

**华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2021 年年度报告**  
**2021 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

## §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。本年度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 2022 年 3 月 25 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	16
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 管理层对财务报表的责任.....	17
6.4 注册会计师的责任.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69

8.6	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 .....	70
8.7	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 .....	70
8.8	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 .....	70
8.9	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 .....	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
8.12	投资组合报告附注 .....	71
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	73
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.4	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的情况 .....	73
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	73
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>73</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>74</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	74
11.2	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 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	74
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	75
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.9	其他重大事件 .....	76
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>79</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>80</b>
13.1	备查文件目录 .....	80
13.2	存放地点 .....	81
13.3	查阅方式 .....	81

## §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
基金主代码	515390
交易代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,130,683,016.00 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	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型

	基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	service@huan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		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
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市浦东新区杨高南路 188 号
--------	-------------------------	-------------------

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2021 年	2020 年	2019 年 12 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	60,909,220.73	27,405,932.36	325,077.53
本期利润	24,022,697.47	58,637,381.43	3,081,047.82
加权平均基金份额本期利润	0.0762	0.2910	0.0070
本期加权平均净值利润率	5.80%	27.10%	0.69%
本期基金份额净值增长率	0.99%	28.61%	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	348,139,153.34	82,385,480.15	325,077.53
期末可供分配基金份额利润	0.3079	0.1895	0.0007
期末基金资产净值	1,478,822,169.34	562,947,592.89	445,764,063.82
期末基金份额净值	1.3079	1.2951	1.0070
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	30.79%	29.51%	0.70%

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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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）。

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折

算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.62%	0.79%	1.52%	0.79%	0.10%	0.00%
过去六个月	-2.99%	1.01%	-5.43%	1.02%	2.44%	-0.01%
过去一年	0.99%	1.16%	-5.20%	1.17%	6.19%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	30.79%	1.27%	26.97%	1.30%	3.82%	-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

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2019 年 12 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日)

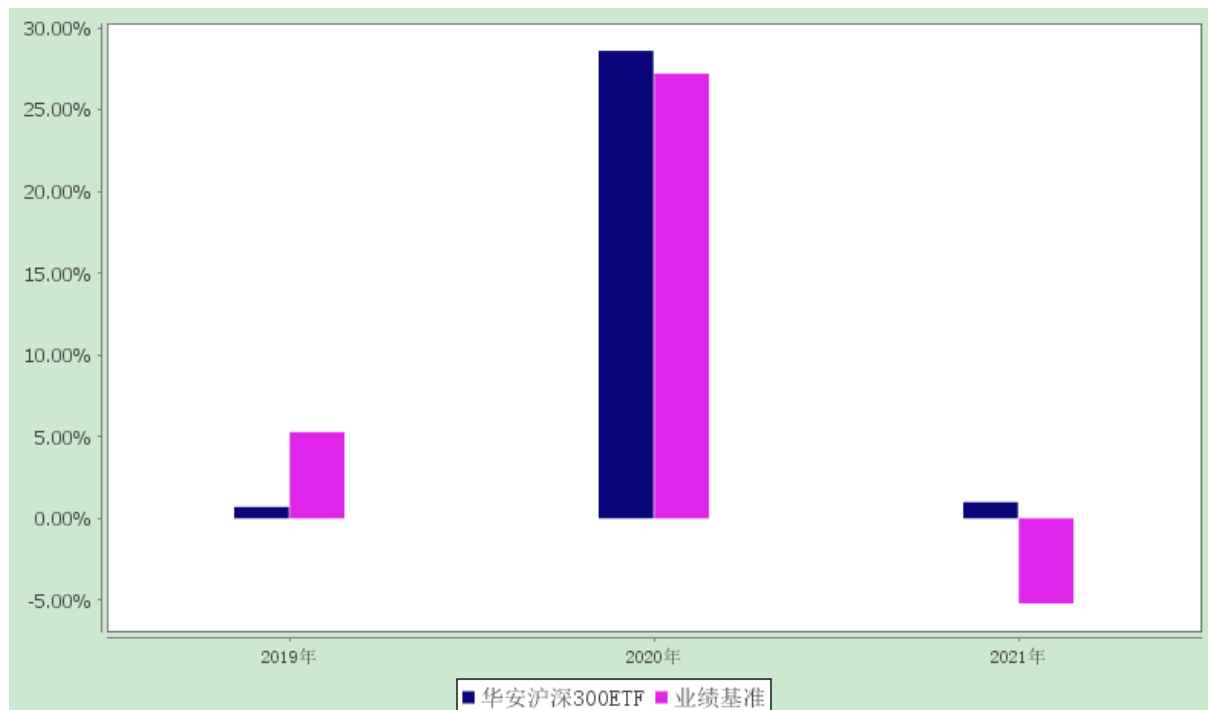




### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2019年12月13日）至本报告期末未发生利润分配。

## §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2021年12月31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188只证券投资基金，管理

资产规模达到 5,968.62 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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	本基金的基金经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2019-12-13	-	18 年	理学博士，18 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，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金)、华安中证银行指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为

				<p>华安中证银行指数型证券投资基金)的基金经理。2015年7月至2021年1月,担任华安创业板50指数分级证券投资基金(2021年1月起转型为华安创业板50指数型证券投资基金)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月起,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月起,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月起,同时担任华安中证电子50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年10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《证券业从业人员资格管理办法》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	12.00	58,592,249,044.88	2008-04-25
	私募资产管理计划	3.00	689,962,322.77	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	15.00	59,282,211,367.65	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理许之彦先生兼任私募资产管理计划投资经理,其薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 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

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 公平交易制度和控制方法

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，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。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价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（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。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

在严格执行《基金管理公司公平交易制度指导意见》的基础上，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》，制定了《华安基金管理有限公司基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，进一步完善公司的防范利益冲突机制，健全公平交易控制体系和防范利益冲突的管理措施。

投资研究部负责宏观、策略、行业以及上市公司的研究，研究员在为公司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、投资研究会议讨论、研究报告登录在研究报告管理系统中等方式，确保公募基金基金经理与私募资产管理计划投资经理可以公平享有信息获取机会。

公司实行强制公平交易机制，确保公募基金与私募资产管理计划等各投资组合享有公平的交易执行机会，避免在交易环节出现利益冲突的情况。

同一基金经理同时管理公募基金与私募资产管理计划的情况下，兼任的基金经理保持同一个券（股）投资逻辑与决策、交易过程的一致性与同步性，避免出现风格相似的公募基金与私募资产管理计划在同一个期间内业绩偏差较大的情况。

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，并定期对各类投资组合间的同日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合间的隔日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的同向交易价差进行检查与分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。

本报告期内，同一基金经理管理的各投资组合公平交易执行情况良好，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 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 4 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

2021 年，全球经济呈现“前高后低”的态势，新冠病毒变种仍对全球经济造成了一定扰动，供应链矛盾频现。发达经济体的强力经济刺激在快速修复经济的同时也引发了高通胀，随着经济增速放缓，CPI 持续高涨，呈现出“类滞胀”的特征。

2021 年国内 GDP 增长 8.1%，两年平均增长 5.1%。整体来看，2021 年国内经济全面复苏，与疫情前相比，传统经济动能有所下滑，高端制造与高新技术等新经济动能提升，由于局部疫情的反复，消费仍然偏弱，下半年来，国内经济增长面临的压力增大。

A 股市场 2021 年宽幅震荡，呈现结构性行情。中小盘风格相对占优。全年上证 50 下跌 10.06%，沪深 300 下跌 5.2%，中证 500 上证 15.58%，创业板指上涨 12.02%。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，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

截止 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.3079 元，本报告期份额净值增长率为 0.99%，同期业绩比较基准增长率为-5.20%。

#### 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 2022 年，受发达经济体货币政策转向，海外流动性收紧预期、通胀上行等因素影响，全球经济仍面临较多不确定性。对于国内经济，出口对经济的拉动下行，房地产投资仍维持低位，基建投资的增速有望回升，消费回升仍有较大潜力。总体而言，“稳增长”将是政策主线，政策调控和逆周期调节为经济稳增长保驾护航。

在基数效应影响下，企业盈利增速全面回落，业绩保持韧性并且处于产业升级风口的行业与板块是值得关注的方向。市场风格将趋向均衡，蓝筹价值有估值修复的动力，而新兴成长在经过调整后估值下修，投资价值提升。沪深 300 指数成分股囊括了各个行业的优质资产，配置价值依然突出。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

合规和稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实各项法律法规和监管要求，督促公司各项业务平稳、有序开展。

(3) 强化内控建设，推动落实公司各项业务操作流程标准化，进一步细化各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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、投资研究部负责人、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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 26961 号

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：



## 6.1 审计意见

### (一) 我们审计的内容

我们审计了华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华安沪深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### (二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华安沪深 300ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安沪深 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层对财务报表的责任

华安沪深 300ETF 基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安沪深 300ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安沪深 300ETF 基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安沪深 300ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

魏佳亮 楼茜蓉

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 25 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	68,280,407.09	10,571,850.28
结算备付金		7,467,011.88	6,433,143.85
存出保证金		3,027,892.69	2,168,711.24
交易性金融资产	7.4.7.2	1,433,335,793.88	543,586,956.76
其中：股票投资		1,431,744,793.88	543,296,956.76
基金投资		-	-
债券投资		1,591,000.00	290,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,830,922.20	1,066,830.84
应收利息	7.4.7.5	8,781.47	4,508.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,513,950,809.21</b>	<b>563,832,001.51</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>2020 年 12 月 31 日</b>
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		19,735,212.75	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		88,012.50	56,285.07
应付托管费		29,337.49	18,761.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,759,784.51	553,163.12
应交税费		-	37,198.75
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	13,516,292.62	219,000.00
<b>负债合计</b>		<b>35,128,639.87</b>	<b>884,408.62</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,130,683,016.00	434,683,016.00
未分配利润	7.4.7.10	348,139,153.34	128,264,576.89
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,478,822,169.34</b>	<b>562,947,592.89</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,513,950,809.21</b>	<b>563,832,001.51</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3079 元，基金份额总额 1,130,683,016.00 份。

## 7.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>28,952,871.96</b>	<b>61,084,142.46</b>
1.利息收入		175,540.95	151,863.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	175,299.42	151,774.83
债券利息收入		241.53	88.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		64,070,976.37	28,733,410.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	57,281,470.87	23,583,456.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	255,184.13	137,525.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	663,219.37	2,238,233.01
股利收益	7.4.7.15	5,871,102.00	2,774,195.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-36,886,523.26	31,231,449.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,592,877.90	967,419.45
<b>减：二、费用</b>		<b>4,930,174.49</b>	<b>2,446,761.03</b>
1. 管理人报酬		611,432.40	323,368.50

2. 托管费		203,810.82	107,789.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,783,233.96	1,676,861.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,811.57	8,057.90
7. 其他费用	7.4.7.19	327,885.74	330,683.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>24,022,697.47</b>	<b>58,637,381.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,022,697.47</b>	<b>58,637,381.43</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	434,683,016.00	128,264,576.89	562,947,592.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,022,697.47	24,022,697.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	696,000,000.00	195,851,878.98	891,851,878.98
其中：1.基金申购款	1,616,000,000.00	482,320,893.73	2,098,320,893.73
2.基金赎回款	-920,000,000.00	-286,469,014.75	-1,206,469,014.75

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,130,683,016.00	348,139,153.34	1,478,822,169.34
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	442,683,016.00	3,081,047.82	445,764,063.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,637,381.43	58,637,381.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-8,000,000.00	66,546,147.64	58,546,147.64
其中：1.基金申购款	718,000,000.00	99,217,830.04	817,217,830.04
2.基金赎回款	-726,000,000.00	-32,671,682.40	-758,671,682.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	434,683,016.00	128,264,576.89	562,947,592.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 2022 年 3 月 25 日批准报出。



## 7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为

投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	68,280,407.09	10,571,850.28
定期存款	-	-
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	-	-
合计	68,280,407.09	10,571,850.28

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,434,295,357.78	1,431,744,793.88	-2,550,563.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,591,000.00	1,591,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,591,000.00	1,591,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,435,886,357.78	1,433,335,793.88	-2,550,563.90
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	510,193,697.40	543,296,956.76	33,103,259.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	290,000.00	290,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	290,000.00	290,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	510,483,697.40	543,586,956.76	33,103,259.36

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	24,111,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	24,111,420.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义	公允价值		备注



	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,314,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,314,120.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值 公允价值变动  
 IF2203 沪深 300 指数 16.00 23,762,880.00 -348,540.00  
 减：可抵销期货暂收款 348,540.00  
 股指期货投资净额 -  
 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,765.35	1,166.50
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,905.68	3,277.90
应收债券利息	34.87	20.80
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	75.57	43.34
合计	8,781.47	4,508.54

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,759,784.51	553,163.12
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,759,784.51	553,163.12

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付替代款	13,130,273.07	-
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
可退替代款	172,019.55	-
预提费用	179,000.00	184,000.00
合计	13,516,292.62	219,000.00

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。

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	434,683,016.00	434,683,016.00
本期申购	1,616,000,000.00	1,616,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-920,000,000.00	-920,000,000.00
本期末	1,130,683,016.00	1,130,683,016.00

#### 7.4.7.10 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	82,385,480.15	45,879,096.74	128,264,576.89
本期利润	60,909,220.73	-36,886,523.26	24,022,697.47
本期基金份额交易产生的变动数	273,477,570.08	-77,625,691.10	195,851,878.98
其中：基金申购款	551,014,647.18	-68,693,753.45	482,320,893.73
基金赎回款	-277,537,077.10	-8,931,937.65	-286,469,014.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,772,270.96	-68,633,117.62	348,139,153.34

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	58,036.75
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	113,863.27	51,339.89
其他	3,399.40	1,749.07

合计	175,299.42	151,774.83
----	------------	------------

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	41,419,754.26	18,092,159.09
股票投资收益——赎回差价收入	15,861,716.61	5,491,297.90
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	57,281,470.87	23,583,456.99

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,116,918,331.53	429,323,678.26
减：卖出股票成本总额	1,075,498,577.27	411,231,519.17
买卖股票差价收入	41,419,754.26	18,092,159.09

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,206,469,014.75	758,671,682.40
减：现金支付赎回款总额	456,253,290.75	228,247,868.40
减：赎回股票成本总额	734,354,007.39	524,932,516.10
赎回差价收入	15,861,716.61	5,491,297.90

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
----	---	--

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	255,184.13	137,525.12
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	255,184.13	137,525.12

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,900,713.92	596,595.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,645,300.00	459,000.00
减：应收利息总额	229.79	69.90
买卖债券差价收入	255,184.13	137,525.12

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出期货成交总额	694,980.00	2,305,380.00
减：卖出期货成本总额	-	-
减：买卖期货差价收入应缴纳增值税额	31,760.63	67,146.99
买卖期货差价收入	663,219.37	2,238,233.01

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,871,102.00	2,774,195.44
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,871,102.00	2,774,195.44

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-35,653,823.26	30,347,289.07
——股票投资	-35,653,823.26	30,347,289.07
——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	-1,232,700.00	884,160.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-1,232,700.00	884,160.00
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	-36,886,523.26	31,231,449.07

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	1,592,877.90	967,391.15
其他	-	28.30
合计	1,592,877.90	967,419.45

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,783,233.96	1,676,861.85
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	3,783,233.96	1,676,861.85

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	59,000.00	64,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
指数使用费	140,427.09	140,000.00
银行汇划费	8,458.65	6,683.28
合计	327,885.74	330,683.28

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据华安基金管理有限公司于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2022]469 号文核准，华安基金管理有限公司股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
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
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司
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(“华安沪深 300ETF 联接基金”)	本基金的联接基金

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据华安基金公司于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经华安基金公司股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2021]669 号文核准，华安基金公司股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的华安基金公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬



**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	611,432.40	323,368.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支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：

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	203,810.82	107,789.50

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：

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

**7.4.10.4.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	79.00	0.00%	32,000,679.00	7.36%
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	60,202,500.00	5.32%	50,667,100.00	11.66%

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020年12月31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	68,280,407.09	58,036.75	10,571,850.28	98,685.87

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。

#### 7.4.10.6 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					
2021年1月1日至2021年12月31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	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安证券股份有限公司	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安证券股份有限公司	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80

公司					
国泰君安证 券股份有限 公司	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安证 券股份有限 公司	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安证 券股份有限 公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安证 券股份有限 公司	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安证 券股份有限 公司	301009	可靠股份	网下申购	6,806.00	85,347.24
国泰君安证 券股份有限 公司	688276	百克生物	网下申购	2,306.00	84,242.22
国泰君安证 券股份有限 公司	688087	英科再生	网下申购	1,777.00	39,218.03
国泰君安证 券股份有限 公司	113042	上银转债	老股东配 售	3,170.00	317,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113045	环旭转债	老股东配 售	220.00	22,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113049	长汽转债	老股东配 售	140.00	14,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113050	南银转债	老股东配 售	1,760.00	176,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688718	唯赛勃	网下申购	3,145.00	18,490.24
国泰君安证 券股份有限 公司	301037	保立佳	网下申购	1,923.00	28,498.86
国泰君安证 券股份有限 公司	605507	国邦医药	网下申购	1,202.00	39,149.14
国泰君安证	605589	圣泉集团	网下申购	1,750.00	42,017.50

券股份有限 公司					
国泰君安证 券股份有限 公司	601825	沪农商行	网下申购	15,480.00	137,772.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688187	时代电气	网下申购	3,330.00	105,017.88
国泰君安证 券股份有限 公司	688767	博拓生物	网下申购	1,181.00	41,007.57
国泰君安证 券股份有限 公司	688232	新点软件	网下申购	4,094.00	199,510.65
国泰君安证 券股份有限 公司	688190	云路股份	网下申购	1,462.00	68,513.93
国泰君安证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	老股东配 售	15,910.00	1,591,000.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	688698	伟创电气	网下申购	4,751.00	51,328.62
国泰君安证 券股份有限 公司	110073	国投转债	老股东配 售	220.00	22,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113044	大秦转债	老股东配 售	2,560.00	256,000.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

(1) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 796,528 股托管人招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 40,235,984.99 元，估值总额为人民币 38,798,878.88 元，占基金资产净值的比例为 2.62%(2020 年 12 月 31 日：无)。

(2) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有 290,500 股国泰君安 A 股普通股, 成本总额为人民币 5,110,640.41 元, 估值总额为人民币 5,197,045.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.35%(2020 年 12 月 31 日: 无)。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末 (2021 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688206	概伦电子	2021-12-20	2022-06-28	新股限售	28.28	33.01	3,240.00	91,627.20	106,952.40	-
688768	容知日新	2021-07-16	2022-01-26	新股限售	18.23	108.54	907.00	16,534.61	98,445.78	-
688787	海天瑞声	2021-08-05	2022-02-14	新股限售	36.94	87.35	817.00	30,179.98	71,364.95	-
688091	上海谊众	2021-09-01	2022-03-09	新股限售	38.10	42.81	1,383.00	52,692.30	59,206.23	-
688501	青达环保	2021-07-09	2022-01-17	新股限售	10.57	21.11	1,759.00	18,592.63	37,132.49	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539.00	2,786.63	23,829.19	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782.00	6,482.78	20,378.92	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股限售	15.48	21.53	915.00	14,164.20	19,699.95	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股限售	10.07	16.76	1,071.00	10,784.97	17,949.96	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股限售	22.70	49.02	315.00	7,150.50	15,441.30	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股限售	8.34	48.99	290.00	2,418.60	14,207.10	-

30103 5	润丰 股份	2021- 07-21	2022- 01-28	新股 限售	22.04	56.28	240.00	5,289. 60	13,507 .20	-
30101 7	漱玉 平民	2021- 06-23	2022- 01-05	新股 限售	8.86	23.80	555.00	4,917. 30	13,209 .00	-
30117 7	迪阿 股份	2021- 12-08	2022- 06-15	新股 限售	116.88	116.08	113.00	13,207 .44	13,117 .04	-
30103 9	中集 车辆	2021- 07-01	2022- 01-10	新股 限售	6.96	12.51	1,032. 00	7,182. 72	12,910 .32	-
30102 0	密封 科技	2021- 06-28	2022- 01-06	新股 限售	10.64	30.44	421.00	4,479. 44	12,815 .24	-
30113 8	华研 精机	2021- 12-08	2022- 06-15	新股 限售	26.17	44.86	285.00	7,458. 45	12,785 .10	-
30102 6	浩通 科技	2021- 07-08	2022- 01-17	新股 限售	18.03	62.73	203.00	3,660. 09	12,734 .19	-
30102 1	英诺 激光	2021- 06-28	2022- 01-06	新股 限售	9.46	41.43	290.00	2,743. 40	12,014 .70	-
30104 8	金鹰 重工	2021- 08-11	2022- 02-28	新股 限售	4.13	12.96	843.00	3,481. 59	10,925 .28	-
30116 6	优宁 维	2021- 12-21	2022- 06-28	新股 限售	86.06	94.50	102.00	8,778. 12	9,639. 00	-
30104 5	天禄 科技	2021- 08-06	2022- 02-17	新股 限售	15.81	28.37	335.00	5,296. 35	9,503. 95	-
30077 4	倍杰 特	2021- 07-26	2022- 02-16	新股 限售	4.57	21.08	444.00	2,029. 08	9,359. 52	-
30118 9	奥尼 电子	2021- 12-21	2022- 06-28	新股 限售	66.18	56.62	165.00	10,919 .70	9,342. 30	-
30104 0	中环 海陆	2021- 07-26	2022- 02-07	新股 限售	13.57	38.51	241.00	3,270. 37	9,280. 91	-
30117 9	泽宇 智能	2021- 12-01	2022- 06-08	新股 限售	43.99	50.77	182.00	8,006. 18	9,240. 14	-
30119 9	迈赫 股份	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 限售	29.28	32.00	270.00	7,905. 60	8,640. 00	-
30119 0	善水 科技	2021- 12-17	2022- 06-24	新股 限售	27.85	27.46	308.00	8,577. 80	8,457. 68	-
30102 5	读客 文化	2021- 07-06	2022- 01-24	新股 限售	1.55	20.88	403.00	624.65	8,414. 64	-
30102 8	东亚 机械	2021- 07-12	2022- 01-20	新股 限售	5.31	13.50	585.00	3,106. 35	7,897. 50	-
30081 4	中富 电路	2021- 08-04	2022- 02-14	新股 限售	8.40	23.88	328.00	2,755. 20	7,832. 64	-
30109 6	百诚 医药	2021- 12-13	2022- 06-20	新股 限售	79.60	78.53	99.00	7,880. 40	7,774. 47	-
30105 5	张小 泉	2021- 08-26	2022- 03-07	新股 限售	6.90	21.78	355.00	2,449. 50	7,731. 90	-

301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股限售	21.76	29.20	262.00	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股限售	57.27	53.71	138.00	7,903.26	7,411.98	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股限售	30.73	29.14	251.00	7,713.23	7,314.14	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307.00	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	177.00	6,426.87	6,287.04	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153.00	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144.00	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155.00	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-
<b>7.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	配债未上市	100.00	100.00	15,910.00	1,591,000.00	1,591,000.00	-

注：1.根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2.根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 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，将风险控制在此可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.11%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

### 7.4.13.3 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 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。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%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.16%。

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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 1,499,188,462.50 元，超过经确认的当日净赎回金额。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	68,280,407.09	-	-	-	68,280,407.09
结算备付金	7,467,011.88	-	-	-	7,467,011.88
存出保证金	3,027,892.69	-	-	-	3,027,892.69
交易性金融资产	1,591,000.00	-	-	1,431,744,793.88	1,433,335,793.88
应收证券清算款	-	-	-	1,830,922.20	1,830,922.20
应收利息	-	-	-	8,781.47	8,781.47
资产总计	80,366,311.66	-	-	1,433,584,497.55	1,513,950,809.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	19,735,212.75	19,735,212.75
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	88,012.50	88,012.50
应付托管费	-	-	-	29,337.49	29,337.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,759,784.51	1,759,784.51
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,516,292.62	13,516,292.62

负债总计	-	-	-	35,128,639.87	35,128,639.87
利率敏感度缺口	80,366,311.66	-	-	1,398,455,857.68	1,478,822,169.34
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,571,850.28	-	-	-	10,571,850.28
结算备付金	6,433,143.85	-	-	-	6,433,143.85
存出保证金	2,168,711.24	-	-	-	2,168,711.24
交易性金融资产	290,000.00	-	-	543,296,956.76	543,586,956.76
应收证券清算款	-	-	-	1,066,830.84	1,066,830.84
应收利息	-	-	-	4,508.54	4,508.54
资产总计	19,463,705.37	-	-	544,368,296.14	563,832,001.51
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,285.07	56,285.07
应付托管费	-	-	-	18,761.68	18,761.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	553,163.12	553,163.12
应交税费	-	-	-	37,198.75	37,198.75
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,000.00	219,000.00
负债总计	-	-	-	884,408.62	884,408.62
利率敏感度缺口	19,463,705.37	-	-	543,483,887.52	562,947,592.89

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.11%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,431,744,793.88	96.82	543,296,956.76	96.51
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	-	-	-	-
合计	1,431,744,793.88	96.82	543,296,956.76	96.51

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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	73,280,000.00	27,520,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-73,280,000.00	-27,520,000.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 2,098,320,893.73 元(2020 年度：817,217,830.04 元)，其中包括以股票支付的申购款 1,226,094,774.15 元和以现金支付的申购款 872,226,119.58 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 542,101,348.04 元和以现金支付的申购款 275,116,482.00 元)。

##### (2) 公允价值

###### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,430,908,055.41 元，属于第二层次的余额为 1,596,504.49 元，属于第三层次的余额为 831,233.98 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 542,669,282.89 元，第二层次 917,673.87 元，无第三层次)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于 2021 年 1 月 1 日，本基金未持有第三层次资产。2021 年度购买第三层次资产金额为 784,686.57 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为 831,233.98 元(2020 年 12 月 31 日：无)。2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额为 385,912.29 元 (2020 年度：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(4) 除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,431,744,793.88	94.57
	其中:股票	1,431,744,793.88	94.57



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,591,000.00	0.11
	其中：债券	1,591,000.00	0.11
	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	75,747,418.97	5.00
8	其他各项资产	4,867,596.36	0.32
9	合计	1,513,950,809.21	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	15,588,922.16	1.05
B	采矿业	31,136,045.60	2.11
C	制造业	845,036,936.15	57.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,419,225.00	2.33
E	建筑业	23,881,291.00	1.61
F	批发和零售业	8,845,741.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	37,705,566.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,482,918.54	3.21
J	金融业	300,039,331.01	20.29

K	房地产业	25,000,854.32	1.69
L	租赁和商务服务业	19,127,018.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	23,792,010.60	1.61
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	939,270.00	0.06
Q	卫生和社会工作	13,639,388.04	0.92
R	文化、体育和娱乐业	4,218,638.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	1,430,853,155.42	96.76

8.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	563,827.42	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	35,965.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,557.49	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,124.65	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	15,811.84	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	889,346.74	0.06

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	40,500	83,025,000.00	5.61
2	300750	宁德时代	90,300	53,096,400.00	3.59
3	600036	招商银行	796,528	38,798,878.88	2.62
4	601318	中国平安	697,200	35,145,852.00	2.38
5	000858	五粮液	125,400	27,921,564.00	1.89
6	601012	隆基股份	278,694	24,023,422.80	1.62
7	000333	美的集团	315,677	23,300,119.37	1.58
8	300059	东方财富	533,960	19,815,255.60	1.34
9	601166	兴业银行	935,900	17,819,536.00	1.20
10	600900	长江电力	732,000	16,616,400.00	1.12
11	002415	海康威视	301,600	15,779,712.00	1.07
12	002594	比亚迪	58,500	15,685,020.00	1.06
13	002475	立讯精密	318,559	15,673,102.80	1.06
14	603259	药明康德	131,920	15,643,073.60	1.06
15	600276	恒瑞医药	287,950	14,601,944.50	0.99
16	600030	中信证券	548,300	14,480,603.00	0.98
17	601888	中国中免	62,800	13,778,948.00	0.93
18	600887	伊利股份	329,300	13,652,778.00	0.92
19	000568	泸州老窖	47,342	12,018,713.54	0.81
20	300760	迈瑞医疗	31,400	11,957,120.00	0.81
21	000651	格力电器	305,700	11,320,071.00	0.77
22	601398	工商银行	2,255,200	10,441,576.00	0.71
23	603501	韦尔股份	33,558	10,428,819.66	0.71
24	000001	平安银行	626,900	10,331,312.00	0.70

25	600309	万华化学	101,016	10,202,616.00	0.69
26	600809	山西汾酒	31,400	9,915,492.00	0.67
27	002142	宁波银行	256,210	9,807,718.80	0.66
28	000725	京东方 A	1,937,400	9,783,870.00	0.66
29	300274	阳光电源	67,100	9,783,180.00	0.66
30	002714	牧原股份	169,996	9,070,986.56	0.61
31	601899	紫金矿业	927,700	8,998,690.00	0.61
32	002352	顺丰控股	126,700	8,732,164.00	0.59
33	600031	三一重工	382,800	8,727,840.00	0.59
34	000002	万 科 A	439,557	8,685,646.32	0.59
35	002812	恩捷股份	34,600	8,663,840.00	0.59
36	300014	亿纬锂能	73,200	8,650,776.00	0.58
37	603288	海天味业	81,306	8,546,073.66	0.58
38	600436	片仔癀	19,400	8,480,710.00	0.57
39	002241	歌尔股份	154,400	8,353,040.00	0.56
40	601328	交通银行	1,767,900	8,150,019.00	0.55
41	300124	汇川技术	118,700	8,142,820.00	0.55
42	600438	通威股份	174,000	7,823,040.00	0.53
43	601919	中远海控	407,560	7,617,296.40	0.52
44	600837	海通证券	620,800	7,611,008.00	0.51
45	002460	赣锋锂业	51,900	7,413,915.00	0.50
46	300015	爱尔眼科	174,543	7,379,678.04	0.50
47	600690	海尔智家	243,300	7,272,237.00	0.49
48	600048	保利发展	462,300	7,225,749.00	0.49
49	002466	天齐锂业	66,800	7,147,600.00	0.48
50	600406	国电南瑞	178,380	7,140,551.40	0.48
51	603799	华友钴业	63,000	6,949,530.00	0.47
52	000063	中兴通讯	205,100	6,870,850.00	0.46
53	601668	中国建筑	1,349,800	6,749,000.00	0.46
54	601288	农业银行	2,258,300	6,639,402.00	0.45
55	688981	中芯国际	124,700	6,607,853.00	0.45
56	600000	浦发银行	755,805	6,447,016.65	0.44
57	300122	智飞生物	51,700	6,441,820.00	0.44
58	600111	北方稀土	140,400	6,430,320.00	0.43
59	002304	洋河股份	38,900	6,407,997.00	0.43
60	002049	紫光国微	28,000	6,300,000.00	0.43
61	002230	科大讯飞	118,800	6,238,188.00	0.42
62	600016	民生银行	1,596,700	6,227,130.00	0.42
63	600585	海螺水泥	154,300	6,218,290.00	0.42
64	600745	闻泰科技	48,083	6,217,131.90	0.42
65	600104	上汽集团	300,600	6,201,378.00	0.42
66	601816	京沪高铁	1,263,200	6,101,256.00	0.41
67	002129	中环股份	146,100	6,099,675.00	0.41
68	603986	兆易创新	34,344	6,039,392.40	0.41

69	002271	东方雨虹	114,100	6,010,788.00	0.41
70	601601	中国太保	220,100	5,969,112.00	0.40
71	002371	北方华创	17,000	5,899,340.00	0.40
72	300142	沃森生物	101,100	5,681,820.00	0.38
73	000661	长春高新	20,900	5,672,260.00	0.38
74	601688	华泰证券	315,900	5,610,384.00	0.38
75	000100	TCL 科技	906,800	5,594,956.00	0.38
76	300498	温氏股份	287,460	5,536,479.60	0.37
77	000338	潍柴动力	306,900	5,490,441.00	0.37
78	600893	航发动力	85,900	5,451,214.00	0.37
79	002027	分众传媒	653,000	5,348,070.00	0.36
80	300450	先导智能	70,760	5,262,421.20	0.36
81	601211	国泰君安	290,500	5,197,045.00	0.35
82	300782	卓胜微	15,100	4,934,680.00	0.33
83	601088	中国神华	212,480	4,785,049.60	0.32
84	601766	中国中车	782,500	4,765,425.00	0.32
85	000776	广发证券	191,300	4,704,067.00	0.32
86	600050	中国联通	1,196,900	4,703,817.00	0.32
87	600570	恒生电子	75,178	4,672,312.70	0.32
88	300347	泰格医药	33,800	4,319,640.00	0.29
89	601229	上海银行	597,100	4,257,323.00	0.29
90	600660	福耀玻璃	90,100	4,247,314.00	0.29
91	600919	江苏银行	727,640	4,242,141.20	0.29
92	002709	天赐材料	37,000	4,242,050.00	0.29
93	601169	北京银行	952,100	4,227,324.00	0.29
94	600999	招商证券	238,390	4,207,583.50	0.28
95	688599	天合光能	53,274	4,203,318.60	0.28
96	600905	三峡能源	551,600	4,142,516.00	0.28
97	002821	凯莱英	9,514	4,138,590.00	0.28
98	601988	中国银行	1,356,500	4,137,325.00	0.28
99	600019	宝钢股份	573,900	4,109,124.00	0.28
100	600010	包钢股份	1,467,900	4,095,441.00	0.28
101	601669	中国电建	491,500	3,971,320.00	0.27
102	600958	东方证券	268,400	3,956,216.00	0.27
103	002311	海大集团	53,700	3,936,210.00	0.27
104	002410	广联达	61,300	3,921,974.00	0.27
105	601633	长城汽车	79,001	3,834,708.54	0.26
106	002459	晶澳科技	41,300	3,828,510.00	0.26
107	601390	中国中铁	656,200	3,799,398.00	0.26
108	600196	复星医药	77,600	3,797,744.00	0.26
109	600588	用友网络	105,080	3,770,270.40	0.25
110	000625	长安汽车	246,600	3,745,854.00	0.25
111	601985	中国核电	450,300	3,737,490.00	0.25
112	000166	申万宏源	728,800	3,731,456.00	0.25

113	601877	正泰电器	69,100	3,723,799.00	0.25
114	600028	中国石化	862,400	3,647,952.00	0.25
115	603659	璞泰来	22,300	3,581,603.00	0.24
116	601658	邮储银行	701,100	3,575,610.00	0.24
117	002179	中航光电	35,435	3,563,343.60	0.24
118	002493	荣盛石化	196,150	3,562,084.00	0.24
119	601818	光大银行	1,066,300	3,540,116.00	0.24
120	000895	双汇发展	111,762	3,526,091.10	0.24
121	000538	云南白药	33,000	3,453,450.00	0.23
122	601377	兴业证券	345,000	3,408,600.00	0.23
123	300408	三环集团	74,400	3,318,240.00	0.22
124	000768	中航西飞	89,400	3,263,100.00	0.22
125	601628	中国人寿	107,400	3,231,666.00	0.22
126	603806	福斯特	24,400	3,185,420.00	0.22
127	688111	金山办公	11,902	3,154,030.00	0.21
128	600346	恒力石化	136,000	3,123,920.00	0.21
129	002001	新 和 成	100,080	3,114,489.60	0.21
130	601989	中国重工	734,500	3,099,590.00	0.21
131	601600	中国铝业	504,000	3,069,360.00	0.21
132	601857	中国石油	623,800	3,062,858.00	0.21
133	601138	工业富联	255,700	3,047,944.00	0.21
134	601225	陕西煤业	249,700	3,046,340.00	0.21
135	300896	爱美客	5,600	3,002,216.00	0.20
136	002008	大族激光	55,200	2,980,800.00	0.20
137	600426	华鲁恒升	95,200	2,979,760.00	0.20
138	300433	蓝思科技	128,400	2,950,632.00	0.20
139	002202	金风科技	178,062	2,932,681.14	0.20
140	002050	三花智控	115,820	2,930,246.00	0.20
141	600009	上海机场	62,100	2,899,449.00	0.20
142	300316	晶盛机电	41,500	2,884,250.00	0.20
143	601009	南京银行	321,600	2,881,536.00	0.19
144	600741	华域汽车	101,600	2,875,280.00	0.19
145	600763	通策医疗	14,400	2,865,600.00	0.19
146	600150	中国船舶	115,300	2,858,287.00	0.19
147	600176	中国巨石	154,720	2,815,904.00	0.19
148	300413	芒果超媒	48,300	2,763,726.00	0.19
149	600011	华能国际	283,800	2,750,022.00	0.19
150	601100	恒立液压	33,504	2,740,627.20	0.19
151	001979	招商蛇口	205,000	2,734,700.00	0.18
152	002236	大华股份	116,200	2,728,376.00	0.18
153	601799	星宇股份	13,100	2,675,675.00	0.18
154	300601	康泰生物	26,600	2,621,164.00	0.18
155	600760	中航沈飞	37,960	2,582,798.40	0.17
156	603993	洛阳钼业	455,000	2,538,900.00	0.17

157	601939	建设银行	431,100	2,526,246.00	0.17
158	600584	长电科技	80,400	2,494,008.00	0.17
159	601006	大秦铁路	383,300	2,453,120.00	0.17
160	600989	宝丰能源	141,200	2,451,232.00	0.17
161	688036	传音控股	15,601	2,447,796.90	0.17
162	600926	杭州银行	190,500	2,442,210.00	0.17
163	601066	中信建投	83,446	2,440,795.50	0.17
164	688008	澜起科技	29,068	2,437,933.16	0.16
165	002602	世纪华通	289,496	2,428,871.44	0.16
166	300759	康龙化成	17,100	2,415,717.00	0.16
167	003816	中国广核	762,300	2,385,999.00	0.16
168	000977	浪潮信息	65,800	2,357,614.00	0.16
169	000786	北新建材	65,500	2,346,865.00	0.16
170	600132	重庆啤酒	15,500	2,345,460.00	0.16
171	601360	三六零	184,200	2,343,024.00	0.16
172	002555	三七互娱	85,800	2,318,316.00	0.16
173	601186	中国铁建	296,500	2,312,700.00	0.16
174	000157	中联重科	319,800	2,292,966.00	0.16
175	601868	中国能建	837,200	2,285,556.00	0.15
176	000963	华东医药	56,400	2,267,280.00	0.15
177	600600	青岛啤酒	22,800	2,257,200.00	0.15
178	600015	华夏银行	396,700	2,221,520.00	0.15
179	600029	南方航空	326,200	2,221,422.00	0.15
180	688561	奇安信	25,235	2,218,661.20	0.15
181	000876	新希望	145,400	2,211,534.00	0.15
182	002601	龙佰集团	77,100	2,204,289.00	0.15
183	603486	科沃斯	14,600	2,203,870.00	0.15
184	600886	国投电力	192,100	2,203,387.00	0.15
185	603369	今世缘	40,500	2,203,200.00	0.15
186	600547	山东黄金	116,300	2,188,766.00	0.15
187	601238	广汽集团	140,500	2,134,195.00	0.14
188	002736	国信证券	185,900	2,134,132.00	0.14
189	000425	徐工机械	355,000	2,126,450.00	0.14
190	000938	紫光股份	92,640	2,116,824.00	0.14
191	600352	浙江龙盛	167,600	2,116,788.00	0.14
192	601336	新华保险	53,800	2,091,744.00	0.14
193	603019	中科曙光	75,280	2,075,469.60	0.14
194	601901	方正证券	264,400	2,072,896.00	0.14
195	002007	华兰生物	70,864	2,064,976.96	0.14
196	300033	同花顺	13,900	2,009,662.00	0.14
197	688012	中微公司	15,865	2,008,509.00	0.14
198	603882	金城医学	18,000	2,004,660.00	0.14
199	600085	同仁堂	44,100	1,983,618.00	0.13
200	601800	中国交建	226,200	1,940,796.00	0.13

201	000596	古井贡酒	7,900	1,927,600.00	0.13
202	002938	鹏鼎控股	45,000	1,909,350.00	0.13
203	300628	亿联网络	23,350	1,901,857.50	0.13
204	601865	福莱特	32,700	1,894,638.00	0.13
205	000783	长江证券	250,500	1,888,770.00	0.13
206	300595	欧普康视	32,900	1,887,473.00	0.13
207	601916	浙商银行	537,700	1,881,950.00	0.13
208	601788	光大证券	125,900	1,879,687.00	0.13
209	600383	金地集团	144,800	1,878,056.00	0.13
210	000069	华侨城 A	265,800	1,871,232.00	0.13
211	300003	乐普医疗	81,800	1,851,134.00	0.13
212	600795	国电电力	573,600	1,818,312.00	0.12
213	600115	中国东航	351,900	1,815,804.00	0.12
214	000301	东方盛虹	93,600	1,810,224.00	0.12
215	601108	财通证券	161,800	1,799,216.00	0.12
216	002252	上海莱士	261,600	1,784,112.00	0.12
217	600918	中泰证券	178,900	1,783,633.00	0.12
218	600109	国金证券	155,400	1,760,682.00	0.12
219	601618	中国中冶	459,100	1,758,353.00	0.12
220	300999	金龙鱼	27,900	1,755,747.00	0.12
221	601111	中国国航	191,800	1,751,134.00	0.12
222	002841	视源股份	21,500	1,750,100.00	0.12
223	600183	生益科技	74,000	1,742,700.00	0.12
224	603392	万泰生物	7,820	1,732,130.00	0.12
225	603833	欧派家居	11,680	1,722,800.00	0.12
226	601155	新城控股	58,100	1,692,453.00	0.11
227	601838	成都银行	139,435	1,673,220.00	0.11
228	300529	健帆生物	31,200	1,662,960.00	0.11
229	603517	绝味食品	23,800	1,626,254.00	0.11
230	000066	中国长城	114,374	1,619,535.84	0.11
231	688396	华润微	24,919	1,609,767.40	0.11
232	601966	玲珑轮胎	44,000	1,608,200.00	0.11
233	603160	汇顶科技	14,700	1,584,219.00	0.11
234	600332	白云山	45,300	1,549,260.00	0.10
235	600489	中金黄金	187,500	1,543,125.00	0.10
236	603899	晨光文具	23,900	1,541,789.00	0.10
237	002120	韵达股份	75,210	1,538,796.60	0.10
238	002916	深南电路	12,609	1,536,028.38	0.10
239	002624	完美世界	75,350	1,530,358.50	0.10
240	000703	恒逸石化	142,150	1,509,633.00	0.10
241	002791	坚朗五金	8,300	1,507,197.00	0.10
242	600362	江西铜业	66,500	1,484,945.00	0.10
243	601607	上海医药	74,500	1,480,315.00	0.10
244	002414	高德红外	60,700	1,469,547.00	0.10



245	600143	金发科技	116,200	1,461,796.00	0.10
246	300144	宋城演艺	101,600	1,454,912.00	0.10
247	002568	百润股份	24,100	1,441,903.00	0.10
248	300677	英科医疗	24,900	1,440,216.00	0.10
249	600079	人福医药	63,000	1,418,760.00	0.10
250	300676	华大基因	16,100	1,413,580.00	0.10
251	601990	南京证券	142,600	1,413,166.00	0.10
252	002044	美年健康	177,000	1,389,450.00	0.09
253	600872	中炬高新	36,100	1,370,717.00	0.09
254	600061	国投资本	166,304	1,367,018.88	0.09
255	603260	合盛硅业	10,300	1,359,291.00	0.09
256	002600	领益智造	183,400	1,349,824.00	0.09
257	601021	春秋航空	23,600	1,340,480.00	0.09
258	000708	中信特钢	65,400	1,339,392.00	0.09
259	600845	宝信软件	21,930	1,334,001.90	0.09
260	688169	石头科技	1,625	1,321,125.00	0.09
261	601878	浙商证券	100,100	1,319,318.00	0.09
262	601728	中国电信	300,200	1,299,866.00	0.09
263	300558	贝达药业	16,100	1,285,263.00	0.09
264	600161	天坛生物	44,300	1,282,928.00	0.09
265	603939	益丰药房	23,200	1,278,552.00	0.09
266	603338	浙江鼎力	15,500	1,244,030.00	0.08
267	600018	上港集团	225,300	1,234,644.00	0.08
268	688126	沪硅产业	47,745	1,232,775.90	0.08
269	601696	中银证券	89,000	1,197,050.00	0.08
270	601216	君正集团	217,900	1,139,617.00	0.08
271	601162	天风证券	277,340	1,123,227.00	0.08
272	300866	安克创新	10,500	1,076,250.00	0.07
273	600606	绿地控股	245,200	1,064,168.00	0.07
274	600655	豫园股份	100,400	1,034,120.00	0.07
275	601995	中金公司	20,500	1,005,115.00	0.07
276	002024	苏宁易购	239,600	987,152.00	0.07
277	002157	正邦科技	101,600	981,456.00	0.07
278	688363	华熙生物	6,257	971,712.10	0.07
279	601933	永辉超市	234,000	947,700.00	0.06
280	002607	中公教育	119,500	939,270.00	0.06
281	002064	华峰化学	89,100	930,204.00	0.06
282	601881	中国银河	82,600	924,294.00	0.06
283	600848	上海临港	61,400	913,018.00	0.06
284	601998	中信银行	197,400	911,988.00	0.06
285	603195	公牛集团	5,100	853,230.00	0.06
286	601319	中国人保	181,500	853,050.00	0.06
287	603233	大参林	20,200	850,622.00	0.06
288	688009	中国通号	165,880	826,082.40	0.06

289	603658	安图生物	15,000	825,900.00	0.06
290	600025	华能水电	116,100	765,099.00	0.05
291	603087	甘李药业	10,800	759,672.00	0.05
292	601898	中煤能源	118,500	745,365.00	0.05
293	601236	红塔证券	60,900	725,928.00	0.05
294	601231	环旭电子	42,400	680,944.00	0.05
295	002032	苏泊尔	10,500	653,520.00	0.04
296	000800	一汽解放	59,700	614,313.00	0.04
297	601808	中海油服	38,600	579,000.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	2,900	527,336.00	0.04
299	300888	稳健医疗	5,600	461,720.00	0.03
300	601698	中国卫通	28,400	408,676.00	0.03

8.3.2 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	占基金资产净值比例(%)
1	688206	概伦电子	3,240.00	106,952.40	0.01
2	688768	容知日新	907.00	98,445.78	0.01
3	688787	海天瑞声	817.00	71,364.95	0.00
4	688091	上海谊众	1,383.00	59,206.23	0.00
5	688501	青达环保	1,759.00	37,132.49	0.00
6	603230	内蒙新华	1,141.00	29,517.67	0.00
7	301069	凯盛新材	539.00	23,829.19	0.00
8	301018	申菱环境	782.00	20,378.92	0.00
9	301082	久盛电气	915.00	19,699.95	0.00
10	001296	长江材料	310.00	18,376.80	0.00
11	301149	隆华新材	1,071.00	17,949.96	0.00
12	301118	恒光股份	315.00	15,441.30	0.00
13	301046	能辉科技	290.00	14,207.10	0.00
14	301035	润丰股份	240.00	13,507.20	0.00
15	301017	漱玉平民	555.00	13,209.00	0.00
16	301177	迪阿股份	113.00	13,117.04	0.00
17	301039	中集车辆	1,032.00	12,910.32	0.00
18	301020	密封科技	421.00	12,815.24	0.00
19	301138	华研精机	285.00	12,785.10	0.00
20	301026	浩通科技	203.00	12,734.19	0.00
21	301021	英诺激光	290.00	12,014.70	0.00
22	301048	金鹰重工	843.00	10,925.28	0.00
23	301166	优宁维	102.00	9,639.00	0.00
24	301045	天禄科技	335.00	9,503.95	0.00
25	300774	倍杰特	444.00	9,359.52	0.00
26	301189	奥尼电子	165.00	9,342.30	0.00

27	301040	中环海陆	241.00	9,280.91	0.00
28	301179	泽宇智能	182.00	9,240.14	0.00
29	301199	迈赫股份	270.00	8,640.00	0.00
30	301190	善水科技	308.00	8,457.68	0.00
31	301025	读客文化	403.00	8,414.64	0.00
32	301028	东亚机械	585.00	7,897.50	0.00
33	300814	中富电路	328.00	7,832.64	0.00
34	301096	百诚医药	99.00	7,774.47	0.00
35	301055	张小泉	355.00	7,731.90	0.00
36	301198	喜悦智行	262.00	7,650.40	0.00
37	301030	仕净科技	242.00	7,627.84	0.00
38	301108	洁雅股份	138.00	7,411.98	0.00
39	301193	家联科技	251.00	7,314.14	0.00
40	301098	金埔园林	307.00	6,806.19	0.00
41	301033	迈普医学	108.00	6,476.76	0.00
42	301049	超越科技	196.00	6,452.32	0.00
43	301032	新柴股份	513.00	6,417.63	0.00
44	301056	森赫股份	572.00	6,343.48	0.00
45	301092	争光股份	177.00	6,287.04	0.00
46	301036	双乐股份	205.00	6,135.65	0.00
47	301041	金百泽	215.00	6,065.15	0.00
48	301063	海锅股份	153.00	5,524.83	0.00
49	001234	泰慕士	333.00	5,504.49	0.00
50	301038	深水规院	266.00	5,381.18	0.00
51	301059	金三江	259.00	4,998.70	0.00
52	301027	华蓝集团	286.00	4,761.90	0.00
53	603176	汇通集团	1,924.00	4,713.80	0.00
54	301037	保立佳	193.00	4,682.18	0.00
55	301073	君亭酒店	144.00	4,608.00	0.00
56	301053	远信工业	155.00	4,460.90	0.00
57	301068	大地海洋	144.00	4,086.72	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000858	五粮液	60,087,526.25	10.67
2	300750	宁德时代	55,453,381.39	9.85
3	600519	贵州茅台	48,848,311.00	8.68

4	000333	美的集团	43,601,403.43	7.75
5	300059	东方财富	33,877,236.40	6.02
6	002415	海康威视	29,638,108.25	5.26
7	600036	招商银行	28,164,275.84	5.00
8	600585	海螺水泥	26,165,080.00	4.65
9	002594	比亚迪	25,646,802.00	4.56
10	002475	立讯精密	25,301,779.00	4.49
11	000651	格力电器	24,949,366.78	4.43
12	000568	泸州老窖	22,654,435.00	4.02
13	000001	平安银行	20,068,854.56	3.56
14	000725	京东方 A	18,575,877.00	3.30
15	002821	凯莱英	18,194,513.46	3.23
16	002714	牧原股份	17,431,586.31	3.10
17	000002	万 科 A	16,548,400.00	2.94
18	300014	亿纬锂能	15,650,633.30	2.78
19	000876	新希望	15,373,184.00	2.73
20	002142	宁波银行	14,905,358.40	2.65
21	300122	智飞生物	14,760,100.26	2.62
22	300015	爱尔眼科	14,729,454.75	2.62
23	000661	长春高新	14,613,169.08	2.60
24	002304	洋河股份	14,458,555.00	2.57
25	002352	顺丰控股	14,352,207.00	2.55
26	300124	汇川技术	14,231,225.34	2.53
27	601600	中国铝业	13,839,469.00	2.46
28	002371	北方华创	13,195,151.00	2.34
29	300274	阳光电源	13,092,303.24	2.33
30	002460	赣锋锂业	12,972,602.99	2.30
31	002812	恩捷股份	12,623,112.34	2.24
32	601318	中国平安	12,014,060.60	2.13
33	600031	三一重工	11,857,654.00	2.11
34	300760	迈瑞医疗	11,820,430.26	2.10

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。

#### 8.4.2 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	000858	五粮液	44,507,800.60	7.91

2	000333	美的集团	31,678,791.50	5.63
3	600519	贵州茅台	31,128,931.34	5.53
4	600585	海螺水泥	27,899,715.00	4.96
5	300059	东方财富	21,653,005.78	3.85
6	000651	格力电器	20,130,746.00	3.58
7	002415	海康威视	19,849,041.30	3.53
8	002475	立讯精密	16,458,998.00	2.92
9	002594	比亚迪	16,331,301.79	2.90
10	000568	泸州老窖	15,557,026.88	2.76
11	002821	凯莱英	15,436,451.16	2.74
12	600036	招商银行	14,373,661.99	2.55
13	000876	新希望	14,280,033.27	2.54
14	000001	平安银行	14,235,491.00	2.53
15	601600	中国铝业	13,908,475.34	2.47
16	000725	京东方 A	13,019,829.00	2.31
17	002714	牧原股份	13,006,404.00	2.31
18	601318	中国平安	12,974,408.00	2.30
19	600031	三一重工	12,509,950.00	2.22
20	000002	万科 A	12,310,459.00	2.19
21	000661	长春高新	11,510,917.00	2.04

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。

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,507,859,470.89
卖出股票的收入（成交）总额	1,116,918,331.53

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,591,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,591,000.00	0.11

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	15,910	1,591,000.00	0.11

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2203	IF2203	16.00	23,762,880.00	-348,540.00	-
公允价值变动总额合计					-348,540.00
股指期货投资本期收益					663,219.37
股指期货投资本期公允价值变动					-1,232,700.00

### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行因违规办理内保外贷业务等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局（闽汇罚〔2021〕5 号）责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币的行政处罚。2021 年 8 月 13 日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行（银罚字〔2021〕26 号）给予罚款 5 万元的行政处罚。

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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	3,027,892.69
2	应收证券清算款	1,830,922.20
3	应收股利	-

4	应收利息	8,781.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,867,596.36

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688206	概伦电子	106,952.40	0.01	处于锁定期
2	688768	容知日新	98,445.78	0.01	处于锁定期
3	688787	海天瑞声	71,364.95	0.00	处于锁定期
4	688091	上海谊众	59,206.23	0.00	处于锁定期
5	688501	青达环保	37,132.49	0.00	处于锁定期

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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	持有份额	占总份额



			比例		比例
1,991	567,897.04	1,095,067,443.00	96.85%	35,615,573.00	3.15%

### 9.2 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	招商证券股份有限公司	392,354,607.00	34.70%
2	中信建投证券股份有限公司	155,130,000.00	13.72%
3	中国国际金融股份有限公司	80,494,943.00	7.12%
4	申万宏源证券有限公司	80,000,600.00	7.08%
5	中国中金财富证券有限公司	76,666,900.00	6.78%
6	中信证券股份有限公司	53,544,300.00	4.74%
7	中信证券股份有限公司	42,549,709.00	3.76%
8	华泰证券股份有限公司	33,337,007.00	2.95%
9	方正证券股份有限公司	27,166,757.00	2.40%
10	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	26,100,600.00	2.31%
11	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	60,202,500.00	5.32%

### 9.3 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	0.00	0.00%

### 9.4 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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
许之彦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	-
	合计	>100

## §10 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	434,683,016.00
本报告期基金总申购份额	1,616,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	920,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,130,683,016.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

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：

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

### 11.6 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 59,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	1,341,333,783.01	51.35%	1,222,361.78	51.01%	-
中信证券	3	793,542,507.23	30.38%	738,096.82	30.80%	-
浙商证券	1	432,481,119.55	16.56%	394,120.08	16.45%	-
东吴证券	1	37,652,622.22	1.44%	35,066.71	1.46%	-
信达证券	1	7,364,206.44	0.28%	6,711.15	0.28%	-
招商证券	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) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(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综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 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的必要性和合规性进行阐述。

(3) 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。

(4) 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：

2021年2月完成租用托管在招商银行的信达证券深交所011318交易单元；

2021年5月完成租用托管在招商银行的浙商证券深交所012813交易单元；

2021年12月完成租用托管在招商银行的中信证券北交所721865交易单元。

11.8.2 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		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
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,945,087.35	60.76%	-	-	-	-
浙商证券	103,123.28	2.13%	-	-	-	-
东吴证券	1,307,734.60	26.98%	-	-	-	-
信达证券	491,068.69	10.13%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-01-21
3	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(上银转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2021-01-27

		定媒介	
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
5	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
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(环旭转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-06
8	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
9	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-03-30
10	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
11	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
12	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同(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	2021-03-31
13	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2021 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	2021-03-31
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(味知香)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
15	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(华生科技)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
16	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2021-04-21
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(正弦电气)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会基金电子披	2021-05-31

	联方承销证券的公告（无锡振华）	露网站和公司网站等指定媒介	
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
20	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（长汽转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-15
21	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（南银转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-17
22	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（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18
23	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-25
24	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（英科再生）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-01
25	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 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	2021-07-20
26	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（唯赛勃）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-21
27	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（保立佳）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-22
28	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（国邦医药）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-27
29	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（圣泉集团）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-03
30	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（沪农商行）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-07
31	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-30
32	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（时代电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-31

33	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（博拓生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-09-02
34	华安基金管理有限公司关于新增基金直销申购资金专户的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-09-11
35	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 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	2021-10-27
36	华安基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-02
37	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（新点软件）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-11
38	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（云路股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-19
39	华安基金管理有限公司关于调整投资者开户证件类型类型的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-20
40	华安基金关于沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-03
41	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-20
42	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-20
43	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-27
44	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-27

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份 额	申购份 额	赎回份 额	持有份 额	份 额占比
机构	1	20210101- 20210110	100,00 0,000. 00	113,51 9,400. 00	159,975, 100.00	53,544,300. 00	4.74%
	2	20210101- 20210112	92,000 ,000.0 0	68,083 ,000.0 0	160,083, 000.00	0.00	0.00%
	3	20210111- 20210811	0.00	294,29 5,500. 00	277,571, 300.00	16,724,200. 00	1.48%
	4	20210329- 20211216	35,300 ,000.0 0	280,53 0,000. 00	160,700, 000.00	155,130,000 .00	13.72%
	5	20211221- 20211231	6,971, 770.00	480,68 4,983. 00	95,302,1 46.00	392,354,607 .00	34.70%
联接基 金	1	20210101- 20211231	50,667 ,100.0 0	36,600 ,400.0 0	27,065,0 00.00	60,202,500. 00	5.32%
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。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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；



### 13.2 存放地点

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

### 13.3 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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日