

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资  
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：中国工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。

基金托管人中国工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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60

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 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称	华安中国 A 股增强指数
基金主代码	040002
前端交易代码	040002
后端交易代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,403,369,874.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金将日均跟踪误差最大容忍值设定为 0.5%。
业绩比较基准	95%*MSCI 中国 A 股指数收益率+5%*金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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	华安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-84,278,749.88
本期利润	-63,210,036.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0446
本期加权平均净值利润率	-6.58%
本期基金份额净值增长率	-6.40%
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	495,594,834.06
期末可供分配基金份额利润	0.3531
期末基金资产净值	923,235,201.63
期末基金份额净值	0.658
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	351.72%

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）。

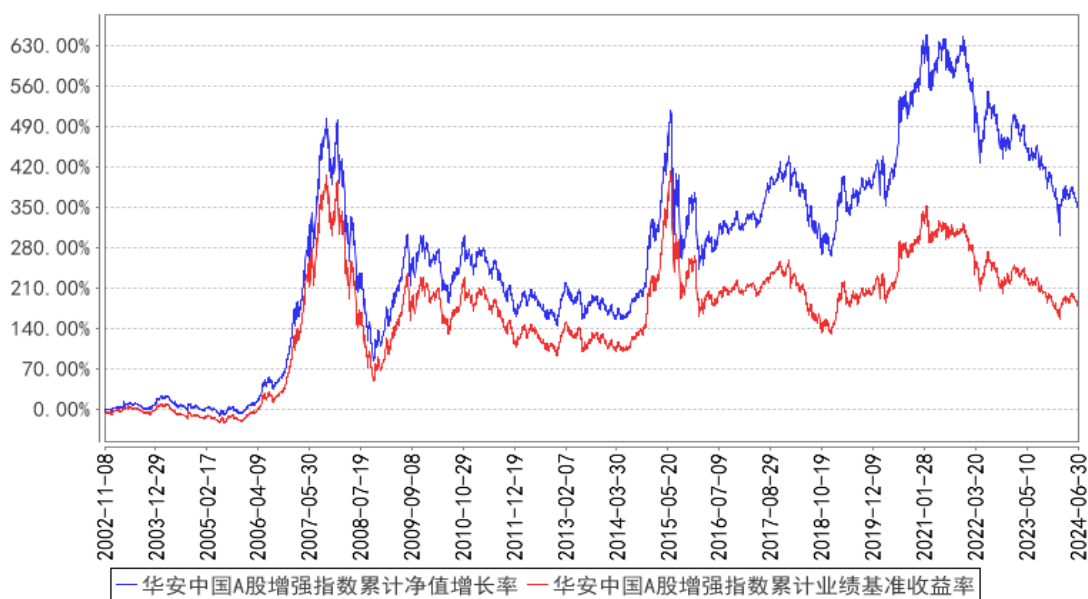
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-3.38%	0.51%	-3.83%	0.54%	0.45%	-0.03%
过去三个月	-3.80%	0.76%	-2.97%	0.81%	-0.83%	-0.05%
过去六个月	-6.40%	1.33%	-1.85%	1.01%	-4.55%	0.32%
过去一年	-16.18%	1.11%	-11.69%	0.91%	-4.49%	0.20%
过去三年	-39.02%	1.15%	-32.60%	1.01%	-6.42%	0.14%
自基金合同生效起至今	351.72%	1.51%	178.82%	1.48%	172.90%	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

华安中国A股增强指数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	2017 年 12 月 25 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



					<p>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>
马韬	本基金的基金经理	2018 年 1 月 15 日	-	9 年	<p>硕士研究生,9 年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017 年 2 月加入华安基金,历任指数与量化投资部数量分析师。2018 年 1 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 2 月,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起,同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起,同时担任华安中证 1000 指数增强型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 年上半年国内宏观经济延续修复的态势, 供需两端主要指标均稳中有升。随着地产周期、人口周期及债务周期等均进入新阶段, 经济增长仍然面临不小的压力。权益市场在上半年表现也较为一般, 整体表现相对弱势。

市场风格主要表现为红利、大盘领先, 宽基指数表现为沪深 300 强于中证 500 强于中证 1000。小微盘风格股票在一季度经历了历史罕见的波动, 先是在 1 月份由雪球敲入、DMA 平仓等引发的流动性危机而导致小微盘股票大幅下跌, 而后又在 2—3 月迅速反弹。在此期间, 市场主流的量化模型均受到了不同程度的挑战。行业层面, 也主要表现为以银行、煤炭、电力及公用事业等为代表的红利板块继续强势, 传统的消费、新能源、医药等板块仍然疲软。

本基金在基本配置上仍然兼顾均衡, 选择基本面较好且与技术面发生共振的优质股票。

### 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 0.658 元, 本报告期份额净值增长率为-6.40%, 同期业绩比较基准增长率为-1.85%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段, 大的宏观背景是更加强调高质量发展, 强调质量, 强调结构。根据《政府工作报告》的部署, 大力推进现代化产业体系建设、加快发展新质生产力将是贯穿 2024 全年的首要工作目标。货币政策上, 总量层面仍将保持适度宽松, 结构上将更加注重政策的实施效果, 发挥货币政策的结构优化作用。

在此背景下, 证券市场可能将会继续演绎结构性行情, 在没有特别明显增量资金的情况下,

板块和行业之间的轮动效应可能会再加强。在基本配置上，沿着景气变化和改革政策方向把握投资机会，一方面是红利策略，关注分红改革新政下分红水平占优或分红有提升空间的板块和企业；另一方面是新质生产力，主要集中在科技成长、先进制造等板块。

作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	61,578,419.94	59,194,773.80
结算备付金		6,217,521.15	5,174,344.83
存出保证金		259,950.44	119,320.18
交易性金融资产	6.4.7.2	864,527,013.93	935,925,635.53
其中：股票投资		864,527,013.93	935,925,635.53
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		887,964.92	8,800,515.56
应收股利		-	-
应收申购款		91,730.49	233,044.63

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		933,562,600.87	1,009,447,634.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年6月30日</b>	<b>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		671,980.81	6,823,094.76
应付赎回款		655,733.54	776,535.33
应付管理人报酬		771,156.48	841,203.40
应付托管费		154,231.28	168,240.69
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	8,074,297.13	5,507,277.34
负债合计		10,327,399.24	14,116,351.52
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	427,640,367.57	431,377,397.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	495,594,834.06	563,953,885.29
净资产合计		923,235,201.63	995,331,283.01
负债和净资产总计		933,562,600.87	1,009,447,634.53

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.658 元，基金份额总额 1,403,369,874.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：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	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
<b>一、营业总收入</b>		-57,360,954.71	-39,213,109.43
1. 利息收入		152,248.74	138,281.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	152,248.74	138,281.73
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）		-78,585,090.20	-16,235,979.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-89,889,923.70	-27,054,118.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	31,108.49	43,904.67
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	11,273,725.01	10,774,234.39
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	21,068,713.36	-23,120,268.26
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	3,173.39	4,856.23
<b>减：二、营业总支出</b>		5,849,081.81	7,189,961.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,777,561.26	5,893,027.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	955,512.25	1,178,605.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	0.37
8. 其他费用	6.4.7.17	116,008.30	118,327.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-63,210,036.52	-46,403,070.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-63,210,036.52	-46,403,070.86

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-63,210,036.52	-46,403,070.86

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：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	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,737,030.15	-	-68,359,051.23	-72,096,081.38
(一)、综合收益总额	-	-	-63,210,036.52	-63,210,036.52
(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)	-3,737,030.15	-	-5,149,014.71	-8,886,044.86
其中：1. 基金申购款	23,365,250.81	-	28,411,278.99	51,776,529.80
2. 基金赎回款	-27,102,280.96	-	-33,560,293.70	-60,662,574.66
(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	427,640,367.57	-	495,594,834.06	923,235,201.63
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	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,058,933.21	-	-55,690,953.21	-60,749,886.42
(一)、综合收益总额	-	-	-46,403,070.86	-46,403,070.86
(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)	-5,058,933.21	-	-9,287,882.35	-14,346,815.56
其中：1. 基金申购款	24,307,446.02	-	41,952,499.85	66,259,945.87
2. 基金赎回款	-29,366,379.23	-	-51,240,382.20	-80,606,761.43
(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	432,518,547.49	-	682,067,883.58	1,114,586,431.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>朱学华</u>	<u>朱学华</u>	<u>陈松一</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起,并于 2002 年 11 月 8 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,094,001,258.61 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 126 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》,并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金,跟踪标的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 3.281806547,并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)。本基金投资于股票(含存托凭证)的目标比例为基金资产净值的 95%,投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%;此外,本基金可参与股票(含存托凭证)一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股,在成份股之外的股票(含存托凭证)投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成

份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率  $\times 95\%$  + 金融同业存款利率  $\times 5\%$ 。

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 MSCI 中国 A 股指数增强型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	61,578,419.94
等于：本金	61,572,984.36
加：应计利息	5,435.58
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	61,578,419.94

##### 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	905,267,202.12	-	864,527,013.93	-40,740,188.19
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	905,267,202.12	-	864,527,013.93	-40,740,188.19

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,467,568.03
其中：交易所市场	7,465,136.84
银行间市场	2,431.19
应付利息	-
预提费用	106,729.10
合计	8,074,297.13

### 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	1,415,635,151.49	431,377,397.72
本期申购	76,672,242.13	23,365,250.81
本期赎回（以“-”号填列）	-88,937,518.75	-27,102,280.96
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,403,369,874.87	427,640,367.57

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	700,070,341.70	-136,116,456.41	563,953,885.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	700,070,341.70	-136,116,456.41	563,953,885.29
本期利润	-84,278,749.88	21,068,713.36	-63,210,036.52
本期基金份额交易产生的变动数	-5,078,625.83	-70,388.88	-5,149,014.71
其中：基金申购款	34,993,485.36	-6,582,206.37	28,411,278.99
基金赎回款	-40,072,111.19	6,511,817.49	-33,560,293.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	610,712,965.99	-115,118,131.93	495,594,834.06

#### 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	108,938.92
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	42,016.12
其他	1,293.70
合计	152,248.74

#### 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	-89,889,923.70
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-89,889,923.70

#### 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	3,971,747,243.07
减：卖出股票成本总额	4,051,677,767.64
减：交易费用	9,959,399.13
买卖股票差价收入	-89,889,923.70

#### 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	3.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	31,105.30
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	31,108.49

##### 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	57,110.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,000.00
减：应计利息总额	3.19
减：交易费用	2.32
买卖债券差价收入	31,105.30

#### 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	11,273,725.01
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,273,725.01

**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	21,068,713.36
股票投资	21,068,713.36
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	21,068,713.36

**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	2,290.48
基金转换费收入	882.91
合计	3,173.39

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**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	47,056.76
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	279.20
账户维护费	9,000.00
合计	116,008.30

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰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	3,115,483,506.50	39.29	1,953,468,649.79	55.66
--------------	------------------	-------	------------------	-------

#### 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	-	-	1,433,077.60	99.92

#### 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	2,946,942.04	39.48	2,946,942.04	39.48
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	1,819,267.69	55.92	1,819,267.69	55.92

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	4,777,561.26	5,893,027.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,425,131.25	1,735,315.93
应支付基金管理人的净管理费	3,352,430.01	4,157,711.69

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 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	955,512.25	1,178,605.55

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行股份有限公司	61,578,419.94	108,938.92	70,445,356.56	119,732.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	11,803	191,208.60
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	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
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
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
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	601916	浙商银行	老股东配售	30	60.60

股份有限公司					
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	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

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
001359	平安电工	2024年3月19日	1-6个月（含）	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	1-6个月（含）	新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	1-6个月（含）	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年06月03日	1-6个月（含）	新股限售-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024年3月26日	1-6个月（含）	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

301392	汇成真空	2024年5月28日	1-6个月(含)	新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	1-6个月(含)	新股限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	1-6个月(含)	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年05月22日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	1-6个月(含)	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	1-6个月(含)	新股限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	1-6个月(含)	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	1-6个月(含)	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年05月30日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-

301591	肯特股份	2024年2月20日	1-6个月(含)	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月(含)	新股限售	16.20	15.96	1,181	19,132.20	18,848.76	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项停牌	0.01	-	-	100	297.00	1.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、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工商银行，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，本基金无债券投资(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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	61,578,419.94	-	-	-	61,578,419.94
结算备付金	6,217,521.15	-	-	-	6,217,521.15
存出保证金	259,950.44	-	-	-	259,950.44
交易性金融资产	-	-	-	864,527,013.93	864,527,013.93
应收申购款	-	-	-	91,730.49	91,730.49
应收清算款	-	-	-	887,964.92	887,964.92
资产总计	68,055,891.53	-	-	865,506,709.34	933,562,600.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	655,733.54	655,733.54

应付管理人报酬	-	-	-	771,156.48	771,156.48
应付托管费	-	-	-	154,231.28	154,231.28
应付清算款	-	-	-	671,980.81	671,980.81
其他负债	-	-	-	8,074,297.13	8,074,297.13
负债总计	-	-	-	10,327,399.24	10,327,399.24
利率敏感度缺口	68,055,891.53	-	-	-855,179,310.10	923,235,201.63
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	59,194,773.80	-	-	-	59,194,773.80
结算备付金	5,174,344.83	-	-	-	5,174,344.83
存出保证金	119,320.18	-	-	-	119,320.18
交易性金融资产	-	-	-	-935,925,635.53	935,925,635.53
应收申购款	-	-	-	233,044.63	233,044.63
应收清算款	-	-	-	8,800,515.56	8,800,515.56
资产总计	64,488,438.81	-	-	-944,959,195.72	1,009,447,634.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	776,535.33	776,535.33
应付管理人报酬	-	-	-	841,203.40	841,203.40
应付托管费	-	-	-	168,240.69	168,240.69
应付清算款	-	-	-	6,823,094.76	6,823,094.76
其他负债	-	-	-	5,507,277.34	5,507,277.34
负债总计	-	-	-	14,116,351.52	14,116,351.52
利率敏感度缺口	64,488,438.81	-	-	-930,842,844.20	995,331,283.01

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)，投资组合中股票(含存托凭证)投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	864,527,013.93	93.64	935,925,635.53	94.03
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	864,527,013.93	93.64	935,925,635.53	94.03

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动	
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	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%		56,540,204.30
业绩比较基准下降 5%		-56,540,204.30	-51,442,476.02

#### 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	864,012,313.65	933,963,610.40
第二层次	45,611.11	-
第三层次	469,089.17	1,962,025.13
合计	864,527,013.93	935,925,635.53

###### 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	864,527,013.93	92.61
	其中: 股票	864,527,013.93	92.61
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	67,795,941.09	7.26
8	其他各项资产	1,239,645.85	0.13
9	合计	933,562,600.87	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	9,211,402.00	1.00
B	采矿业	49,173,470.81	5.33
C	制造业	404,271,072.81	43.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,333,782.50	6.64
E	建筑业	30,072,082.00	3.26



F	批发和零售业	10,045,726.38	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	41,014,343.92	4.44
H	住宿和餐饮业	18,384.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,450,653.20	3.62
J	金融业	182,355,521.14	19.75
K	房地产业	2,087,566.49	0.23
L	租赁和商务服务业	10,474,929.30	1.13
M	科学研究和技术服务业	3,049,057.75	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	1,947,315.82	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	152,157.12	0.02
R	文化、体育和娱乐业	734,509.74	0.08
S	综合	2,828,672.00	0.31
	合计	842,220,646.98	91.22

### 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	11,099,180.85	1.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,686,500.00	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,192,921.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2,784,115.00	0.30
H	住宿和餐饮业	7,410.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,443,586.54	0.48
J	金融业	10,923.00	0.00
K	房地产业	15,641.00	0.00
L	租赁和商务服务	16,320.00	0.00

	业		
M	科学研究和技术服务业	20,624.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	18,848.76	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	10,296.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,306,366.95	2.42

### 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	21,133	31,010,352.87	3.36
2	300750	宁德时代	114,012	20,525,580.36	2.22
3	600036	招商银行	551,900	18,869,461.00	2.04
4	601318	中国平安	361,134	14,936,502.24	1.62
5	000333	美的集团	201,585	13,002,232.50	1.41
6	600900	长江电力	395,900	11,449,428.00	1.24
7	601166	兴业银行	634,000	11,171,080.00	1.21
8	601899	紫金矿业	518,283	9,106,232.31	0.99
9	601328	交通银行	1,132,400	8,459,028.00	0.92
10	000725	京东方 A	2,062,800	8,436,852.00	0.91
11	601288	农业银行	1,669,700	7,279,892.00	0.79
12	600919	江苏银行	947,200	7,037,696.00	0.76
13	600030	中信证券	364,333	6,641,790.59	0.72
14	002594	比亚迪	25,700	6,431,425.00	0.70
15	600016	民生银行	1,639,900	6,215,221.00	0.67
16	000568	泸州老窖	42,600	6,112,674.00	0.66
17	000100	TCL 科技	1,374,880	5,939,481.60	0.64
18	300760	迈瑞医疗	20,388	5,931,073.08	0.64
19	000858	五粮液	45,644	5,844,257.76	0.63
20	600028	中国石化	913,300	5,772,056.00	0.63
21	601816	京沪高铁	1,074,700	5,771,139.00	0.63

22	601169	北京银行	978,800	5,716,192.00	0.62
23	601668	中国建筑	1,064,900	5,654,619.00	0.61
24	002027	分众传媒	924,400	5,601,864.00	0.61
25	002475	立讯精密	142,132	5,587,208.92	0.61
26	000651	格力电器	142,100	5,573,162.00	0.60
27	600887	伊利股份	215,300	5,563,352.00	0.60
28	600276	恒瑞医药	141,060	5,425,167.60	0.59
29	600089	特变电工	390,500	5,416,235.00	0.59
30	601398	工商银行	932,900	5,317,530.00	0.58
31	600031	三一重工	315,500	5,205,750.00	0.56
32	600309	万华化学	61,900	5,005,234.00	0.54
33	600000	浦发银行	599,700	4,935,531.00	0.53
34	601225	陕西煤业	187,000	4,818,990.00	0.52
35	600795	国电电力	790,400	4,734,496.00	0.51
36	600690	海尔智家	165,320	4,691,781.60	0.51
37	002415	海康威视	150,900	4,664,319.00	0.51
38	600547	山东黄金	169,600	4,643,648.00	0.50
39	601728	中国电信	739,800	4,549,770.00	0.49
40	601916	浙商银行	1,604,830	4,429,330.80	0.48
41	600406	国电南瑞	177,320	4,425,907.20	0.48
42	600050	中国联通	939,700	4,416,590.00	0.48
43	601939	建设银行	591,800	4,379,320.00	0.47
44	601818	光大银行	1,353,500	4,290,595.00	0.46
45	601988	中国银行	924,600	4,271,652.00	0.46
46	600941	中国移动	39,100	4,203,250.00	0.46
47	600023	浙能电力	584,300	4,154,373.00	0.45
48	300059	东方财富	389,998	4,118,378.88	0.45
49	601111	中国国航	545,632	4,026,764.16	0.44
50	003816	中国广核	866,500	4,011,895.00	0.43
51	601989	中国重工	804,800	3,967,664.00	0.43
52	600010	包钢股份	2,814,400	3,940,160.00	0.43
53	601868	中国能建	1,849,100	3,920,092.00	0.42
54	600188	兖矿能源	171,250	3,892,512.50	0.42
55	600019	宝钢股份	583,400	3,879,610.00	0.42
56	600256	广汇能源	569,500	3,815,650.00	0.41
57	000625	长安汽车	274,200	3,682,506.00	0.40
58	002138	顺络电子	132,900	3,649,434.00	0.40
59	688777	中控技术	96,378	3,633,450.60	0.39
60	601618	中国中冶	1,171,900	3,632,890.00	0.39
61	601872	招商轮船	426,800	3,606,460.00	0.39
62	600863	内蒙华电	774,800	3,595,072.00	0.39
63	600018	上港集团	609,500	3,522,910.00	0.38
64	601077	渝农商行	701,100	3,519,522.00	0.38

65	002493	荣盛石化	361,450	3,491,607.00	0.38
66	601991	大唐发电	1,147,200	3,453,072.00	0.37
67	688126	沪硅产业	249,102	3,440,098.62	0.37
68	688396	华润微	91,232	3,415,726.08	0.37
69	000039	中集集团	366,900	3,397,494.00	0.37
70	002920	德赛西威	39,000	3,396,510.00	0.37
71	002831	裕同科技	131,400	3,362,526.00	0.36
72	600008	首创环保	1,249,400	3,348,392.00	0.36
73	002736	国信证券	376,400	3,270,916.00	0.35
74	601985	中国核电	305,000	3,251,300.00	0.35
75	601333	广深铁路	1,002,700	3,248,748.00	0.35
76	002372	伟星新材	209,500	3,230,490.00	0.35
77	601117	中国化学	391,800	3,228,432.00	0.35
78	002294	信立泰	120,900	3,219,567.00	0.35
79	300919	中伟股份	102,360	3,172,136.40	0.34
80	000598	兴蓉环境	421,100	3,166,672.00	0.34
81	688017	绿的谐波	38,437	3,155,677.70	0.34
82	300274	阳光电源	50,400	3,126,312.00	0.34
83	601088	中国神华	70,400	3,123,648.00	0.34
84	000001	平安银行	307,600	3,122,140.00	0.34
85	000818	航锦科技	141,300	3,119,904.00	0.34
86	600392	盛和资源	360,200	3,104,924.00	0.34
87	688301	奕瑞科技	26,918	3,101,761.14	0.34
88	000591	太阳能	657,500	3,096,825.00	0.34
89	002202	金风科技	459,700	3,089,184.00	0.33
90	601838	成都银行	199,100	3,024,329.00	0.33
91	002241	歌尔股份	154,800	3,020,148.00	0.33
92	600027	华电国际	434,300	3,014,042.00	0.33
93	600998	九州通	610,966	2,981,514.08	0.32
94	002430	杭氧股份	133,200	2,963,700.00	0.32
95	600015	华夏银行	459,800	2,942,720.00	0.32
96	603728	鸣志电器	72,900	2,932,767.00	0.32
97	000166	申万宏源	675,900	2,913,129.00	0.32
98	600029	南方航空	492,900	2,903,181.00	0.31
99	600039	四川路桥	366,100	2,888,529.00	0.31
100	600886	国投电力	156,800	2,860,032.00	0.31
101	601825	沪农商行	424,000	2,849,280.00	0.31
102	002601	龙佰集团	153,200	2,844,924.00	0.31
103	002065	东华软件	628,900	2,842,628.00	0.31
104	688516	奥特维	67,885	2,838,271.85	0.31
105	600673	东阳光	401,800	2,828,672.00	0.31
106	688032	禾迈股份	23,981	2,752,539.18	0.30
107	002371	北方华创	8,600	2,751,054.00	0.30

108	600885	宏发股份	98,202	2,718,231.36	0.29
109	002032	苏泊尔	53,900	2,700,390.00	0.29
110	600369	西南证券	751,300	2,689,654.00	0.29
111	000800	一汽解放	340,800	2,668,464.00	0.29
112	600380	健康元	238,700	2,666,279.00	0.29
113	601000	唐山港	564,498	2,653,140.60	0.29
114	600111	北方稀土	153,900	2,647,080.00	0.29
115	600809	山西汾酒	12,300	2,593,824.00	0.28
116	601390	中国中铁	397,400	2,591,048.00	0.28
117	600415	小商品城	347,700	2,579,934.00	0.28
118	601766	中国中车	341,700	2,566,167.00	0.28
119	601229	上海银行	350,700	2,546,082.00	0.28
120	300124	汇川技术	49,300	2,529,090.00	0.27
121	601006	大秦铁路	353,000	2,527,480.00	0.27
122	600660	福耀玻璃	52,400	2,509,960.00	0.27
123	002595	豪迈科技	65,600	2,503,952.00	0.27
124	600348	华阳股份	250,000	2,490,000.00	0.27
125	601577	长沙银行	304,100	2,487,538.00	0.27
126	600703	三安光电	211,700	2,481,124.00	0.27
127	300285	国瓷材料	137,100	2,447,235.00	0.27
128	002500	山西证券	519,800	2,443,060.00	0.26
129	600970	中材国际	202,400	2,440,944.00	0.26
130	601012	隆基绿能	173,791	2,436,549.82	0.26
131	000157	中联重科	313,200	2,405,376.00	0.26
132	600233	圆通速递	152,600	2,388,190.00	0.26
133	601975	招商南油	660,600	2,371,554.00	0.26
134	600905	三峡能源	542,300	2,364,428.00	0.26
135	600011	华能国际	245,500	2,361,710.00	0.26
136	600563	法拉电子	30,800	2,346,344.00	0.25
137	603501	韦尔股份	23,495	2,334,698.15	0.25
138	002230	科大讯飞	53,900	2,315,005.00	0.25
139	603179	新泉股份	58,900	2,311,236.00	0.25
140	300765	新诺威	91,460	2,307,535.80	0.25
141	000009	中国宝安	268,004	2,304,834.40	0.25
142	002714	牧原股份	52,600	2,293,360.00	0.25
143	600153	建发股份	255,600	2,282,508.00	0.25
144	600837	海通证券	266,000	2,276,960.00	0.25
145	000723	美锦能源	477,700	2,273,852.00	0.25
146	688538	和辉光电	1,143,060	2,263,258.80	0.25
147	688012	中微公司	15,922	2,249,141.72	0.24
148	601857	中国石油	217,800	2,247,696.00	0.24
149	002142	宁波银行	101,610	2,241,516.60	0.24
150	601636	旗滨集团	347,400	2,240,730.00	0.24

151	300498	温氏股份	112,700	2,233,714.00	0.24
152	601118	海南橡胶	490,300	2,230,865.00	0.24
153	603298	杭叉集团	112,300	2,205,572.00	0.24
154	688041	海光信息	30,979	2,178,443.28	0.24
155	600516	方大炭素	504,500	2,174,395.00	0.24
156	688728	格科微	179,507	2,173,829.77	0.24
157	601658	邮储银行	416,000	2,109,120.00	0.23
158	000825	太钢不锈	617,200	2,086,136.00	0.23
159	002422	科伦药业	68,100	2,065,473.00	0.22
160	300782	卓胜微	26,511	2,060,965.14	0.22
161	600170	上海建工	954,400	2,051,960.00	0.22
162	600115	中国东航	510,000	2,045,100.00	0.22
163	000709	河钢股份	1,050,300	2,037,582.00	0.22
164	600219	南山铝业	532,700	2,029,587.00	0.22
165	600584	长电科技	63,700	2,019,927.00	0.22
166	603156	养元饮品	94,700	2,014,269.00	0.22
167	600916	中国黄金	204,500	1,967,290.00	0.21
168	002080	中材科技	150,800	1,945,320.00	0.21
169	601607	上海医药	101,550	1,940,620.50	0.21
170	600352	浙江龙盛	225,000	1,932,750.00	0.21
171	000027	深圳能源	263,200	1,921,360.00	0.21
172	000425	徐工机械	267,700	1,914,055.00	0.21
173	002266	浙富控股	685,200	1,911,708.00	0.21
174	601186	中国铁建	221,100	1,894,827.00	0.21
175	002185	华天科技	230,959	1,882,315.85	0.20
176	002352	顺丰控股	52,300	1,866,587.00	0.20
177	600582	天地科技	270,900	1,866,501.00	0.20
178	600566	济川药业	57,903	1,836,104.13	0.20
179	002223	鱼跃医疗	48,200	1,812,320.00	0.20
180	688561	奇安信	76,011	1,795,379.82	0.19
181	300012	华测检测	177,732	1,787,983.92	0.19
182	600482	中国动力	91,600	1,784,368.00	0.19
183	601688	华泰证券	141,624	1,754,721.36	0.19
184	601788	光大证券	119,200	1,742,704.00	0.19
185	600026	中远海能	111,400	1,738,954.00	0.19
186	000932	华菱钢铁	391,900	1,736,117.00	0.19
187	601990	南京证券	222,300	1,707,264.00	0.18
188	002444	巨星科技	68,200	1,684,540.00	0.18
189	601669	中国电建	301,000	1,682,590.00	0.18
190	601727	上海电气	454,100	1,680,170.00	0.18
191	600704	物产中大	386,700	1,678,278.00	0.18
192	603659	璞泰来	118,745	1,677,866.85	0.18
193	000629	钒钛股份	670,900	1,677,250.00	0.18

194	300223	北京君正	30,200	1,674,288.00	0.18
195	600515	海南机场	531,500	1,668,910.00	0.18
196	002797	第一创业	324,200	1,650,178.00	0.18
197	600522	中天科技	104,100	1,649,985.00	0.18
198	002311	海大集团	35,000	1,646,750.00	0.18
199	600438	通威股份	86,000	1,643,460.00	0.18
200	000728	国元证券	270,700	1,640,442.00	0.18
201	002050	三花智控	84,900	1,619,892.00	0.18
202	688072	拓荆科技	13,420	1,611,876.20	0.17
203	601699	潞安环能	88,400	1,602,692.00	0.17
204	600100	同方股份	314,400	1,600,296.00	0.17
205	601198	东兴证券	199,500	1,588,020.00	0.17
206	600549	厦门钨业	91,300	1,574,925.00	0.17
207	688235	百济神州	13,482	1,561,754.88	0.17
208	002673	西部证券	252,200	1,561,118.00	0.17
209	300413	芒果超媒	74,600	1,559,140.00	0.17
210	601016	节能风电	521,100	1,558,089.00	0.17
211	002152	广电运通	148,340	1,551,636.40	0.17
212	000776	广发证券	127,445	1,551,005.65	0.17
213	600062	华润双鹤	78,880	1,544,470.40	0.17
214	000783	长江证券	315,700	1,524,831.00	0.17
215	600143	金发科技	222,500	1,470,725.00	0.16
216	600674	川投能源	78,000	1,462,500.00	0.16
217	000630	铜陵有色	405,100	1,462,411.00	0.16
218	601919	中远海控	94,200	1,459,158.00	0.16
219	002531	天顺风能	162,500	1,452,750.00	0.16
220	002439	启明星辰	83,900	1,448,114.00	0.16
221	600968	海油发展	344,700	1,420,164.00	0.15
222	603993	洛阳钼业	165,800	1,409,300.00	0.15
223	000703	恒逸石化	196,400	1,392,476.00	0.15
224	600583	海油工程	232,100	1,371,711.00	0.15
225	601997	贵阳银行	260,000	1,370,200.00	0.15
226	002429	兆驰股份	281,300	1,353,053.00	0.15
227	603899	晨光股份	43,200	1,351,296.00	0.15
228	002414	高德红外	227,855	1,342,065.95	0.15
229	600096	云天化	69,000	1,339,980.00	0.15
230	600598	北大荒	104,700	1,307,703.00	0.14
231	002240	盛新锂能	97,000	1,301,740.00	0.14
232	603259	药明康德	30,457	1,193,609.83	0.13
233	600176	中国巨石	107,600	1,188,980.00	0.13
234	603027	千禾味业	87,708	1,166,516.40	0.13
235	600282	南钢股份	232,600	1,158,348.00	0.13
236	002299	圣农发展	84,000	1,145,760.00	0.12

237	601992	金隅集团	821,500	1,125,455.00	0.12
238	601216	君正集团	304,800	1,124,712.00	0.12
239	000983	山西焦煤	104,100	1,073,271.00	0.12
240	000750	国海证券	366,500	1,066,515.00	0.12
241	000338	潍柴动力	65,400	1,062,096.00	0.12
242	601100	恒立液压	22,200	1,034,076.00	0.11
243	000987	越秀资本	202,882	1,006,294.72	0.11
244	600875	东方电气	54,500	1,005,525.00	0.11
245	002841	视源股份	33,900	1,001,067.00	0.11
246	600398	海澜之家	102,900	950,796.00	0.10
247	600529	山东药玻	37,400	947,716.00	0.10
248	300308	中际旭创	6,869	947,097.72	0.10
249	601377	兴业证券	186,980	946,118.80	0.10
250	600655	豫园股份	182,800	941,420.00	0.10
251	300017	网宿科技	119,000	940,100.00	0.10
252	002179	中航光电	24,678	938,997.90	0.10
253	600332	白云山	32,000	938,560.00	0.10
254	600104	上汽集团	67,600	936,936.00	0.10
255	600132	重庆啤酒	15,400	934,780.00	0.10
256	000951	中国重汽	65,080	931,945.60	0.10
257	688036	传音控股	12,140	929,195.60	0.10
258	601319	中国人保	179,700	925,455.00	0.10
259	002472	双环传动	41,900	922,638.00	0.10
260	688981	中芯国际	20,011	922,507.10	0.10
261	600436	片仔癀	4,400	911,548.00	0.10
262	601877	正泰电器	47,800	911,068.00	0.10
263	601601	中国太保	32,600	908,236.00	0.10
264	002602	世纪华通	260,700	894,201.00	0.10
265	600938	中国海油	27,000	891,000.00	0.10
266	000977	浪潮信息	24,490	890,701.30	0.10
267	600390	五矿资本	218,700	885,735.00	0.10
268	600884	杉杉股份	108,400	880,208.00	0.10
269	600839	四川长虹	195,300	876,897.00	0.09
270	601600	中国铝业	113,900	869,057.00	0.09
271	600060	海信视像	34,800	860,952.00	0.09
272	600926	杭州银行	65,600	856,080.00	0.09
273	601666	平煤股份	75,500	845,600.00	0.09
274	601058	赛轮轮胎	59,200	828,800.00	0.09
275	688223	晶科能源	111,041	788,391.10	0.09
276	300433	蓝思科技	42,800	781,100.00	0.08
277	001965	招商公路	65,506	776,901.16	0.08
278	000960	锡业股份	50,000	774,500.00	0.08
279	600642	申能股份	87,250	770,417.50	0.08



280	600803	新奥股份	36,000	748,800.00	0.08
281	300144	宋城演艺	88,000	706,640.00	0.08
282	300073	当升科技	19,200	658,752.00	0.07
283	600161	天坛生物	22,320	544,608.00	0.06
284	601001	晋控煤业	32,200	531,944.00	0.06
285	600511	国药股份	15,500	477,245.00	0.05
286	600177	雅戈尔	63,210	450,055.20	0.05
287	601009	南京银行	41,800	434,302.00	0.05
288	600048	保利发展	33,100	289,956.00	0.03
289	603019	中科曙光	6,300	261,450.00	0.03
290	300015	爱尔眼科	9,416	97,173.12	0.01
291	300142	沃森生物	6,300	71,694.00	0.01
292	000423	东阿阿胶	800	50,080.00	0.01
293	603486	科沃斯	1,000	47,180.00	0.01
294	300529	健帆生物	1,600	43,536.00	0.00
295	603986	兆易创新	400	38,248.00	0.00
296	002850	科达利	500	38,190.00	0.00
297	688180	君实生物	1,311	38,084.55	0.00
298	300474	景嘉微	600	37,938.00	0.00
299	688599	天合光能	2,163	36,597.96	0.00
300	301236	软通动力	1,000	35,210.00	0.00
301	600820	隧道股份	5,300	34,609.00	0.00
302	300347	泰格医药	700	34,020.00	0.00
303	688617	惠泰医疗	74	33,751.40	0.00
304	300759	康龙化成	1,800	33,444.00	0.00
305	002709	天赐材料	1,900	33,364.00	0.00
306	603605	珀莱雅	300	33,297.00	0.00
307	601128	常熟银行	4,240	32,096.80	0.00
308	601155	新城控股	3,600	31,932.00	0.00
309	300496	中科创达	700	31,913.00	0.00
310	000408	藏格矿业	1,300	31,291.00	0.00
311	002203	海亮股份	3,800	30,324.00	0.00
312	300748	金力永磁	2,324	30,119.04	0.00
313	002456	欧菲光	3,800	29,678.00	0.00
314	601162	天风证券	13,600	29,648.00	0.00
315	688169	石头科技	73	28,659.80	0.00
316	002262	恩华药业	1,200	28,488.00	0.00
317	600004	白云机场	3,000	28,440.00	0.00
318	600745	闻泰科技	1,000	28,250.00	0.00
319	002966	苏州银行	3,700	27,750.00	0.00
320	000661	长春高新	300	27,531.00	0.00
321	000400	许继电气	800	27,528.00	0.00
322	603160	汇顶科技	400	27,500.00	0.00

323	300339	润和软件	1,326	27,408.42	0.00
324	600873	梅花生物	2,700	27,054.00	0.00
325	600763	通策医疗	500	27,025.00	0.00
326	002384	东山精密	1,300	26,910.00	0.00
327	002156	通富微电	1,200	26,868.00	0.00
328	603392	万泰生物	400	26,352.00	0.00
329	000066	中国长城	3,000	26,250.00	0.00
330	600487	亨通光电	1,600	25,232.00	0.00
331	601108	财通证券	3,800	25,118.00	0.00
332	300628	亿联网络	680	25,003.60	0.00
333	300070	碧水源	5,900	24,721.00	0.00
334	601567	三星医疗	700	24,500.00	0.00
335	600118	中国卫星	1,100	24,453.00	0.00
336	600072	中船科技	1,800	24,336.00	0.00
337	002432	九安医疗	600	24,324.00	0.00
338	002508	老板电器	1,100	24,310.00	0.00
339	002625	光启技术	1,400	24,290.00	0.00
340	601866	中远海发	9,400	24,252.00	0.00
341	603290	斯达半导	280	24,110.80	0.00
342	300014	亿纬锂能	600	23,952.00	0.00
343	300442	润泽科技	1,000	23,950.00	0.00
344	002938	鹏鼎控股	600	23,856.00	0.00
345	601995	中金公司	800	23,688.00	0.00
346	002340	格林美	3,700	23,569.00	0.00
347	688099	晶晨股份	393	23,312.76	0.00
348	600208	新潮中宝	14,700	23,226.00	0.00
349	600183	生益科技	1,100	23,166.00	0.00
350	603087	甘李药业	500	23,160.00	0.00
351	688385	复旦微电	733	23,001.54	0.00
352	600909	华安证券	5,430	22,860.30	0.00
353	601021	春秋航空	400	22,532.00	0.00
354	000538	云南白药	440	22,506.00	0.00
355	002056	横店东磁	1,800	22,446.00	0.00
356	601901	方正证券	2,900	22,417.00	0.00
357	601799	星宇股份	200	22,408.00	0.00
358	603345	安井食品	300	22,293.00	0.00
359	002273	水晶光电	1,300	22,074.00	0.00
360	601966	玲珑轮胎	1,200	22,044.00	0.00
361	603596	伯特利	560	21,784.00	0.00
362	601211	国泰君安	1,600	21,680.00	0.00
363	605499	东鹏饮料	100	21,575.00	0.00
364	601689	拓普集团	400	21,444.00	0.00
365	688008	澜起科技	373	21,320.68	0.00

366	600585	海螺水泥	900	21,231.00	0.00
367	603858	步长制药	1,400	21,210.00	0.00
368	600536	中国软件	708	21,183.36	0.00
369	000975	山金国际	1,300	21,177.00	0.00
370	002916	深南电路	200	21,154.00	0.00
371	000596	古井贡酒	100	21,107.00	0.00
372	300033	同花顺	200	20,740.00	0.00
373	600893	航发动力	566	20,687.30	0.00
374	600418	江淮汽车	1,300	20,592.00	0.00
375	300408	三环集团	700	20,433.00	0.00
376	600848	上海临港	2,240	20,406.40	0.00
377	002129	TCL 中环	2,350	20,327.50	0.00
378	002049	紫光国微	385	20,251.00	0.00
379	300832	新产业	300	20,232.00	0.00
380	000738	航发控制	1,000	20,070.00	0.00
380	002028	思源电气	300	20,070.00	0.00
381	601615	明阳智能	2,100	19,824.00	0.00
382	002821	凯莱英	300	19,740.00	0.00
383	300207	欣旺达	1,300	19,721.00	0.00
384	000021	深科技	1,300	19,656.00	0.00
384	600741	华域汽车	1,200	19,656.00	0.00
385	600999	招商证券	1,400	19,474.00	0.00
386	000963	华东医药	700	19,467.00	0.00
387	600570	恒生电子	1,100	19,426.00	0.00
388	001979	招商蛇口	2,200	19,338.00	0.00
389	600489	中金黄金	1,300	19,240.00	0.00
390	002001	新和成	1,000	19,200.00	0.00
391	002074	国轩高科	1,000	19,150.00	0.00
392	300751	迈为股份	160	19,116.80	0.00
393	600989	宝丰能源	1,100	19,063.00	0.00
394	002252	上海莱士	2,400	18,768.00	0.00
395	300601	康泰生物	1,200	18,732.00	0.00
396	603260	合盛硅业	400	18,684.00	0.00
397	600486	扬农化工	330	18,628.50	0.00
398	000513	丽珠集团	500	18,605.00	0.00
399	300866	安克创新	260	18,514.60	0.00
400	603369	今世缘	400	18,480.00	0.00
401	601360	三六零	2,400	18,432.00	0.00
402	600754	锦江酒店	800	18,384.00	0.00
403	601099	太平洋	6,000	18,300.00	0.00
404	688363	华熙生物	323	18,272.11	0.00
405	603338	浙江鼎力	300	18,126.00	0.00
406	600845	宝信软件	566	18,072.38	0.00

407	000683	远兴能源	2,600	17,966.00	0.00
408	000988	华工科技	600	17,958.00	0.00
409	601555	东吴证券	3,030	17,877.00	0.00
410	002459	晶澳科技	1,596	17,875.20	0.00
411	300003	乐普医疗	1,200	17,808.00	0.00
412	300661	圣邦股份	215	17,797.70	0.00
413	600699	均胜电子	1,200	17,784.00	0.00
414	603893	瑞芯微	300	17,751.00	0.00
415	000876	新希望	1,900	17,366.00	0.00
416	601066	中信建投	900	17,316.00	0.00
417	600737	中粮糖业	1,800	17,262.00	0.00
418	603198	迎驾贡酒	300	17,250.00	0.00
419	600141	兴发集团	900	17,172.00	0.00
420	002738	中矿资源	640	17,152.00	0.00
421	300037	新宙邦	600	17,136.00	0.00
422	002532	天山铝业	2,100	17,031.00	0.00
423	600702	舍得酒业	300	17,001.00	0.00
424	002557	洽洽食品	600	16,914.00	0.00
425	603233	大参林	1,173	16,773.90	0.00
426	000032	深桑达 A	1,100	16,478.00	0.00
427	688082	盛美上海	194	16,394.94	0.00
428	002648	卫星化学	900	16,182.00	0.00
429	000921	海信家电	500	16,120.00	0.00
430	600801	华新水泥	1,161	15,963.75	0.00
431	600872	中炬高新	700	15,883.00	0.00
432	603589	口子窖	400	15,676.00	0.00
433	002555	三七互娱	1,200	15,660.00	0.00
434	601628	中国人寿	500	15,525.00	0.00
435	600066	宇通客车	600	15,480.00	0.00
436	301269	华大九天	200	15,410.00	0.00
437	600958	东方证券	2,012	15,291.20	0.00
438	600085	同仁堂	400	15,284.00	0.00
439	002517	恺英网络	1,600	15,280.00	0.00
440	000301	东方盛虹	1,900	15,143.00	0.00
441	688213	思特威	311	15,083.50	0.00
442	601336	新华保险	500	15,015.00	0.00
443	002600	领益智造	2,100	14,952.00	0.00
444	002281	光迅科技	400	14,948.00	0.00
445	300146	汤臣倍健	1,100	14,905.00	0.00
446	300699	光威复材	600	14,898.00	0.00
447	000786	北新建材	500	14,830.00	0.00
448	002128	电投能源	700	14,770.00	0.00
449	000623	吉林敖东	1,100	14,740.00	0.00

450	600546	山煤国际	1,000	14,620.00	0.00
451	601958	金钼股份	1,400	14,574.00	0.00
452	603799	华友钴业	658	14,561.54	0.00
453	002008	大族激光	700	14,560.00	0.00
454	600600	青岛啤酒	200	14,554.00	0.00
455	002078	太阳纸业	1,040	14,508.00	0.00
456	000768	中航西飞	600	14,418.00	0.00
457	600166	福田汽车	6,400	14,400.00	0.00
458	002044	美年健康	3,800	14,364.00	0.00
458	601233	桐昆股份	900	14,364.00	0.00
459	300450	先导智能	857	14,251.91	0.00
460	002385	大北农	3,700	14,245.00	0.00
461	600362	江西铜业	600	14,208.00	0.00
462	603939	益丰药房	578	14,189.90	0.00
463	002558	巨人网络	1,500	14,160.00	0.00
464	002353	杰瑞股份	400	14,032.00	0.00
465	600460	士兰微	800	14,008.00	0.00
466	002025	航天电器	300	13,914.00	0.00
467	600705	中航产融	6,200	13,764.00	0.00
468	002624	完美世界	1,800	13,680.00	0.00
469	600521	华海药业	800	13,640.00	0.00
470	603882	金域医学	500	13,595.00	0.00
471	300114	中航电测	300	13,575.00	0.00
472	000807	云铝股份	1,000	13,510.00	0.00
473	002984	森麒麟	560	13,490.40	0.00
474	600985	淮北矿业	800	13,392.00	0.00
475	600426	华鲁恒升	500	13,320.00	0.00
476	000729	燕京啤酒	1,500	13,245.00	0.00
477	002410	广联达	1,380	13,220.40	0.00
478	002180	纳思达	500	13,210.00	0.00
479	000050	深天马 A	1,800	13,104.00	0.00
480	603077	和邦生物	7,900	13,035.00	0.00
481	600329	达仁堂	400	12,956.00	0.00
482	600009	上海机场	400	12,900.00	0.00
483	601179	中国西电	1,600	12,864.00	0.00
484	300418	昆仑万维	399	12,863.76	0.00
485	600637	东方明珠	2,100	12,768.00	0.00
486	600372	中航机载	1,066	12,760.02	0.00
487	000830	鲁西化工	1,100	12,749.00	0.00
488	002939	长城证券	1,900	12,730.00	0.00
489	603288	海天味业	368	12,684.96	0.00
490	002007	华兰生物	800	12,632.00	0.00
491	300122	智飞生物	450	12,613.50	0.00

492	002409	雅克科技	200	12,582.00	0.00
493	300394	天孚通信	140	12,378.80	0.00
494	600038	中直股份	300	12,333.00	0.00
495	600346	恒力石化	880	12,276.00	0.00
496	603000	人民网	600	11,994.00	0.00
497	000895	双汇发展	500	11,885.00	0.00
498	603688	石英股份	400	11,844.00	0.00
499	300136	信维通信	600	11,748.00	0.00
500	300373	扬杰科技	300	11,670.00	0.00
501	002436	兴森科技	1,130	11,661.60	0.00
502	688188	柏楚电子	63	11,626.65	0.00
503	600378	昊华科技	400	11,560.00	0.00
504	300054	鼎龙股份	500	11,340.00	0.00
505	000069	华侨城 A	5,500	11,220.00	0.00
506	000063	中兴通讯	400	11,188.00	0.00
507	000938	紫光股份	500	11,175.00	0.00
508	000999	华润三九	260	11,070.80	0.00
509	600196	复星医药	500	11,070.00	0.00
510	688120	华海清科	58	10,995.64	0.00
511	300999	金龙鱼	400	10,940.00	0.00
512	603529	爱玛科技	400	10,932.00	0.00
513	688256	寒武纪	55	10,926.85	0.00
514	603568	伟明环保	529	10,886.82	0.00
515	600021	上海电力	1,100	10,879.00	0.00
516	600879	航天电子	1,400	10,878.00	0.00
517	002756	永兴材料	300	10,734.00	0.00
518	601800	中国交建	1,200	10,728.00	0.00
519	002739	万达电影	886	10,711.74	0.00
520	601888	中国中免	170	10,623.30	0.00
521	603658	安图生物	230	10,596.10	0.00
522	300487	蓝晓科技	250	10,440.00	0.00
523	002465	海格通信	1,000	10,360.00	0.00
524	600528	中铁工业	1,400	10,248.00	0.00
525	600131	国网信通	600	10,122.00	0.00
526	601633	长城汽车	400	10,120.00	0.00
527	000933	神火股份	500	10,115.00	0.00
528	300454	深信服	200	10,106.00	0.00
529	688009	中国通号	1,678	10,068.00	0.00
530	002120	韵达股份	1,300	10,062.00	0.00
531	300001	特锐德	500	10,060.00	0.00
532	601865	福莱特	500	10,050.00	0.00
533	000878	云南铜业	800	9,968.00	0.00
534	600732	爱旭股份	1,100	9,955.00	0.00

535	603885	吉祥航空	900	9,891.00	0.00
536	601881	中国银河	900	9,774.00	0.00
537	603606	东方电缆	200	9,762.00	0.00
538	600325	华发股份	1,500	9,750.00	0.00
539	002460	赣锋锂业	340	9,741.00	0.00
540	688234	天岳先进	207	9,712.44	0.00
541	000893	亚钾国际	600	9,696.00	0.00
542	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.00
543	300957	贝泰妮	200	9,664.00	0.00
544	601878	浙商证券	900	9,648.00	0.00
545	688122	西部超导	250	9,580.00	0.00
546	002812	恩捷股份	300	9,495.00	0.00
547	600862	中航高科	500	9,390.00	0.00
548	002064	华峰化学	1,300	9,321.00	0.00
549	002236	大华股份	600	9,276.00	0.00
550	600895	张江高科	500	9,240.00	0.00
550	601106	中国一重	4,000	9,240.00	0.00
551	002926	华西证券	1,400	9,226.00	0.00
552	600497	驰宏锌锗	1,700	9,078.00	0.00
553	600588	用友网络	900	9,000.00	0.00
554	002466	天齐锂业	300	8,973.00	0.00
555	601933	永辉超市	3,600	8,928.00	0.00
556	601717	郑煤机	600	8,880.00	0.00
557	600498	烽火通信	556	8,840.40	0.00
558	688114	华大智造	186	8,818.26	0.00
559	600535	天士力	700	8,806.00	0.00
560	000519	中兵红箭	600	8,802.00	0.00
561	688065	凯赛生物	192	8,714.88	0.00
562	000937	冀中能源	1,300	8,710.00	0.00
563	603806	福斯特	588	8,643.60	0.00
564	600918	中泰证券	1,500	8,505.00	0.00
565	300251	光线传媒	1,000	8,410.00	0.00
566	002568	百润股份	496	8,347.68	0.00
567	000997	新大陆	600	8,346.00	0.00
568	000733	振华科技	200	8,306.00	0.00
569	600109	国金证券	1,100	8,305.00	0.00
570	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.00
571	688111	金山办公	35	7,962.50	0.00
572	000617	中油资本	1,400	7,728.00	0.00
573	601928	凤凰传媒	700	7,672.00	0.00
574	600779	水井坊	200	7,526.00	0.00
575	601231	环旭电子	439	7,045.95	0.00
576	688187	时代电气	136	6,715.68	0.00

577	601238	广汽集团	800	6,192.00	0.00
578	600733	北汽蓝谷	700	5,656.00	0.00
579	300763	锦浪科技	100	4,164.00	0.00
580	002463	沪电股份	110	4,015.00	0.00
581	600867	通化东宝	400	3,348.00	0.00
582	000002	万 科 A	413	2,862.09	0.00
583	000831	中国稀土	100	2,535.00	0.00
584	002603	以岭药业	140	2,146.20	0.00
585	601168	西部矿业	100	1,795.00	0.00
586	600079	人福医药	100	1,717.00	0.00
587	600977	中国电影	100	1,076.00	0.00
588	601456	国联证券	100	964.00	0.00
589	600061	国投资本	152	858.80	0.00
590	002244	滨江集团	100	726.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	475,100	2,955,122.00	0.32
2	688819	天能股份	115,749	2,761,771.14	0.30
3	002015	协鑫能科	337,500	2,686,500.00	0.29
4	601018	宁波港	538,600	1,831,240.00	0.20
5	688349	三一重能	73,683	1,830,285.72	0.20
6	002507	涪陵榨菜	122,320	1,498,420.00	0.16
7	002221	东华能源	144,300	1,184,703.00	0.13
8	001872	招商港口	49,500	952,875.00	0.10
9	688375	国博电子	13,352	943,185.28	0.10
10	300383	光环新网	108,700	918,515.00	0.10
11	688050	爱博医疗	12,396	908,874.72	0.10
12	002019	亿帆医药	72,600	897,336.00	0.10
13	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.04
14	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
15	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.02
16	301392	汇成真空	2,189	128,899.54	0.01
17	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.01
18	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.01
19	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.01
20	688720	艾森股份	1,644	66,647.76	0.01
21	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.01
22	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.01
23	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.01
24	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.01
25	603712	七一二	2,800	50,932.00	0.01



26	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
27	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.00
28	603344	星德胜	1,813	42,892.99	0.00
29	001359	平安电工	1,833	40,513.63	0.00
30	688563	航材股份	692	36,592.96	0.00
31	001306	夏厦精密	631	34,067.69	0.00
32	688548	广钢气体	3,688	33,671.44	0.00
33	603312	西典新能	1,296	33,263.00	0.00
34	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00
35	001379	腾达科技	2,128	29,183.34	0.00
36	603456	九洲药业	2,100	28,812.00	0.00
37	603375	盛景微	714	28,339.56	0.00
38	603296	华勤技术	498	27,504.54	0.00
39	600808	马钢股份	13,500	27,270.00	0.00
40	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.00
41	300568	星源材质	3,049	25,001.80	0.00
42	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
43	300024	机器人	2,400	23,376.00	0.00
44	300567	精测电子	400	22,604.00	0.00
45	688702	盛科通信	549	22,234.50	0.00
46	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
47	000739	普洛药业	1,500	20,355.00	0.00
48	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
49	603737	三棵树	540	19,585.80	0.00
50	002151	北斗星通	800	19,344.00	0.00
51	600416	湘电股份	1,900	18,886.00	0.00
52	601033	永兴股份	1,181	18,848.76	0.00
53	688582	芯动联科	648	18,247.68	0.00
54	002145	中核钛白	5,500	18,040.00	0.00
55	688390	固德威	321	18,014.52	0.00
56	002518	科士达	1,000	17,700.00	0.00
57	301371	敷尔佳	564	17,517.84	0.00
58	688037	芯源微	190	16,910.00	0.00
59	601828	美凯龙	6,400	16,320.00	0.00
60	300604	长川科技	600	16,302.00	0.00
61	688652	京仪装备	416	16,261.44	0.00
62	600383	金地集团	4,600	15,640.00	0.00
63	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
64	301525	儒竞科技	266	14,970.48	0.00
65	301421	波长光电	332	14,352.36	0.00
66	688521	芯原股份	528	14,124.00	0.00
67	300676	华大基因	400	14,004.00	0.00
68	600271	航天信息	1,900	13,984.00	0.00

69	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
70	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
71	300212	易华录	800	13,464.00	0.00
72	300558	贝达药业	400	13,020.00	0.00
73	002268	电科网安	900	12,807.00	0.00
74	688005	容百科技	548	12,757.44	0.00
75	301550	斯菱股份	260	12,456.60	0.00
76	688220	翱捷科技	328	12,286.88	0.00
77	301165	锐捷网络	400	11,936.00	0.00
78	300633	开立医疗	300	11,874.00	0.00
79	002865	钧达股份	300	11,514.00	0.00
80	300769	德方纳米	400	11,280.00	0.00
81	688612	威迈斯	422	11,212.54	0.00
82	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
83	300803	指南针	300	10,923.00	0.00
84	600559	老白干酒	600	10,908.00	0.00
85	688567	孚能科技	1,126	10,809.60	0.00
86	688002	睿创微纳	385	10,768.45	0.00
87	300595	欧普康视	680	10,662.40	0.00
88	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
89	688627	精智达	222	10,305.24	0.00
90	000516	国际医学	2,200	10,296.00	0.00
91	002389	航天彩虹	700	9,723.00	0.00
92	688052	纳芯微	91	9,352.98	0.00
93	002261	拓维信息	800	8,856.00	0.00
94	301413	安培龙	214	8,848.90	0.00
95	600859	王府井	700	8,218.00	0.00
96	300459	汤姆猫	2,400	8,136.00	0.00
97	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
98	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
99	600258	首旅酒店	600	7,410.00	0.00
100	301520	万邦医药	160	6,620.80	0.00
101	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
102	603193	润本股份	303	5,572.17	0.00
103	688657	浩辰软件	147	5,433.12	0.00
104	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
105	688536	思瑞浦	52	5,086.12	0.00
106	000799	酒鬼酒	100	4,387.00	0.00
107	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
108	603075	热威股份	182	3,212.30	0.00
109	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
110	400174	中天 3	100	1.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600919	江苏银行	17,446,155.95	1.75
2	002027	分众传媒	16,439,378.00	1.65
3	600406	国电南瑞	16,240,988.00	1.63
4	688037	芯源微	16,182,741.87	1.63
5	002558	巨人网络	16,124,879.00	1.62
6	688516	奥特维	15,547,221.95	1.56
7	600026	中远海能	15,532,377.00	1.56
8	300919	中伟股份	14,840,037.20	1.49
9	601328	交通银行	14,719,827.00	1.48
10	300124	汇川技术	14,541,897.00	1.46
11	601600	中国铝业	14,300,673.00	1.44
12	688002	睿创微纳	14,299,952.14	1.44
13	000425	徐工机械	14,275,467.00	1.43
14	600276	恒瑞医药	14,154,358.40	1.42
15	600309	万华化学	14,120,340.92	1.42
16	601166	兴业银行	14,083,473.00	1.41
17	002444	巨星科技	13,900,901.34	1.40
18	002594	比亚迪	13,899,560.00	1.40
19	300567	精测电子	13,663,414.00	1.37
20	300769	德方纳米	13,648,525.80	1.37

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	000425	徐工机械	16,771,705.00	1.69
2	002602	世纪华通	16,208,292.60	1.63
3	688037	芯源微	15,989,447.10	1.61
4	002558	巨人网络	15,961,908.00	1.60
5	603259	药明康德	15,205,566.00	1.53
6	688516	奥特维	14,780,213.97	1.48
7	601939	建设银行	14,685,621.00	1.48
8	688002	睿创微纳	14,371,272.67	1.44
9	002027	分众传媒	13,935,464.00	1.40
10	300567	精测电子	13,920,636.00	1.40
11	000630	铜陵有色	13,861,349.00	1.39

12	601288	农业银行	13,852,407.00	1.39
13	601600	中国铝业	13,773,751.00	1.38
14	300459	汤姆猫	13,672,144.00	1.37
15	300769	德方纳米	13,437,187.00	1.35
16	000932	华菱钢铁	13,426,693.01	1.35
17	688385	复旦微电	13,357,347.96	1.34
18	300604	长川科技	13,308,805.00	1.34
19	600026	中远海能	13,140,065.00	1.32
20	688521	芯原股份	13,108,503.43	1.32

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	3,959,210,432.68
卖出股票收入（成交）总额	3,971,747,243.07

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，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	259,950.44
2	应收清算款	887,964.92
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	91,730.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,239,645.85

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

数（户）	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
81,308	17,259.92	10,898,039.53	0.78	1,392,471,835.34	99.22

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）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	942,000.05	0.07

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002年11月8日）	1,762,466,123.89
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	1,415,635,151.49
本报告期基金总申购份额	76,672,242.13
减：本报告期基金总赎回份额	88,937,518.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,403,369,874.87

## § 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	1	3,115,483,506.50	39.29	2,946,942.04	39.48	-
浙商证券	1	3,016,386,435.45	38.04	2,823,044.76	37.82	-
银河证券	2	1,044,042,032.27	13.17	986,771.93	13.22	-
招商证券	1	402,490,724.83	5.08	376,692.03	5.05	-
中信建投	1	238,216,563.02	3.00	225,330.87	3.02	-
申万宏源	2	112,436,365.69	1.42	106,355.21	1.42	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	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：

2024 年 6 月完成新增托管在工商银行的中信证券深交所 018215 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 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	83,110.81	100.00	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 12 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（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
3	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 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
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（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
5	华安基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 2 日
6	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（肯	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2024 年 2 月 21 日

	特股份)	定媒介	
7	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
8	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
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 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
10	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
11	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
12	华安中国 A 股增强指数 2024 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
13	华安中国 A 股增强指数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
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（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

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  
无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日