6,600	1,367,322.00	0.34
81	600905	三峡能源	312,400	1,362,064.00	0.34
82	688012	中微公司	9,477	1,338,721.02	0.33
83	002027	分众传媒	220,600	1,336,836.00	0.33
84	601211	国泰君安	98,500	1,334,675.00	0.33
85	601888	中国中免	21,300	1,331,037.00	0.33
86	603019	中科曙光	31,980	1,327,170.00	0.33
87	601600	中国铝业	173,000	1,319,990.00	0.33
88	603993	洛阳钼业	154,300	1,311,550.00	0.33
89	600019	宝钢股份	193,200	1,284,780.00	0.32
90	601818	光大银行	404,700	1,282,899.00	0.32
91	603288	海天味业	36,492	1,257,879.24	0.31
92	600585	海螺水泥	52,300	1,233,757.00	0.31
93	601658	邮储银行	242,500	1,229,475.00	0.31
94	601989	中国重工	249,100	1,228,063.00	0.31
95	600886	国投电力	65,200	1,189,248.00	0.30
96	601009	南京银行	112,700	1,170,953.00	0.29
97	600795	国电电力	194,900	1,167,451.00	0.29
98	688111	金山办公	5,037	1,145,917.50	0.29
99	688008	澜起科技	19,862	1,135,311.92	0.28
100	601628	中国人寿	36,400	1,130,220.00	0.28
101	600438	通威股份	59,000	1,127,490.00	0.28
102	600999	招商证券	80,990	1,126,570.90	0.28
103	000938	紫光股份	49,940	1,116,159.00	0.28
104	000425	徐工机械	154,810	1,106,891.50	0.28
105	601939	建设银行	146,800	1,086,320.00	0.27
106	600547	山东黄金	39,400	1,078,772.00	0.27
107	300014	亿纬锂能	26,800	1,069,856.00	0.27
108	002304	洋河股份	13,200	1,065,768.00	0.27
109	600893	航发动力	29,100	1,063,605.00	0.27
110	002179	中航光电	27,818	1,058,474.90	0.26
111	601669	中国电建	188,300	1,052,597.00	0.26
112	300015	爱尔眼科	101,758	1,050,142.56	0.26
113	000002	万科 A	148,457	1,028,807.01	0.26



114	002241	歌尔股份	52,300	1,020,373.00	0.25
115	600926	杭州银行	77,600	1,012,680.00	0.25
116	000538	云南白药	19,480	996,402.00	0.25
117	600584	长电科技	31,200	989,352.00	0.25
118	600760	中航沈飞	24,143	968,134.30	0.24
119	600111	北方稀土	55,300	951,160.00	0.24
120	600489	中金黄金	63,400	938,320.00	0.23
121	002050	三花智控	48,820	931,485.60	0.23
122	600011	华能国际	96,200	925,444.00	0.23
123	601916	浙商银行	329,800	910,248.00	0.23
124	002252	上海莱士	116,000	907,120.00	0.23
125	688256	寒武纪	4,553	904,544.51	0.23
126	600015	华夏银行	138,800	888,320.00	0.22
127	600009	上海机场	27,200	877,200.00	0.22
128	600958	东方证券	113,900	865,640.00	0.22
129	600426	华鲁恒升	32,300	860,472.00	0.21
130	601186	中国铁建	100,400	860,428.00	0.21
131	002311	海大集团	18,239	858,144.95	0.21
132	300408	三环集团	29,300	855,267.00	0.21
133	000166	申万宏源	196,800	848,208.00	0.21
134	000157	中联重科	108,700	834,816.00	0.21
135	601901	方正证券	107,800	833,294.00	0.21
136	600989	宝丰能源	48,000	831,840.00	0.21
137	000977	浪潮信息	22,400	814,688.00	0.20
138	600674	川投能源	42,500	796,875.00	0.20
139	003816	中国广核	171,600	794,508.00	0.20
140	300433	蓝思科技	43,500	793,875.00	0.20
141	688271	联影医疗	7,199	789,730.30	0.20
142	000776	广发证券	64,700	787,399.00	0.20
143	002049	紫光国微	14,780	777,428.00	0.19
144	002001	新和成	40,456	776,755.20	0.19
145	601377	兴业证券	150,990	764,009.40	0.19
146	688036	传音控股	9,978	763,716.12	0.19
147	000596	古井贡酒	3,600	759,852.00	0.19
148	601111	中国国航	101,700	750,546.00	0.19
149	600115	中国东航	186,400	747,464.00	0.19
150	300122	智飞生物	26,050	730,181.50	0.18
151	000768	中航西飞	30,300	728,109.00	0.18
152	002460	赣锋锂业	24,700	707,655.00	0.18
153	601800	中国交建	77,800	695,532.00	0.17
154	001979	招商蛇口	79,100	695,289.00	0.17
155	600029	南方航空	118,000	695,020.00	0.17
156	600010	宝钢股份	494,900	692,860.00	0.17

157	601633	长城汽车	27,201	688,185.30	0.17
158	600188	兖矿能源	30,000	681,900.00	0.17
159	002601	龙佰集团	36,500	677,805.00	0.17
160	002466	天齐锂业	22,600	675,966.00	0.17
161	002236	大华股份	43,200	667,872.00	0.17
162	002648	卫星化学	36,760	660,944.80	0.17
163	601117	中国化学	80,200	660,848.00	0.17
164	603799	华友钴业	29,640	655,933.20	0.16
165	000786	北新建材	22,000	652,520.00	0.16
166	000661	长春高新	7,100	651,567.00	0.16
167	600346	恒力石化	46,100	643,095.00	0.16
168	002493	荣盛石化	66,350	640,941.00	0.16
169	000983	山西焦煤	62,100	640,251.00	0.16
170	300782	卓胜微	8,220	639,022.80	0.16
171	601838	成都银行	41,735	633,954.65	0.16
172	600161	天坛生物	25,940	632,936.00	0.16
173	600372	中航机载	52,600	629,622.00	0.16
174	603369	今世缘	13,600	628,320.00	0.16
175	600023	浙能电力	87,900	624,969.00	0.16
176	601788	光大证券	42,700	624,274.00	0.16
177	688223	晶科能源	87,214	619,219.40	0.15
178	600196	复星医药	27,800	615,492.00	0.15
179	000807	云铝股份	45,300	612,003.00	0.15
180	002129	TCL 中环	70,475	609,608.75	0.15
181	300418	昆仑万维	18,800	606,112.00	0.15
182	600845	宝信软件	18,863	602,295.59	0.15
183	300661	圣邦股份	7,275	602,224.50	0.15
184	601872	招商轮船	71,100	600,795.00	0.15
185	002938	鹏鼎控股	15,100	600,376.00	0.15
186	601868	中国能建	282,900	599,748.00	0.15
187	601360	三六零	77,900	598,272.00	0.15
188	601021	春秋航空	10,600	597,098.00	0.15
189	600233	圆通速递	37,500	586,875.00	0.15
190	600219	南山铝业	153,100	583,311.00	0.15
191	600570	恒生电子	32,961	582,091.26	0.15
192	600176	中国巨石	52,420	579,241.00	0.14
193	002180	纳思达	21,600	570,672.00	0.14
194	600085	同仁堂	14,900	569,329.00	0.14
195	601995	中金公司	19,200	568,512.00	0.14
196	600600	青岛啤酒	7,800	567,606.00	0.14
197	300896	爱美客	3,280	564,488.00	0.14
198	605499	东鹏饮料	2,600	560,950.00	0.14
199	600741	华域汽车	34,200	560,196.00	0.14

200	603392	万泰生物	8,383	552,272.04	0.14
201	300347	泰格医药	11,300	549,180.00	0.14
202	601336	新华保险	18,200	546,546.00	0.14
203	002736	国信证券	62,800	545,732.00	0.14
204	601066	中信建投	28,346	545,377.04	0.14
205	600183	生益科技	25,800	543,348.00	0.14
206	002271	东方雨虹	43,900	541,726.00	0.14
207	601689	拓普集团	10,100	541,461.00	0.14
208	601100	恒立液压	11,604	540,514.32	0.14
209	000895	双汇发展	22,662	538,675.74	0.13
210	600745	闻泰科技	18,983	536,269.75	0.13
211	600362	江西铜业	22,600	535,168.00	0.13
212	002920	德赛西威	6,100	531,249.00	0.13
213	000963	华东医药	19,100	531,171.00	0.13
214	001965	招商公路	44,600	528,956.00	0.13
215	601881	中国银河	47,400	514,764.00	0.13
216	600027	华电国际	74,100	514,254.00	0.13
217	601898	中煤能源	40,000	499,200.00	0.12
218	688126	沪硅产业	35,984	496,939.04	0.12
219	300033	同花顺	4,700	487,390.00	0.12
220	002459	晶澳科技	43,201	483,851.20	0.12
221	601618	中国中冶	155,900	483,290.00	0.12
222	002916	深南电路	4,509	476,916.93	0.12
223	000999	华润三九	11,130	473,915.40	0.12
224	601699	潞安环能	26,100	473,193.00	0.12
225	600026	中远海能	30,300	472,983.00	0.12
226	600515	海南机场	150,200	471,628.00	0.12
227	300832	新产业	6,900	465,336.00	0.12
228	601607	上海医药	24,300	464,373.00	0.12
229	000301	东方盛虹	57,800	460,666.00	0.12
230	601878	浙商证券	42,300	453,456.00	0.11
231	000876	新希望	49,600	453,344.00	0.11
232	600039	四川路桥	57,180	451,150.20	0.11
233	601998	中信银行	67,100	449,570.00	0.11
234	600332	白云山	15,300	448,749.00	0.11
235	600875	东方电气	24,300	448,335.00	0.11
236	002074	国轩高科	23,400	448,110.00	0.11
237	600588	用友网络	44,680	446,800.00	0.11
238	600415	小商品城	59,900	444,458.00	0.11
239	601877	正泰电器	23,300	444,098.00	0.11
240	002555	三七互娱	34,000	443,700.00	0.11
241	002709	天赐材料	25,100	440,756.00	0.11
242	688396	华润微	11,520	431,308.80	0.11

243	600025	华能水电	39,400	424,732.00	0.11
244	600803	新奥股份	20,300	422,240.00	0.11
245	000408	藏格矿业	17,200	414,004.00	0.10
246	300223	北京君正	7,400	410,256.00	0.10
247	002812	恩捷股份	12,900	408,285.00	0.10
248	300316	晶盛机电	14,200	407,966.00	0.10
249	300628	亿联网络	11,010	404,837.70	0.10
250	688599	天合光能	23,720	401,342.40	0.10
251	300450	先导智能	23,960	398,454.80	0.10
252	300142	沃森生物	35,000	398,300.00	0.10
253	605117	德业股份	5,280	392,515.20	0.10
254	600460	士兰微	21,700	379,967.00	0.09
255	002007	华兰生物	23,864	376,812.56	0.09
256	601238	广汽集团	48,500	375,390.00	0.09
257	300496	中科创达	8,100	369,279.00	0.09
258	603260	合盛硅业	7,800	364,338.00	0.09
259	301269	华大九天	4,700	362,135.00	0.09
260	300759	康龙化成	19,450	361,381.00	0.09
261	601319	中国人保	69,500	357,925.00	0.09
262	300999	金龙鱼	13,000	355,550.00	0.09
263	600018	上港集团	61,300	354,314.00	0.09
264	300751	迈为股份	2,940	351,271.20	0.09
265	000733	振华科技	8,400	348,852.00	0.09
266	601799	星宇股份	3,100	347,324.00	0.09
267	600918	中泰证券	61,000	345,870.00	0.09
268	300413	芒果超媒	16,400	342,760.00	0.09
269	002821	凯莱英	5,200	342,160.00	0.09
270	688009	中国通号	56,735	340,410.00	0.09
271	603806	福斯特	22,818	335,424.60	0.08
272	601865	福莱特	16,600	333,660.00	0.08
273	603659	璞泰来	23,285	329,017.05	0.08
274	603195	公牛集团	4,261	328,608.32	0.08
275	600132	重庆啤酒	5,300	321,710.00	0.08
276	600061	国投资本	56,104	316,987.60	0.08
277	300919	中伟股份	10,200	316,098.00	0.08
278	000617	中油资本	55,000	303,600.00	0.08
279	601059	信达证券	21,200	301,252.00	0.08
280	000708	中信特钢	22,100	299,897.00	0.07
281	688303	大全能源	14,001	285,480.39	0.07
282	688187	时代电气	5,700	281,466.00	0.07
283	002603	以岭药业	18,200	279,006.00	0.07
284	300454	深信服	5,500	277,915.00	0.07
285	002410	广联达	28,980	277,628.40	0.07

286	002841	视源股份	9,200	271,676.00	0.07
287	300442	润泽科技	11,200	268,240.00	0.07
288	603899	晨光股份	8,100	253,368.00	0.06
289	688363	华熙生物	4,157	235,161.49	0.06
290	601808	中海油服	12,900	221,880.00	0.06
291	603833	欧派家居	4,080	218,524.80	0.05
292	600732	爱旭股份	23,980	217,019.00	0.05
293	300979	华利集团	3,300	200,805.00	0.05
294	601236	红塔证券	30,900	198,378.00	0.05
295	601698	中国卫通	13,900	195,851.00	0.05
296	300957	贝泰妮	3,700	178,784.00	0.04
297	688082	盛美上海	1,965	166,062.15	0.04
298	000800	一汽解放	20,000	156,600.00	0.04
299	603296	华勤技术	2,000	110,460.00	0.03
300	001289	龙源电力	3,200	55,200.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,169,254.12	1.45
2	000333	美的集团	3,355,688.28	0.94
3	600036	招商银行	3,215,549.00	0.90
4	000858	五粮液	2,800,219.00	0.79
5	600519	贵州茅台	2,275,947.00	0.64
6	002594	比亚迪	2,015,607.00	0.57
7	000651	格力电器	1,865,839.00	0.52
8	300059	东方财富	1,729,434.00	0.49
9	300760	迈瑞医疗	1,726,242.00	0.49
10	002371	北方华创	1,721,623.00	0.48
11	002475	立讯精密	1,658,278.00	0.47
12	000568	泸州老窖	1,613,750.00	0.45
13	000725	京东方 A	1,585,483.00	0.45
14	600900	长江电力	1,406,932.00	0.40
15	300124	汇川技术	1,361,912.00	0.38
16	002415	海康威视	1,264,010.00	0.36
17	002714	牧原股份	1,231,685.00	0.35
18	300498	温氏股份	1,183,630.40	0.33
19	000596	古井贡酒	1,075,388.00	0.30
20	000001	平安银行	1,052,561.00	0.30

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	4,471,108.00	1.26
2	000333	美的集团	2,963,263.00	0.83
3	000858	五粮液	2,347,996.00	0.66
4	002594	比亚迪	1,675,595.00	0.47
5	000651	格力电器	1,621,441.00	0.46
6	000568	泸州老窖	1,605,961.00	0.45
7	300124	汇川技术	1,575,666.00	0.44
8	300059	东方财富	1,527,113.00	0.43
9	002371	北方华创	1,451,914.00	0.41
10	000725	京东方 A	1,410,602.00	0.40
11	002475	立讯精密	1,329,841.00	0.37
12	300760	迈瑞医疗	1,240,310.00	0.35
13	000596	古井贡酒	1,164,374.00	0.33
14	002142	宁波银行	1,156,705.00	0.33
15	002415	海康威视	1,093,044.00	0.31
16	002714	牧原股份	1,047,446.00	0.29
17	300498	温氏股份	1,015,233.00	0.29
18	000001	平安银行	904,379.00	0.25
19	000792	盐湖股份	820,736.00	0.23
20	300033	同花顺	803,144.92	0.23

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	91,654,664.40
卖出股票收入（成交）总额	76,841,481.79

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。

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	913,911.56
2	应收清算款	-
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	913,911.56

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	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 (%)
4,653	89,121.65	243,090,166.00	58.62	171,592,850.00	41.38

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（%）
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	123,831,700.00	29.86

### 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	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	12,582,500.00	3.03
2	渤海人寿保险股份有限公司一分红保险十	12,434,200.00	3.00
3	渤海人寿保险股份有限公司一分红保险十	10,821,300.00	2.61
4	渤海人寿保险股份有限公司一分红保险十	9,979,600.00	2.41
5	北京泰铎投资管理有限公司一泰铎信铎 8 号私募证券投资基金	9,054,600.00	2.18
6	方正证券股份有限公司	8,744,300.00	2.11
7	广发证券股份有限公司	8,681,096.00	2.09
8	渤海人寿保险股份有限公司一分红保险八	6,942,800.00	1.67
9	中国农业银行股份有限公司一华安平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FO	6,887,900.00	1.66
10	邓铁军	4,620,900.00	1.11
11	招商银行股份有限公司一华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	123,831,700.00	29.86

### 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(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	374,683,016.00
本报告期基金总申购份额	196,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	156,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	414,683,016.00

## § 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：

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
民生证券	1	122,558,624.35	72.74	114,703.84	72.59	-
中信证券	3	14,533,142.26	8.63	13,729.66	8.69	-
东吴证券	1	13,578,969.48	8.06	12,844.12	8.13	-
国泰君安	3	7,795,577.03	4.63	7,295.78	4.62	-
信达证券	1	5,110,478.80	3.03	4,782.88	3.03	-
广发证券	1	2,550,210.65	1.51	2,412.05	1.53	-
野村东方证券	1	2,369,143.62	1.41	2,241.03	1.42	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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：

2024 年 6 月完成新增托管在招商银行的国泰君安上交所 59858 交易单元。

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 (%)
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
野村东	-	-	-	-	-	-

方证券						
方正证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安沪深 300ETF2023 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部分基金增加信达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 2 月 5 日
3	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	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 3 月 12 日
4	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通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 3 月 22 日
5	华安沪深 300 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
6	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
7	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
8	华安沪深 300ETF2024 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
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	华安基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会基金电子披	2024 年 6 月 7 日

	分基金增加渤海证券股份有限公司为一级交易商的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
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	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 15 日
13	华安沪深 300ETF 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 6 月 19 日
14	华安沪深 300ETF 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 19 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 (%)
联接基金	1	20240101~20240630	111,159,300.00	46,304,000.00	33,631,600.00	123,831,700.00	29.86
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

2024 年 8 月 31 日