

**华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金**  
**2022 年年度报告**  
**2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 27 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 2022 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	7
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	12
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	15
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	16
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	17
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 审计报告</b>	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层对财务报表的责任	18
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 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	60
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80

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 .....	80
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	81
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12	投资组合报告附注 .....	81
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>83</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
9.3	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的情况 .....	83
9.4	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 .....	83
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>84</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4	基金投资策略的改变 .....	85
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	85
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	85
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 .....	85
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
11.9	其他重大事件 .....	87
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>89</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>89</b>
13.1	备查文件目录 .....	89
13.2	存放地点 .....	89
13.3	查阅方式 .....	89

## §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	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
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	1,435,985,601.62 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	<p>(1) 资产配置: 本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资: 本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分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。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资: 本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p>
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	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场

	的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。
--	-------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国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	陈四清

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.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层、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	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31

		层、32 层
--	--	--------

### §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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-189,377,791.03	346,496,610.63	729,536,002.58
本期利润	-376,367,866.92	144,569,832.33	807,779,950.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2559	0.0749	0.2918
本期加权平均净值利润率	-29.02%	7.26%	31.50%
本期基金份额净值增长率	-22.83%	5.58%	33.77%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	737,758,836.79	1,240,482,757.83	1,608,705,501.03
期末可供分配基金份额利润	0.5138	0.7555	0.5892
期末基金资产净值	1,175,336,317.49	1,740,840,564.87	2,741,468,362.85
期末基金份额净值	0.818	1.060	1.004
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	461.56%	627.69%	589.25%

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：封闭式基金交易佣金、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）。

#### 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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-0.61%	1.13%	1.46%	1.14%	-2.07%	-0.01%
过去六个月	-13.62%	1.04%	-12.87%	1.03%	-0.75%	0.01%
过去一年	-22.83%	1.36%	-20.94%	1.24%	-1.89%	0.12%
过去三年	8.99%	1.35%	0.86%	1.24%	8.13%	0.11%
过去五年	10.83%	1.32%	-3.85%	1.25%	14.68%	0.07%
自基金合同生 效起至今	461.56%	1.54%	221.02%	1.51%	240.54%	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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

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  
(2002 年 11 月 8 日至 2022 年 12 月 31 日)

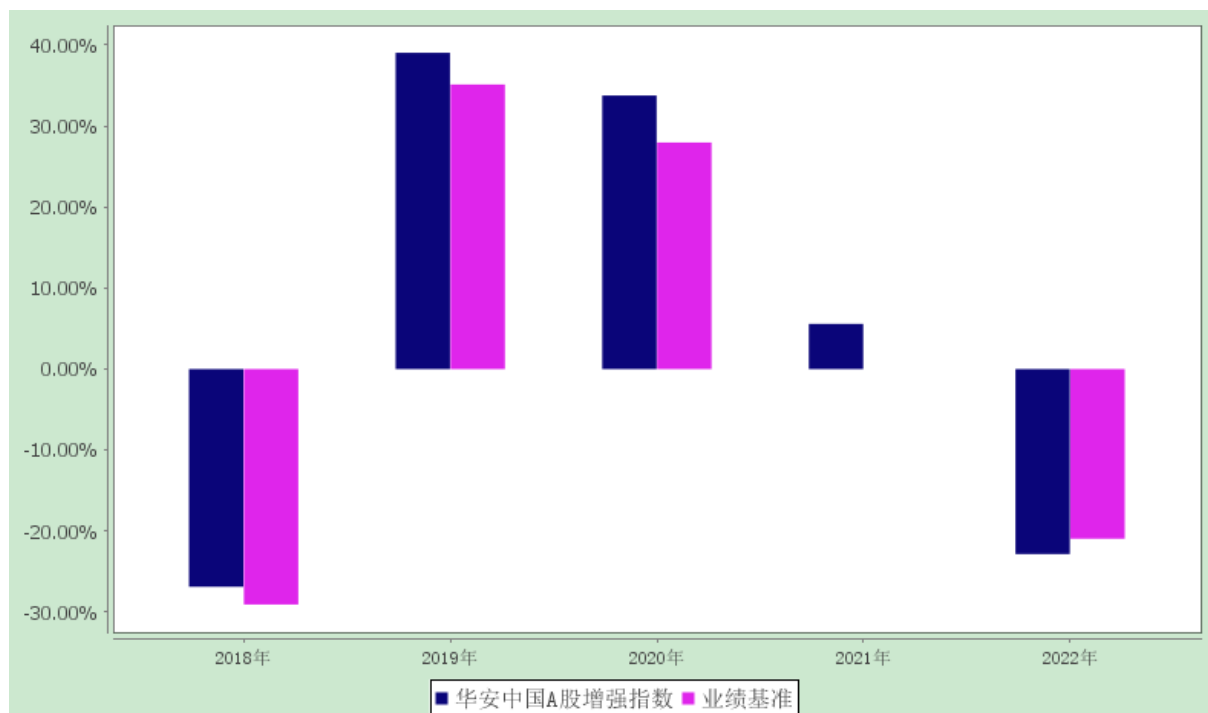


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022年	-	-	-	-	-
2021年	-	-	-	-	-
2020年	1.208	195,205,700.39	120,523,005.11	315,728,705.50	-
合计	1.208	195,205,700.39	120,523,005.11	315,728,705.50	-

## §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2022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 224 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,522.94 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	2017-12-25	-	19	理学博士，19 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

					<p>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。2022 年 5 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	2018-01-15	-	8	<p>硕士研究生, 8 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 月起, 同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投</p>

					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。
--	--	--	--	--	--

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	14.00	51,036,375,485.16	2008-04-25
	私募资产管理计划	2.00	260,807,298.80	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	16.00	51,297,182,783.96	-

#### 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 14 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

2022 年随着欧美经济继续复苏，海外通胀压力逐步显现，国际地缘冲突进一步加剧通胀压力，美联储启动加息导致全球风险偏好快速下降，人民币汇率承压。国内宏观政策重心以经济增长为主，但 3、4 月份受到局部疫情影响经济增长压力进一步加大，下半年随着地产修复不及预期以及出口增长开始回落，经济修复不及预期。货币政策全面保持相对宽松格局，全年央行两次降息、两次降准以维护流动性保持合理充裕。

从全年权益市场的表现来看，主要宽基指数均呈现不同程度的下跌，但分化并不明显，反映更多是系统性回调行情。主要宽基指数跌幅均在 20% 左右。从大类风格因子表现来看，“小市值+反转”是表现明显强势的组合，过去几年非常强势的高盈利、高成长表现则相对弱势。运用分析师预期变

化的指标来进行景气度投资在全年遇到了一些困难。一般来说，在市场系统性回调行情中，偏进攻型的风险暴露表现会相对疲弱一些。

策略方面采取适当降低股票持仓集中度，通过扩大选股空间提升小盘因子的权重，力争在获取收益的同时能控制住产品的波动和回撤。本基金配置上整体均衡，坚持配置基本面较好、景气度提升且具有估值性价比的股票。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.818 元，本报告期份额净值增长率为-22.83%，同期业绩比较基准增长率为-20.94%。

#### 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 2023 年，随着海外通胀压力逐步缓解，外海货币紧缩压力将趋于缓解。国内经济稳增长为首要任务，财政政策提力加效，货币政策继续保持稳健，经济回升的方向性比较确定。目前经济仍处于回升初期，货币政策保持相对宽松的概率依然较高。

权益市场方面将围绕重点政策和宏观经济周期运行规律来深挖相关领域的投资方向。从大的宏观背景来看，疫后复苏和稳增长政策发力，地产及地产后周期、基建、制造业等稳增长板块将具备不错的配置机会。从产业政策上，由 chatgpt 催化的 AI 行业大变革将带来从硬件到软件再到应用端的相关投资机会。

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，监督各部门与全体员工合法合规执业，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等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、对外信息披露材料、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、内部控制评价，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

基金收益分配每年至少一次；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。



本报告期基金投资出现净亏损，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

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遵规守信、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 2022 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 25133 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(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 MSCI 中国 A 股指数增强基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 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 MSCI 中国 A 股指数增强基金，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 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强基金、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 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强基金不能持续经营。

(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  
2023 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	43,214,524.67	15,462,785.89
结算备付金		1,903,828.31	3,920,491.38
存出保证金		168,522.87	366,064.85
交易性金融资产	7.4.7.2	1,134,785,272.71	1,721,298,891.18

其中：股票投资		1,108,706,355.24	1,640,147,891.18
基金投资		-	-
债券投资		26,078,917.47	81,151,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		431,710.55	6,836,033.68
应收股利		-	-
应收申购款		374,976.74	995,638.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,829,506.32
资产总计		1,180,878,835.85	1,750,709,411.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		737,655.94	1,887,170.27
应付管理人报酬		996,049.94	1,476,738.76
应付托管费		199,209.99	295,347.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.46	0.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	3,609,601.03	6,209,588.98
负债合计		5,542,518.36	9,868,846.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	437,577,480.70	500,357,807.04
未分配利润	7.4.7.8	737,758,836.79	1,240,482,757.83
净资产合计		1,175,336,317.49	1,740,840,564.87
负债和净资产总计		1,180,878,835.85	1,750,709,411.42

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.818 元，基金份额总额 1,435,985,601.62 份。

## 7.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-360,513,486.98	188,216,564.44
1.利息收入		145,463.27	2,489,651.87
其中：存款利息收入	7.4.7.9	145,463.27	251,659.51
债券利息收入		-	2,237,992.36
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）		-173,678,654.05	387,615,857.64
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-188,980,166.86	367,015,373.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,177,511.92	2,103,215.16
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	13,124,000.89	18,497,269.18
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-186,990,075.89	-201,926,778.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	9,779.69	37,833.23
<b>减：二、营业总支出</b>		15,854,379.94	43,646,732.11
1. 管理人报酬		13,013,196.56	19,924,759.75
2. 托管费		2,602,639.36	3,984,951.94
3. 销售服务费		-	-
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		-	-
7. 税金及附加		6.82	12.71
8. 其他费用	7.4.7.16	238,537.20	19,737,007.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-376,367,866.92</b>	<b>144,569,832.33</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-376,367,866.92</b>	<b>144,569,832.33</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-376,367,866.92	144,569,832.33

### 7.3 净资产（基金净值）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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	500,357,807.04	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	500,357,807.04	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-62,780,326.34	-502,723,921.04	-565,504,247.38
（一）、综合收益总额	-	-376,367,866.92	-376,367,866.92
（二）、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）	-62,780,326.34	-126,356,054.12	-189,136,380.46
其中：1.基金申购款	75,123,379.65	142,986,780.00	218,110,159.65
2.基金赎回款	-137,903,705.99	-269,342,834.12	-407,246,540.11
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	437,577,480.70	737,758,836.79	1,175,336,317.49
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	832,068,832.68	1,909,399,530.17	2,741,468,362.85
二、本期期初净资产（基金净值）	832,068,832.68	1,909,399,530.17	2,741,468,362.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-331,711,025.64	-668,916,772.34	-1,000,627,797.98
（一）、综合收益总额	-	144,569,832.33	144,569,832.33
（二）、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）	-331,711,025.64	-813,486,604.67	-1,145,197,630.31
其中：1.基金申购款	105,817,333.32	251,334,195.87	357,151,529.19
2.基金赎回款	-437,528,358.96	-1,064,820,800.54	-1,502,349,159.50
（三）、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）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	500,357,807.04	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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：朱兴华 主管会计工作负责人：朱兴华 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 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×95%+金融同业存款利率×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 2023 年 3 月 27 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、《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 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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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和债券投资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。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

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继

续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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、资产支持证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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。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

##### 新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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相关交易费用及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。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继

续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

以摊余成本计量的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，但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。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净资产转出。

#### 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股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则

及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下： (a) 金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下： 原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 15,462,785.89 元、3,920,491.38 元、366,064.85 元、1,829,506.32 元、6,836,033.68 元和 995,638.12 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 15,464,565.62 元、3,922,255.58 元、366,229.55 元、0.00 元、6,836,033.68 元和 995,638.12 元。 原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,721,298,891.18 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,723,124,688.87 元。 原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,887,170.27 元、1,476,738.76 元、295,347.75 元、5,491,588.98 元和 500,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,887,170.27 元、1,476,738.76 元、295,347.75 元、5,491,588.98 元和 500,000.00 元。 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。 (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》 根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	43,214,524.67	15,462,785.89
等于：本金	43,210,078.52	15,462,785.89
加：应计利息	4,446.15	-
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	43,214,524.67	15,462,785.89

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,194,283,909.66	-	1,108,706,355.24	-85,577,554.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券				
交易所市场	25,616,643.95	514,556.27	26,078,917.47	-52,282.75

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,616,643.95	514,556.27	26,078,917.47	-52,282.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,219,900,553.61	514,556.27	1,134,785,272.71	-85,629,837.17
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,538,954,052.46	-	1,640,147,891.18	101,193,838.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,127,000.00	-	1,127,000.00	-
	银行间市场	79,857,600.00	-	80,024,000.00	166,400.00
	合计	80,984,600.00	-	81,151,000.00	166,400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,619,938,652.46	-	1,721,298,891.18	101,360,238.72

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日

应收利息	-	1,829,506.32
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,829,506.32

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,889,601.03	5,491,588.98
其中：交易所市场	2,887,169.84	5,489,157.79
银行间市场	2,431.19	2,431.19
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	218,000.00
合计	3,609,601.03	6,209,588.98

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,641,864,151.26	500,357,807.04
本期申购	246,531,859.79	75,123,379.65
本期赎回（以“-”号填列）	-452,410,409.43	-137,903,705.99
本期末	1,435,985,601.62	437,577,480.70

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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	1,241,878,420.38	-1,395,662.55	1,240,482,757.83
本期利润	-189,377,791.03	-186,990,075.89	-376,367,866.92
本期基金份额交易产生的变动数	-153,349,420.20	26,993,366.08	-126,356,054.12
其中：基金申购款	170,113,596.80	-27,126,816.80	142,986,780.00
基金赎回款	-323,463,017.00	54,120,182.88	-269,342,834.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	899,151,209.15	-161,392,372.36	737,758,836.79

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	109,385.77	169,581.62
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	32,505.40	72,917.54
其他	3,572.10	9,160.35
合计	145,463.27	251,659.51

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,849,353,963.41	6,805,930,634.49
减：卖出股票成本总额	3,029,876,469.57	6,438,915,261.19
减：交易费用	8,457,660.70	-
买卖股票差价收入	-188,980,166.86	367,015,373.30

### 7.4.7.11 债券投资收益

#### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
债券投资收益——利息收入	1,007,515.81	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,169,996.11	2,103,215.16
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	2,177,511.92	2,103,215.16

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	140,091,403.12	95,636,835.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	136,329,278.09	89,897,420.00
减：应计利息总额	2,591,780.73	3,636,200.05
减：交易费用	348.19	-
买卖债券差价收入	1,169,996.11	2,103,215.16

### 7.4.7.12 衍生工具收益

#### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,124,000.89	18,497,269.18
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	13,124,000.89	18,497,269.18

#### 7.4.7.14 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-186,990,075.89	-201,926,778.30
——股票投资	-186,771,393.14	-204,132,383.10
——债券投资	-218,682.75	2,205,604.80
——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	-186,990,075.89	-201,926,778.30

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	8,607.76	33,808.13
基金转换费收入	1,171.93	4,025.10

合计	9,779.69	37,833.23
----	----------	-----------

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。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	100,000.00	98,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	18,000.00	18,000.00
交易费用	-	19,500,159.48
银行汇划费用	537.20	848.23
合计	238,537.20	19,737,007.71

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
上海上国投资资产管理有限公司	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

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. 根据华安基金于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经华安基金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，华安基金股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的华安基金 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

3. 根据华安基金于 2022 年 10 月 12 日发布的公告，经华安基金股东会第七十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2022]2382 号文核准，华安基金股东上海工业投资（集团）有限公司将其持有的华安基金 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。本次股东股权变更完成后，国泰君安证券股份有限公司成为华安基金的控股股东，国泰君安证券股份有限公司的实际控制人上海国际集团有限公司成为华安基金的实际控制人。

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	1,969,870,349.07	35.75%	3,668,887,109.55	29.37%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31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	8,110,061.26	6.80%	2,319,808.30	11.36%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31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	1,834,150.30	36.02%	1,407,333.14	48.74%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	3,416,833.61	29.72%	821,528.27	14.97%

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

#### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,013,196.56	19,924,759.75
其中：支付销售机构的客户维护费	3,605,179.15	5,166,413.72

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 X 1.0% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,602,639.36	3,984,951.94

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 X 0.2% / 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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

##### 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	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021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
中国工商银行	43,214,524.67	109,385.77	15,462,785.89	169,581.62

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	603170	宝立食品	网下申购	542.00	5,447.10
国泰君安证 券股份有限 公司	688459	哈铁科技	网下申购	17,259.00	235,549.11
国泰君安证 券股份有限 公司	603182	嘉华股份	网下申购	546.00	5,760.30
国泰君安证 券股份有限 公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813.00	135,783.09
国泰君安证 券股份有限 公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759.00	562,375.50
国泰君安证 券股份有限 公司	603070	万控智造	网下申购	775.00	7,300.50
国泰君安证 券股份有限 公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368.00	75,207.44
国泰君安证 券股份有限 公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920.00	75,569.60
国泰君安证 券股份有限 公司	688031	星环科技	网下申购	12,047.00	573,156.50
国泰君安证 券股份有限 公司	001238	浙江正特	网下申购	374.00	6,002.70
上年度可比期间					

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
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	8,007.00	100,407.78
国泰君安证 券股份有限 公司	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安证 券股份有限 公司	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安证 券股份有限 公司	113042	上银转债	老股东配 售	310.00	31,000.00
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	301037	保立佳	网下申购	1,923.00	28,498.86

公司					
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 券股份有限 公司	605589	圣泉集团	网下申购	1,750.00	42,017.50
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	21,843.00	688,860.51
国泰君安证 券股份有限 公司	688767	博拓生物	网下申购	2,220.00	77,084.51
国泰君安证 券股份有限 公司	688232	新点软件	网下申购	18,893.00	920,702.18
国泰君安证 券股份有限 公司	688190	云路股份	网下申购	3,026.00	141,807.89
国泰君安证 券股份有限 公司	688235	百济神州	网下申购	15,854.00	3,068,747.80
国泰君安证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	老股东配 售	9,830.00	983,000.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

(1) 于 2022 年 12 月 31 日, 本基金持有 1,600 股国泰君安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 28,565.47 元, 估值总额为人民币 21,744.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.002%(2021 年 12 月 31 日: 本基金持有 1,600 股国泰君安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 28,565.47 元, 估值总额为人民币 28,624.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.002%)。

(2) 于 2022 年 12 月 31 日, 本基金持有 36,900.00 股工商银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 184,500.00 元, 估值总额为人民币 160,146.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.01% (2021 年 12 月 31 日: 本基金持有 40,300.00 股工商银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 201,500.00 元, 估值总额为人民币 201,097.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.01%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2022 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	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
688381	帝奥微	2022-08-15	1-6 个月(含)	新股限售	41.68	37.98	7,362	306,848.16	279,608.76	-
301269	华大九天	2022-07-21	1-6 个月(含)	新股限售	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
688420	美腾科技	2022-12-01	1-6 个月(含)	新股限售	48.96	39.04	2,408	117,895.68	94,008.32	-
688419	耐科装备	2022-10-31	1-6 个月(含)	新股限售	37.85	29.44	3,039	115,026.15	89,468.16	-
301095	广立微	2022-07-28	1-6 个月(含)	新股限售	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	1-6 个月(含)	新股限售	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301327	华宝新能	2022-09-08	1-6 个月(含)	新股限售	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301356	天振股份	2022-11-03	1-6 个月(含)	新股限售	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路智控	2022-07-25	1-6 个月(含)	新股限售	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301330	熵基科技	2022-08-10	1-6 个月(含)	新股限售	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-

301152	天力锂能	2022-08-19	1-6个月(含)	新股限售	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301171	易点天下	2022-08-10	1-6个月(含)	新股限售	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美好医疗	2022-09-28	1-6个月(含)	新股限售	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建科股份	2022-08-23	1-6个月(含)	新股限售	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301296	新巨丰	2022-08-26	1-6个月(含)	新股限售	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301328	维峰电子	2022-08-30	1-6个月(含)	新股限售	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建电子	2022-08-01	1-6个月(含)	新股限售	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301339	通行宝	2022-09-02	1-6个月(含)	新股限售	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	1-6个月(含)	新股限售	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301338	凯格精机	2022-08-08	1-6个月(含)	新股限售	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	1-6个月(含)	新股限售	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301366	一博科技	2022-09-19	1-6个月(含)	新股限售	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301290	东星医疗	2022-11-23	1-6个月(含)	新股限售	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301132	满坤科技	2022-08-03	1-6个月(含)	新股限售	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	1-6个月	新股限售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-



			(含)							
30136 1	众智 科技	2022-1 1-08	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.44	20.96	517	13,669 .48	10,836 .32	-
30126 5	华新 环保	2022-1 2-08	1-6 个 月 (含)	新股 限售	13.28	11.40	819	10,876 .32	9,336. 60	-
30117 6	逸豪 新材	2022-0 9-21	1-6 个 月 (含)	新股 限售	23.88	16.89	544	12,990 .72	9,188. 16	-
30131 8	维海 德	2022-0 8-03	1-6 个 月 (含)	新股 限售	64.68	41.74	206	13,324 .08	8,598. 44	-
30139 8	星源 卓镁	2022-1 2-08	1-6 个 月 (含)	新股 限售	34.40	28.94	255	8,772. 00	7,379. 70	-
30131 3	凡拓 数创	2022-0 9-22	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.25	29.14	247	6,236. 75	7,197. 58	-
30128 5	鸿日 达	2022-0 9-21	1-6 个 月 (含)	新股 限售	14.60	12.60	565	8,249. 00	7,119. 00	-
30138 8	欣灵 电气	2022-1 0-26	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.88	21.60	292	7,556. 96	6,307. 20	-
30136 8	丰立 智能	2022-1 2-07	1-6 个 月 (含)	新股 限售	22.33	18.52	337	7,525. 21	6,241. 24	-
30131 9	唯特 偶	2022-0 9-22	1-6 个 月 (含)	新股 限售	47.75	53.27	115	5,491. 25	6,126. 05	-
30127 0	汉仪 股份	2022-0 8-19	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.68	28.37	210	5,392. 80	5,957. 70	-
30131 6	慧博 云通	2022-0 9-29	1-6 个 月 (含)	新股 限售	7.60	14.32	359	2,728. 40	5,140. 88	-

注：1. 根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 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。

5. 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。

##### 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 2022 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净资产的比例为 0.05%(2021 年 12 月 31 日:0.06%)。

#### 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 2022 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,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。

#### 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 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%。

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。

#### 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 2022 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	43,214,524.67	-	-	-	43,214,524.67
结算备付金	1,903,828.31	-	-	-	1,903,828.31
存出保证金	168,522.87	-	-	-	168,522.87
交易性金融资产	26,078,917.47	-	-	1,108,706,355.24	1,134,785,272.71
应收清算款	-	-	-	431,710.55	431,710.55
应收申购款	-	-	-	374,976.74	374,976.74
资产总计	71,365,793.32	-	-	1,109,513,042.53	1,180,878,835.85
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	737,655.94	737,655.94

应付管理人报酬	-	-	-	996,049.94	996,049.94
应付托管费	-	-	-	199,209.99	199,209.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.46	1.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,609,601.03	3,609,601.03
负债总计	-	-	-	5,542,518.36	5,542,518.36
利率敏感度缺口	71,365,793.32	-	-	1,103,970,524.17	1,175,336,317.49
<b>上年度末</b>					
<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	15,462,785.89	-	-	-	15,462,785.89
结算备付金	3,920,491.38	-	-	-	3,920,491.38
存出保证金	366,064.85	-	-	-	366,064.85
交易性金融资产	81,151,000.00	-	-	1,640,147,891.18	1,721,298,891.18
应收清算款	-	-	-	6,836,033.68	6,836,033.68
应收申购款	-	-	-	995,638.12	995,638.12
其他资产	-	-	-	1,829,506.32	1,829,506.32
资产总计	100,900,342.12	-	-	1,649,809,069.30	1,750,709,411.42
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,887,170.27	1,887,170.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,476,738.76	1,476,738.76
应付托管费	-	-	-	295,347.75	295,347.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.79	0.79
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,209,588.98	6,209,588.98

负债总计	-	-	-	9,868,846.55	9,868,846.55
利率敏感度缺口	100,900,342.12	-	-	1,639,940,222.75	1,740,840,564.87

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 2022 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净资产的比例为 2.22%(2021 年 12 月 31 日：4.66%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 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。

#### 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	1,108,706,355.24	94.33	1,640,147,891.18	94.22
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	577,758.58	0.05	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,109,284,113.82	94.38	1,640,147,891.18	94.22

#### 7.4.13.4.3.2 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		
	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）	
分析		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 62,140,000.00	增加约 94,200,000.00
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 62,140,000.00	减少约 94,200,000.00

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,108,188,197.90	1,637,123,149.19
第二层次	25,501,158.89	81,213,732.49
第三层次	1,095,915.92	2,962,009.50
合计	1,134,785,272.71	1,721,298,891.18

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,962,009.50	2,962,009.50
当期购买	-	2,621,428.98	2,621,428.98
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,796,092.47	7,796,092.47
当期利得或损失总额	-	3,308,569.91	3,308,569.91
其中：计入损益的利得或损失	-	3,308,569.91	3,308,569.91

计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-
期末余额	-	1,095,915.92	1,095,915.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-81,755.25	-81,755.25
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-		-
当期购买	-	5,704,678.81	5,704,678.81
当期出售/结算	-		-
转入第三层次	-		-
转出第三层次	-		-
当期利得或损失总额	-	-2,742,669.31	-2,742,669.31
其中：计入损益的利得或损失	-	-2,742,669.31	-2,742,669.31
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-		-

期末余额	-	2,962,009.50	2,962,009.50
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	527,882.73	527,882.73

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,095,915.92	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	2,962,009.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1717-1.7836	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022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(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §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	1,108,706,355.24	93.89
	其中：股票	1,108,706,355.24	93.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,078,917.47	2.21
	其中：债券	26,078,917.47	2.21
	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	45,118,352.98	3.82
8	其他各项资产	975,210.16	0.08
9	合计	1,180,878,835.85	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	3,824,618.50	0.33
B	采矿业	27,886,913.00	2.37
C	制造业	541,367,206.81	46.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,836,487.00	2.11
E	建筑业	15,349,905.38	1.31

F	批发和零售业	1,842,852.70	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	59,715,141.20	5.08
H	住宿和餐饮业	31,655.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,494,211.50	7.19
J	金融业	143,919,152.72	12.24
K	房地产业	23,112,019.00	1.97
L	租赁和商务服务业	38,610,767.86	3.29
M	科学研究和技术服务业	39,126,658.96	3.33
N	水利、环境和公共设施管理业	5,029.00	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	4,470,134.18	0.38
R	文化、体育和娱乐业	1,520,217.80	0.13
S	综合	869.00	0.00
	合计	1,010,113,839.61	85.94

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	855.40	0.00
B	采矿业	950,786.00	0.08
C	制造业	90,423,705.69	7.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,109.65	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	36,544.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	48,380.90	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,825,915.75	0.50
J	金融业	102,120.83	0.01
K	房地产业	5,354.00	0.00
L	租赁和商务服务业	726.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,074,732.40	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	9,671.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,964.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	45,649.72	0.00
S	综合	-	-
	合计	98,592,515.63	8.39

### 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	28,933	49,967,291.00	4.25
2	601888	中国中免	158,670	34,277,480.10	2.92
3	300750	宁德时代	82,451	32,437,872.42	2.76
4	300760	迈瑞医疗	101,388	32,035,566.36	2.73
5	002142	宁波银行	983,910	31,927,879.50	2.72
6	601111	中国国航	2,767,632	29,336,899.20	2.50
7	600036	招商银行	764,100	28,470,366.00	2.42
8	000333	美的集团	508,685	26,349,883.00	2.24
9	601012	隆基绿能	603,191	25,490,851.66	2.17
10	603259	药明康德	282,257	22,862,817.00	1.95
11	300454	深信服	195,700	22,026,035.00	1.87
12	300274	阳光电源	171,900	19,218,420.00	1.64
13	600276	恒瑞医药	469,300	18,082,129.00	1.54
14	300059	东方财富	904,854	17,554,167.60	1.49
15	000858	五粮液	92,544	16,721,775.36	1.42
16	300012	华测检测	728,032	16,235,113.60	1.38
17	600547	山东黄金	829,000	15,883,640.00	1.35

18	688111	金山办公	59,511	15,740,064.39	1.34
19	600875	东方电气	712,900	14,985,158.00	1.27
20	600011	华能国际	1,956,000	14,885,160.00	1.27
21	600809	山西汾酒	48,200	13,736,518.00	1.17
22	600048	保利发展	875,700	13,249,341.00	1.13
23	600233	圆通速递	648,600	13,030,374.00	1.11
24	601668	中国建筑	2,390,600	12,980,958.00	1.10
25	002405	四维图新	1,177,700	12,978,254.00	1.10
26	600690	海尔智家	515,120	12,599,835.20	1.07
27	002371	北方华创	55,200	12,436,560.00	1.06
28	601319	中国人保	2,357,400	12,305,628.00	1.05
29	002049	紫光国微	90,885	11,980,460.70	1.02
30	300896	爱美客	20,500	11,610,175.00	0.99
31	002850	科达利	97,500	11,583,975.00	0.99
32	601628	中国人寿	310,500	11,525,760.00	0.98
33	002475	立讯精密	360,632	11,450,066.00	0.97
34	002180	纳思达	219,600	11,395,044.00	0.97
35	002466	天齐锂业	143,900	11,366,661.00	0.97
36	002138	顺络电子	430,900	11,280,962.00	0.96
37	600030	中信证券	538,933	10,730,156.03	0.91
38	002410	广联达	173,800	10,419,310.00	0.89
39	002594	比亚迪	40,500	10,407,285.00	0.89
40	002463	沪电股份	867,910	10,328,129.00	0.88
41	600703	三安光电	589,700	10,119,252.00	0.86
42	600795	国电电力	2,306,100	9,847,047.00	0.84
43	300782	卓胜微	85,600	9,784,080.00	0.83
44	600536	中国软件	167,360	9,762,108.80	0.83
45	600893	航发动力	229,466	9,701,822.48	0.83
46	002311	海大集团	147,600	9,111,348.00	0.78
47	601939	建设银行	1,493,500	8,408,405.00	0.72
48	603707	健友股份	462,140	8,337,005.60	0.71
49	300124	汇川技术	114,600	7,964,700.00	0.68
50	000568	泸州老窖	32,900	7,378,812.00	0.63
51	000661	长春高新	43,300	7,207,285.00	0.61
52	603713	密尔克卫	61,600	7,186,256.00	0.61
53	000001	平安银行	534,200	7,030,072.00	0.60
54	600029	南方航空	856,500	6,509,400.00	0.55
55	600588	用友网络	266,900	6,450,973.00	0.55
56	002938	鹏鼎控股	233,900	6,418,216.00	0.55
57	002384	东山精密	256,900	6,353,137.00	0.54
58	601088	中国神华	222,600	6,148,212.00	0.52
59	300014	亿纬锂能	66,200	5,818,980.00	0.50
60	002532	天山铝业	738,700	5,702,764.00	0.49
61	688122	西部超导	56,445	5,344,777.05	0.45

62	603606	东方电缆	77,700	5,270,391.00	0.45
63	000002	万 科 A	271,713	4,945,176.60	0.42
64	001979	招商蛇口	388,900	4,911,807.00	0.42
65	000983	山西焦煤	400,100	4,661,165.00	0.40
66	601567	三星医疗	342,800	4,620,944.00	0.39
67	300803	指南针	96,700	4,421,124.00	0.38
68	600760	中航沈飞	73,740	4,323,376.20	0.37
69	600487	亨通光电	286,500	4,314,690.00	0.37
70	002027	分众传媒	645,300	4,310,604.00	0.37
71	600763	通策医疗	26,900	4,115,431.00	0.35
72	601688	华泰证券	310,124	3,950,979.76	0.34
73	603185	上机数控	36,500	3,863,525.00	0.33
74	002714	牧原股份	78,286	3,816,442.50	0.32
75	600845	宝信软件	84,853	3,801,414.40	0.32
76	603799	华友钴业	67,914	3,778,055.82	0.32
77	002459	晶澳科技	61,640	3,703,947.60	0.32
78	603986	兆易创新	34,800	3,565,956.00	0.30
79	002352	顺丰控股	60,600	3,500,256.00	0.30
80	002601	龙佰集团	184,300	3,486,956.00	0.30
81	600426	华鲁恒升	92,900	3,079,635.00	0.26
82	600309	万华化学	31,700	2,937,005.00	0.25
83	000733	振华科技	23,600	2,695,828.00	0.23
84	600919	江苏银行	354,000	2,580,660.00	0.22
85	300725	药石科技	31,400	2,527,700.00	0.22
86	300308	中际旭创	91,193	2,464,946.79	0.21
87	688777	中控技术	26,669	2,422,345.27	0.21
88	601186	中国铁建	305,700	2,363,061.00	0.20
89	603501	韦尔股份	30,295	2,335,441.55	0.20
90	601377	兴业证券	357,240	2,050,557.60	0.17
91	600559	老白干酒	73,200	2,015,196.00	0.17
92	002430	杭氧股份	47,400	1,865,664.00	0.16
93	000776	广发证券	119,645	1,853,301.05	0.16
94	603345	安井食品	11,000	1,780,680.00	0.15
95	600859	王府井	62,600	1,761,564.00	0.15
96	002129	TCL 中环	45,600	1,717,296.00	0.15
97	688050	爱博医疗	6,788	1,565,991.60	0.13
98	300144	宋城演艺	97,700	1,426,420.00	0.12
99	600988	赤峰黄金	56,600	1,021,630.00	0.09
100	601717	郑煤机	82,400	919,584.00	0.08
101	603613	国联股份	6,980	617,311.20	0.05
102	002812	恩捷股份	3,900	512,031.00	0.04
103	600438	通威股份	12,500	482,250.00	0.04
104	600522	中天科技	23,800	384,370.00	0.03
105	601689	拓普集团	6,400	374,912.00	0.03



106	601318	中国平安	4,834	227,198.00	0.02
107	300015	爱尔眼科	7,243	225,040.01	0.02
108	600346	恒力石化	11,880	184,496.40	0.02
109	002493	荣盛石化	14,250	175,275.00	0.01
110	601288	农业银行	56,700	164,997.00	0.01
111	000977	浪潮信息	7,590	163,336.80	0.01
112	601398	工商银行	36,900	160,146.00	0.01
113	002555	三七互娱	8,300	150,230.00	0.01
114	601229	上海银行	22,300	131,793.00	0.01
115	601872	招商轮船	23,300	130,247.00	0.01
116	600000	浦发银行	17,800	129,584.00	0.01
117	601166	兴业银行	7,100	124,889.00	0.01
118	300244	迪安诊断	4,829	121,352.77	0.01
119	002920	德赛西威	1,100	115,874.00	0.01
120	600016	民生银行	32,900	113,505.00	0.01
121	603288	海天味业	1,321	105,151.60	0.01
122	601857	中国石油	21,000	104,370.00	0.01
123	601985	中国核电	15,600	93,600.00	0.01
124	002739	万达电影	5,886	82,404.00	0.01
125	600745	闻泰科技	1,500	78,870.00	0.01
126	603444	吉比特	200	62,568.00	0.01
127	000538	云南白药	1,120	60,883.20	0.01
128	600352	浙江龙盛	5,700	56,430.00	0.00
129	002683	广东宏大	1,900	51,224.00	0.00
130	000895	双汇发展	1,800	46,674.00	0.00
131	000401	冀东水泥	5,500	45,265.00	0.00
132	002727	一心堂	1,400	44,114.00	0.00
133	300751	迈为股份	100	41,184.00	0.00
134	688981	中芯国际	1,000	41,140.00	0.00
135	002080	中材科技	1,844	39,516.92	0.00
136	000876	新希望	2,900	37,439.00	0.00
137	603290	斯达半导	100	32,930.00	0.00
138	600754	锦江酒店	500	29,175.00	0.00
139	600436	片仔癀	100	28,846.00	0.00
140	000596	古井贡酒	100	26,690.00	0.00
141	002001	新和成	1,247	23,381.25	0.00
142	300769	德方纳米	100	22,959.00	0.00
143	601211	国泰君安	1,600	21,744.00	0.00
144	002127	南极电商	4,496	21,625.76	0.00
145	000800	一汽解放	2,600	20,098.00	0.00
146	300763	锦浪科技	100	18,005.00	0.00
147	300661	圣邦股份	100	17,260.00	0.00
148	002304	洋河股份	100	16,050.00	0.00
149	600563	法拉电子	100	15,988.00	0.00

150	600702	舍得酒业	100	15,918.00	0.00
151	002821	凯莱英	100	14,800.00	0.00
152	000799	酒鬼酒	100	13,794.00	0.00
153	600132	重庆啤酒	100	12,738.00	0.00
154	603833	欧派家居	100	12,153.00	0.00
155	603127	昭衍新药	196	11,448.36	0.00
156	603899	晨光股份	200	10,996.00	0.00
157	600600	青岛啤酒	100	10,750.00	0.00
158	300347	泰格医药	100	10,480.00	0.00
159	603267	鸿远电子	100	10,116.00	0.00
160	603160	汇顶科技	200	10,040.00	0.00
161	300496	中科创达	100	10,030.00	0.00
162	300595	欧普康视	280	9,996.00	0.00
163	601360	三六零	1,500	9,810.00	0.00
164	002460	赣锋锂业	140	9,731.40	0.00
165	300122	智飞生物	100	8,783.00	0.00
166	600779	水井坊	100	8,442.00	0.00
167	603939	益丰药房	130	8,299.20	0.00
168	300474	景嘉微	150	8,185.50	0.00
169	002179	中航光电	140	8,086.40	0.00
170	603658	安图生物	130	8,040.50	0.00
171	603882	金域医学	100	7,820.00	0.00
172	002568	百润股份	196	7,322.56	0.00
173	603486	科沃斯	100	7,294.00	0.00
174	300699	光威复材	100	7,225.00	0.00
175	002916	深南电路	100	7,215.00	0.00
176	300223	北京君正	100	7,044.00	0.00
177	300759	康龙化成	100	6,800.00	0.00
178	600941	中国移动	100	6,767.00	0.00
179	002738	中矿资源	100	6,666.00	0.00
180	603806	福斯特	100	6,644.00	0.00
181	601021	春秋航空	100	6,425.00	0.00
182	300316	晶盛机电	100	6,356.00	0.00
183	601100	恒立液压	100	6,315.00	0.00
184	603517	绝味食品	100	6,109.00	0.00
185	300628	亿联网络	100	6,059.00	0.00
186	600009	上海机场	100	5,771.00	0.00
187	603589	口子窖	100	5,767.00	0.00
188	300413	芒果超媒	190	5,703.80	0.00
189	603233	大参林	144	5,702.40	0.00
190	600529	山东药玻	200	5,680.00	0.00
191	300073	当升科技	100	5,640.00	0.00
192	603816	顾家家居	130	5,552.30	0.00
193	601877	正泰电器	200	5,540.00	0.00

194	300357	我武生物	100	5,510.00	0.00
195	603883	老百姓	130	5,261.10	0.00
196	603659	璞泰来	100	5,189.00	0.00
197	603369	今世缘	100	5,090.00	0.00
198	002409	雅克科技	100	5,037.00	0.00
199	002557	洽洽食品	100	5,000.00	0.00
200	300558	贝达药业	100	4,927.00	0.00
201	000999	华润三九	100	4,681.00	0.00
202	000963	华东医药	100	4,680.00	0.00
203	300747	锐科激光	195	4,611.75	0.00
204	600584	长电科技	200	4,610.00	0.00
205	600085	同仁堂	100	4,468.00	0.00
206	300726	宏达电子	100	4,414.00	0.00
207	002709	天赐材料	100	4,386.00	0.00
208	300999	金龙鱼	100	4,356.00	0.00
209	300251	光线传媒	500	4,330.00	0.00
210	002648	卫星化学	274	4,247.00	0.00
211	002603	以岭药业	140	4,194.40	0.00
212	603927	中科软	140	4,145.40	0.00
213	603678	火炬电子	100	4,094.00	0.00
214	300363	博腾股份	100	4,085.00	0.00
215	000423	东阿阿胶	100	4,070.00	0.00
216	600570	恒生电子	100	4,046.00	0.00
217	300142	沃森生物	100	4,019.00	0.00
218	600089	特变电工	200	4,016.00	0.00
219	300618	寒锐钴业	100	4,005.00	0.00
220	601127	赛力斯	100	3,999.00	0.00
221	000400	许继电气	200	3,994.00	0.00
222	600323	瀚蓝环境	200	3,692.00	0.00
223	600196	复星医药	100	3,524.00	0.00
224	600660	福耀玻璃	100	3,507.00	0.00
225	603712	七一二	100	3,492.00	0.00
226	002415	海康威视	100	3,468.00	0.00
227	300298	三诺生物	100	3,373.00	0.00
228	600188	兖矿能源	100	3,358.00	0.00
229	002271	东方雨虹	100	3,357.00	0.00
230	600885	宏发股份	100	3,341.00	0.00
231	300502	新易盛	140	3,325.00	0.00
232	002831	裕同科技	100	3,307.00	0.00
233	000831	中国稀土	100	3,288.00	0.00
234	002294	信立泰	100	3,285.00	0.00
235	002230	科大讯飞	100	3,283.00	0.00
236	600460	士兰微	100	3,279.00	0.00
237	000651	格力电器	100	3,232.00	0.00

238	002223	鱼跃医疗	100	3,186.00	0.00
239	600887	伊利股份	100	3,100.00	0.00
240	300253	卫宁健康	300	3,084.00	0.00
241	300408	三环集团	100	3,071.00	0.00
242	002268	电科网安	100	3,053.00	0.00
243	603866	桃李面包	196	3,018.40	0.00
244	603027	千禾味业	144	2,992.32	0.00
245	000860	顺鑫农业	100	2,982.00	0.00
246	600332	白云山	100	2,979.00	0.00
247	002153	石基信息	196	2,938.04	0.00
248	600141	兴发集团	100	2,900.00	0.00
249	002074	国轩高科	100	2,883.00	0.00
250	600161	天坛生物	120	2,847.60	0.00
251	002925	盈趣科技	170	2,808.40	0.00
252	002151	北斗星通	100	2,808.00	0.00
253	002353	杰瑞股份	100	2,791.00	0.00
254	600511	国药股份	100	2,790.00	0.00
255	002508	老板电器	100	2,776.00	0.00
256	300285	国瓷材料	100	2,757.00	0.00
257	600585	海螺水泥	100	2,738.00	0.00
258	600566	济川药业	100	2,722.00	0.00
259	002422	科伦药业	100	2,661.00	0.00
260	600999	招商证券	200	2,660.00	0.00
261	002439	启明星辰	100	2,608.00	0.00
262	600998	九州通	200	2,608.00	0.00
263	000063	中兴通讯	100	2,586.00	0.00
264	002507	涪陵榨菜	100	2,577.00	0.00
265	002008	大族激光	100	2,565.00	0.00
266	000738	航发控制	100	2,564.00	0.00
267	000768	中航西飞	100	2,545.00	0.00
268	601615	明阳智能	100	2,526.00	0.00
269	600316	洪都航空	100	2,519.00	0.00
270	600111	北方稀土	100	2,505.00	0.00
271	002030	达安基因	160	2,489.60	0.00
272	600258	首旅酒店	100	2,480.00	0.00
273	002262	恩华药业	100	2,455.00	0.00
274	601601	中国太保	100	2,452.00	0.00
275	600406	国电南瑞	100	2,440.00	0.00
276	600079	人福医药	100	2,389.00	0.00
277	601066	中信建投	100	2,375.00	0.00
278	002299	圣农发展	100	2,369.00	0.00
279	002497	雅化集团	100	2,325.00	0.00
280	002595	豪迈科技	100	2,315.00	0.00
281	300450	先导智能	57	2,294.25	0.00

282	300146	汤臣倍健	100	2,282.00	0.00
283	002236	大华股份	200	2,262.00	0.00
284	601231	环旭电子	139	2,255.97	0.00
285	600862	中航高科	100	2,229.00	0.00
286	600150	中国船舶	100	2,228.00	0.00
287	603156	养元饮品	100	2,227.00	0.00
288	603019	中科曙光	100	2,214.00	0.00
289	600521	华海药业	100	2,186.00	0.00
290	002414	高德红外	196	2,156.00	0.00
291	600118	中国卫星	100	2,155.00	0.00
292	002050	三花智控	100	2,122.00	0.00
293	300207	欣旺达	100	2,115.00	0.00
294	300433	蓝思科技	200	2,106.00	0.00
295	603858	步长制药	100	2,101.00	0.00
296	600900	长江电力	100	2,100.00	0.00
297	000951	中国重汽	140	2,077.60	0.00
298	600685	中船防务	100	2,076.00	0.00
299	002389	航天彩虹	100	2,057.00	0.00
300	601966	玲珑轮胎	100	2,048.00	0.00
301	002216	三全食品	110	2,036.10	0.00
302	603218	日月股份	100	2,030.00	0.00
303	000519	中兵红箭	100	1,964.00	0.00
304	300498	温氏股份	100	1,963.00	0.00
305	600549	厦门钨业	100	1,955.00	0.00
306	000938	紫光股份	100	1,951.00	0.00
307	601225	陕西煤业	100	1,858.00	0.00
308	600884	杉杉股份	100	1,820.00	0.00
309	002572	索菲亚	100	1,816.00	0.00
310	601607	上海医药	100	1,783.00	0.00
311	000581	威孚高科	100	1,773.00	0.00
312	600362	江西铜业	100	1,743.00	0.00
313	600741	华域汽车	100	1,733.00	0.00
314	300463	迈克生物	100	1,730.00	0.00
315	002625	光启技术	100	1,702.00	0.00
316	300773	拉卡拉	100	1,688.00	0.00
317	601699	潞安环能	100	1,685.00	0.00
318	002241	歌尔股份	100	1,683.00	0.00
319	002156	通富微电	100	1,648.00	0.00
320	000988	华工科技	100	1,641.00	0.00
321	603885	吉祥航空	100	1,618.00	0.00
322	600803	新奥股份	100	1,610.00	0.00
323	000998	隆平高科	100	1,607.00	0.00
324	600372	中航电子	100	1,597.00	0.00
325	600031	三一重工	100	1,580.00	0.00

326	600160	巨化股份	100	1,551.00	0.00
327	002250	联化科技	100	1,550.00	0.00
328	601838	成都银行	100	1,530.00	0.00
329	600482	中国动力	100	1,529.00	0.00
330	600938	中国海油	100	1,520.00	0.00
331	600004	白云机场	100	1,501.00	0.00
332	000623	吉林敖东	100	1,499.00	0.00
333	600801	华新水泥	100	1,482.00	0.00
334	601233	桐昆股份	100	1,445.00	0.00
335	300418	昆仑万维	100	1,441.00	0.00
336	600104	上汽集团	100	1,441.00	0.00
337	600183	生益科技	100	1,441.00	0.00
338	600399	抚顺特钢	100	1,431.00	0.00
339	600848	上海临港	120	1,430.40	0.00
340	000960	锡业股份	100	1,410.00	0.00
341	600699	均胜电子	100	1,405.00	0.00
342	600392	盛和资源	100	1,400.00	0.00
343	600598	北大荒	100	1,376.00	0.00
344	002511	中顺洁柔	100	1,374.00	0.00
345	600176	中国巨石	100	1,371.00	0.00
346	600153	建发股份	100	1,365.00	0.00
347	600977	中国电影	100	1,360.00	0.00
348	600060	海信视像	100	1,354.00	0.00
349	600637	东方明珠	200	1,330.00	0.00
350	600498	烽火通信	100	1,314.00	0.00
351	600418	江淮汽车	100	1,313.00	0.00
352	600926	杭州银行	100	1,308.00	0.00
353	000997	新大陆	100	1,301.00	0.00
354	600739	辽宁成大	100	1,259.00	0.00
355	000830	鲁西化工	100	1,239.00	0.00
356	002128	电投能源	100	1,234.00	0.00
357	000625	长安汽车	100	1,231.00	0.00
358	002019	亿帆医药	100	1,225.00	0.00
359	600674	川投能源	100	1,223.00	0.00
360	600827	百联股份	100	1,212.00	0.00
361	600026	中远海能	100	1,205.00	0.00
362	000878	云南铜业	100	1,175.00	0.00
363	601958	金铂股份	100	1,155.00	0.00
364	002078	太阳纸业	100	1,152.00	0.00
365	600958	东方证券	128	1,144.32	0.00
366	600895	张江高科	100	1,134.00	0.00
367	002203	海亮股份	100	1,130.00	0.00
368	600380	健康元	100	1,129.00	0.00
369	300009	安科生物	120	1,123.20	0.00

370	600019	宝钢股份	200	1,118.00	0.00
371	000807	云铝股份	100	1,112.00	0.00
372	000987	越秀资本	182	1,090.18	0.00
373	600886	国投电力	100	1,083.00	0.00
374	600535	天士力	100	1,076.00	0.00
375	600597	光明乳业	100	1,076.00	0.00
376	000021	深科技	100	1,069.00	0.00
377	000069	华侨城 A	200	1,066.00	0.00
378	000729	燕京啤酒	100	1,062.00	0.00
379	000039	中集集团	150	1,056.00	0.00
380	601009	南京银行	100	1,042.00	0.00
381	601919	中远海控	100	1,029.00	0.00
382	000066	中国长城	100	1,020.00	0.00
383	601168	西部矿业	100	1,020.00	0.00
384	000338	潍柴动力	100	1,018.00	0.00
385	600873	梅花生物	100	1,018.00	0.00
386	002013	中航机电	100	1,005.00	0.00
387	601058	赛轮轮胎	100	1,002.00	0.00
388	600021	上海电力	100	1,001.00	0.00
389	002212	天融信	100	999.00	0.00
390	002152	广电运通	100	994.00	0.00
391	601878	浙商证券	100	993.00	0.00
392	600061	国投资本	152	971.28	0.00
393	600143	金发科技	100	969.00	0.00
394	002436	兴森科技	100	968.00	0.00
395	300070	碧水源	200	946.00	0.00
396	000547	航天发展	100	939.00	0.00
397	601881	中国银河	100	929.00	0.00
398	600867	通化东宝	100	918.00	0.00
399	601138	工业富联	100	918.00	0.00
400	000723	美锦能源	100	902.00	0.00
401	600256	广汇能源	100	902.00	0.00
402	300024	机器人	100	898.00	0.00
403	002373	千方科技	100	892.00	0.00
404	002385	大北农	100	890.00	0.00
405	002736	国信证券	100	888.00	0.00
406	002244	滨江集团	100	883.00	0.00
407	600673	东阳光	100	869.00	0.00
408	600837	海通证券	100	869.00	0.00
409	000050	深天马 A	100	866.00	0.00
410	002966	苏州银行	110	855.80	0.00
411	601555	东吴证券	130	848.90	0.00
412	000930	中粮科技	100	836.00	0.00
413	601899	紫金矿业	83	830.00	0.00

414	002185	华天科技	100	829.00	0.00
415	002939	长城证券	100	828.00	0.00
416	600967	内蒙一机	100	826.00	0.00
417	600489	中金黄金	100	819.00	0.00
418	300383	光环新网	100	816.00	0.00
419	002465	海格通信	100	812.00	0.00
420	601800	中国交建	100	805.00	0.00
421	002558	巨人网络	100	796.00	0.00
422	601117	中国化学	100	794.00	0.00
423	601990	南京证券	100	793.00	0.00
424	601727	上海电气	200	788.00	0.00
425	000089	深圳机场	100	786.00	0.00
426	601198	东兴证券	100	772.00	0.00
427	002221	东华能源	100	763.00	0.00
428	600528	中铁工业	100	763.00	0.00
429	600655	豫园股份	100	761.00	0.00
430	002926	华西证券	100	753.00	0.00
431	600066	宇通客车	100	751.00	0.00
432	002092	中泰化学	100	746.00	0.00
433	002340	格林美	100	743.00	0.00
434	002191	劲嘉股份	100	723.00	0.00
435	601669	中国电建	100	708.00	0.00
436	601989	中国重工	200	698.00	0.00
437	600737	中粮糖业	100	694.00	0.00
438	600606	绿地控股	231	688.38	0.00
439	300376	易事特	100	683.00	0.00
440	600879	航天电子	100	680.00	0.00
441	601006	大秦铁路	100	668.00	0.00
442	600500	中化国际	100	661.00	0.00
443	000686	东北证券	100	650.00	0.00
444	600155	华创阳安	100	650.00	0.00
445	601901	方正证券	100	638.00	0.00
446	000027	深圳能源	100	636.00	0.00
447	002252	上海莱士	100	634.00	0.00
448	000728	国元证券	100	633.00	0.00
449	600177	雅戈尔	100	633.00	0.00
450	600516	方大炭素	100	612.00	0.00
451	002673	西部证券	100	609.00	0.00
452	600583	海油工程	100	606.00	0.00
453	600507	方大特钢	100	602.00	0.00
454	600909	华安证券	130	596.70	0.00
455	600027	华电国际	100	588.00	0.00
456	601519	大智慧	100	575.00	0.00
457	002065	东华软件	100	566.00	0.00



458	300296	利亚德	100	566.00	0.00
459	002797	第一创业	100	563.00	0.00
460	300017	网宿科技	100	558.00	0.00
461	601390	中国中铁	100	556.00	0.00
462	600115	中国东航	100	553.00	0.00
463	600642	申能股份	100	549.00	0.00
464	601997	贵阳银行	100	549.00	0.00
465	000157	中联重科	100	544.00	0.00
466	002010	传化智联	100	534.00	0.00
467	600018	上港集团	100	534.00	0.00
468	000783	长江证券	100	533.00	0.00
469	002500	山西证券	100	530.00	0.00
470	600820	隧道股份	100	527.00	0.00
471	000402	金融街	100	525.00	0.00
472	600415	小商品城	100	524.00	0.00
473	600015	华夏银行	100	519.00	0.00
474	600667	太极实业	100	516.00	0.00
475	601766	中国中车	100	511.00	0.00
476	600390	五矿资本	100	508.00	0.00
477	600497	驰宏锌锗	100	506.00	0.00
478	000488	晨鸣纸业	100	498.00	0.00
479	601816	京沪高铁	100	492.00	0.00
480	002044	美年健康	80	490.40	0.00
481	000598	兴蓉环境	100	489.00	0.00
482	000559	万向钱潮	100	487.00	0.00
483	002081	金螳螂	100	485.00	0.00
484	600704	物产中大	100	481.00	0.00
485	601328	交通银行	100	474.00	0.00
486	000629	钒钛股份	100	473.00	0.00
487	002456	欧菲光	100	471.00	0.00
488	000932	华菱钢铁	100	470.00	0.00
489	601658	邮储银行	100	462.00	0.00
490	601179	中国西电	100	461.00	0.00
491	603993	洛阳钼业	100	455.00	0.00
492	002600	领益智造	100	454.00	0.00
493	600050	中国联通	100	448.00	0.00
494	601600	中国铝业	100	447.00	0.00
495	601118	海南橡胶	100	438.00	0.00
496	600028	中国石化	100	436.00	0.00
497	000825	太钢不锈	100	432.00	0.00
498	600100	同方股份	100	431.00	0.00
499	601169	北京银行	100	431.00	0.00
500	002157	正邦科技	100	423.00	0.00
501	000883	湖北能源	100	420.00	0.00

502	000060	中金岭南	100	410.00	0.00
503	600782	新钢股份	100	409.00	0.00
504	601216	君正集团	100	399.00	0.00
505	000166	申万宏源	100	398.00	0.00
506	002266	浙富控股	100	391.00	0.00
507	601598	中国外运	100	384.00	0.00
508	002602	世纪华通	100	381.00	0.00
509	600369	西南证券	100	375.00	0.00
510	000100	TCL 科技	100	372.00	0.00
511	000778	新兴铸管	100	365.00	0.00
512	601375	中原证券	100	364.00	0.00
513	601077	渝农商行	100	353.00	0.00
514	002429	兆驰股份	100	349.00	0.00
515	600023	浙能电力	100	349.00	0.00
516	600863	内蒙华电	100	349.00	0.00
517	601608	中信重工	100	349.00	0.00
518	000725	京东方 A	100	338.00	0.00
519	000750	国海证券	100	333.00	0.00
520	600705	中航产融	100	328.00	0.00
521	600219	南山铝业	100	327.00	0.00
522	600320	振华重工	100	321.00	0.00
523	601618	中国中冶	100	318.00	0.00
524	000627	天茂集团	100	316.00	0.00
525	601988	中国银行	100	316.00	0.00
526	600282	南钢股份	100	315.00	0.00
527	000630	铜陵有色	100	312.00	0.00
528	600688	上海石化	100	311.00	0.00
529	601818	光大银行	100	307.00	0.00
530	603077	和邦生物	100	304.00	0.00
531	601916	浙商银行	100	294.00	0.00
532	601106	中国一重	100	293.00	0.00
533	002506	协鑫集成	100	291.00	0.00
534	002958	青农商行	100	289.00	0.00
535	600968	海油发展	100	288.00	0.00
536	601162	天风证券	100	287.00	0.00
537	600008	首创环保	100	283.00	0.00
538	600808	马钢股份	100	281.00	0.00
539	601000	唐山港	100	274.00	0.00
540	600170	上海建工	100	260.00	0.00
541	601099	太平洋	100	257.00	0.00
542	600208	新湖中宝	100	254.00	0.00
543	601992	金隅集团	100	254.00	0.00
544	600340	华夏幸福	100	251.00	0.00
545	600567	山鹰国际	100	248.00	0.00

546	601866	中远海发	100	242.00	0.00
547	601868	中国能建	100	229.00	0.00
548	601333	广深铁路	100	227.00	0.00
549	000709	河钢股份	100	226.00	0.00
550	600297	广汇汽车	100	210.00	0.00
551	600010	包钢股份	100	192.00	0.00
552	002131	利欧股份	100	177.00	0.00
553	601005	重庆钢铁	100	158.00	0.00
554	000540	中天金融	100	151.00	0.00
555	600022	山东钢铁	100	148.00	0.00

### 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	603416	信捷电气	220,200.00	9,979,464.00	0.85
2	603317	天味食品	308,100.00	8,466,588.00	0.72
3	002085	万丰奥威	1,418,800.00	8,441,860.00	0.72
4	300767	震安科技	159,950.00	7,477,662.50	0.64
5	688059	华锐精密	44,680.00	7,193,480.00	0.61
6	600586	金晶科技	808,700.00	7,043,777.00	0.60
7	002897	意华股份	95,600.00	5,620,324.00	0.48
8	300623	捷捷微电	261,800.00	5,398,316.00	0.46
9	301367	怡和嘉业	24,200.00	5,313,594.00	0.45
10	600973	宝胜股份	939,800.00	4,482,846.00	0.38
11	688639	华恒生物	28,733.00	4,460,798.25	0.38
12	603055	台华新材	430,000.00	4,343,000.00	0.37
13	688311	盟升电子	49,517.00	4,021,770.74	0.34
14	300634	彩讯股份	211,300.00	3,222,325.00	0.27
15	002705	新宝股份	169,800.00	2,827,170.00	0.24
16	688023	安恒信息	11,890.00	2,354,220.00	0.20
17	600933	爱柯迪	125,300.00	2,281,713.00	0.19
18	300416	苏试试验	35,100.00	1,058,265.00	0.09
19	601898	中煤能源	110,300.00	950,786.00	0.08
20	300681	英搏尔	20,300.00	804,083.00	0.07
21	688503	聚和材料	2,580.00	384,703.80	0.03
22	688381	帝奥微	7,362.00	279,608.76	0.02
23	301280	珠城科技	2,783.00	132,065.20	0.01
24	688376	美埃科技	3,713.00	116,142.64	0.01
25	301269	华大九天	1,168.00	102,713.92	0.01
26	301176	逸豪新材	5,431.00	94,661.79	0.01

27	688420	美腾科技	2,408.00	94,008.32	0.01
28	688419	耐科装备	3,039.00	89,468.16	0.01
29	601136	首创证券	4,739.00	82,553.38	0.01
30	301398	星源卓镁	2,549.00	78,837.80	0.01
31	001301	尚太科技	1,164.00	68,722.56	0.01
32	301368	丰立智能	3,368.00	66,558.14	0.01
33	301095	广立微	740.00	64,002.60	0.01
34	001269	欧晶科技	546.00	54,185.04	0.00
35	301308	江波龙	819.00	46,453.68	0.00
36	301327	华宝新能	242.00	42,826.74	0.00
37	001330	博纳影业	3,564.00	42,696.72	0.00
38	001338	永顺泰	1,649.00	34,826.88	0.00
39	301200	大族数控	857.00	33,594.40	0.00
40	605090	九丰能源	1,526.00	31,511.90	0.00
41	301219	腾远钴业	425.00	29,295.25	0.00
42	601089	福元医药	1,749.00	26,812.17	0.00
43	601022	宁波远洋	1,983.00	26,770.50	0.00
44	301356	天振股份	614.00	26,604.62	0.00
45	001322	箭牌家居	1,595.00	24,244.00	0.00
46	301195	北路智控	330.00	24,103.20	0.00
47	301263	泰恩康	682.00	22,165.00	0.00
48	603255	鼎际得	489.00	21,956.10	0.00
49	301330	熵基科技	694.00	21,729.14	0.00
50	603209	兴通股份	595.00	21,610.40	0.00
51	001308	康冠科技	667.00	20,703.68	0.00
52	301152	天力锂能	433.00	20,195.12	0.00
53	001323	慕思股份	573.00	18,977.76	0.00
54	001236	弘业期货	1,399.00	18,956.45	0.00
55	301171	易点天下	985.00	17,454.20	0.00
56	603057	紫燕食品	549.00	17,277.03	0.00
57	301363	美好医疗	445.00	16,843.25	0.00
58	603235	天新药业	572.00	16,656.64	0.00
59	001339	智微智能	812.00	16,516.08	0.00
60	301115	建科股份	685.00	16,467.40	0.00
61	603051	鹿山新材	272.00	16,295.52	0.00
62	301296	新巨丰	1,042.00	15,525.80	0.00
63	603170	宝立食品	542.00	15,354.86	0.00
64	603237	五芳斋	325.00	15,323.75	0.00
65	301328	维峰电子	191.00	14,699.36	0.00
66	301121	紫建电子	290.00	14,433.30	0.00
67	001298	好上好	403.00	14,379.04	0.00
68	301339	通行宝	913.00	14,233.67	0.00
69	603070	万控智造	775.00	13,640.00	0.00
70	301377	鼎泰高科	770.00	13,575.10	0.00

71	002607	中公教育	2,800.00	12,964.00	0.00
72	301338	凯格精机	257.00	12,590.43	0.00
73	001256	炜冈科技	474.00	12,390.36	0.00
74	001333	光华股份	426.00	12,332.70	0.00
75	301366	一博科技	268.00	12,084.12	0.00
76	001300	三柏硕	763.00	11,826.50	0.00
77	001299	美能能源	576.00	11,635.20	0.00
78	301290	东星医疗	330.00	11,592.90	0.00
79	301132	满坤科技	468.00	11,456.64	0.00
80	001331	胜通能源	385.00	11,330.55	0.00
81	301277	新天地	439.00	11,317.42	0.00
82	603151	邦基科技	535.00	11,256.40	0.00
83	301361	众智科技	517.00	10,836.32	0.00
84	001238	浙江正特	374.00	10,797.38	0.00
85	001222	源飞宠物	434.00	10,758.86	0.00
86	603182	嘉华股份	546.00	9,778.86	0.00
87	001230	劲旅环境	375.00	9,671.25	0.00
88	301265	华新环保	819.00	9,336.60	0.00
89	001229	魅视科技	347.00	9,313.48	0.00
90	603280	南方路机	363.00	8,893.50	0.00
91	301318	维海德	206.00	8,598.44	0.00
92	002840	华统股份	500.00	8,445.00	0.00
93	001231	农心科技	355.00	8,037.20	0.00
94	301313	凡拓数创	247.00	7,197.58	0.00
95	301285	鸿日达	565.00	7,119.00	0.00
96	301388	欣灵电气	292.00	6,307.20	0.00
97	301319	唯特偶	115.00	6,126.05	0.00
98	301270	汉仪股份	210.00	5,957.70	0.00
99	301316	慧博云通	359.00	5,140.88	0.00
100	300567	精测电子	100.00	5,020.00	0.00
101	002690	美亚光电	130.00	3,107.00	0.00
102	002146	荣盛发展	1,200.00	2,604.00	0.00
103	603638	艾迪精密	140.00	2,088.80	0.00
104	002626	金达威	100.00	2,072.00	0.00
105	300212	易华录	100.00	2,041.00	0.00
106	603228	景旺电子	100.00	2,024.00	0.00
107	601098	中南传媒	200.00	1,996.00	0.00
108	600562	国睿科技	100.00	1,695.00	0.00
109	603000	人民网	100.00	1,687.00	0.00
110	002242	九阳股份	100.00	1,648.00	0.00
111	002281	光迅科技	100.00	1,572.00	0.00
112	002773	康弘药业	100.00	1,569.00	0.00
113	001914	招商积余	100.00	1,538.00	0.00
114	600131	国网信通	100.00	1,496.00	0.00

115	300188	美亚柏科	100.00	1,286.00	0.00
116	002399	海普瑞	100.00	1,285.00	0.00
117	000672	上峰水泥	120.00	1,281.60	0.00
118	600305	恒顺醋业	100.00	1,231.00	0.00
119	600835	上海机电	100.00	1,122.00	0.00
120	600267	海正药业	100.00	1,102.00	0.00
121	000555	神州信息	100.00	1,077.00	0.00
122	600373	中文传媒	100.00	957.00	0.00
123	600776	东方通信	100.00	916.00	0.00
124	600201	生物股份	100.00	901.00	0.00
125	002124	天邦食品	140.00	855.40	0.00
126	002382	蓝帆医疗	100.00	779.00	0.00
127	002233	塔牌集团	100.00	710.00	0.00
128	002099	海翔药业	100.00	701.00	0.00
129	300271	华宇软件	100.00	683.00	0.00
130	600167	联美控股	100.00	632.00	0.00
131	600376	首开股份	100.00	569.00	0.00
132	600398	海澜之家	100.00	530.00	0.00
133	002563	森马服饰	100.00	524.00	0.00
134	300058	蓝色光标	100.00	505.00	0.00
135	002110	三钢闽光	100.00	470.00	0.00
136	002075	沙钢股份	100.00	393.00	0.00
137	600928	西安银行	100.00	352.00	0.00
138	600959	江苏有线	100.00	297.00	0.00
139	601860	紫金银行	100.00	259.00	0.00
140	600823	世茂股份	100.00	236.00	0.00
141	000415	渤海租赁	100.00	221.00	0.00
142	000961	中南建设	100.00	219.00	0.00
143	000671	阳光城	100.00	188.00	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	601111	中国国航	52,297,856.30	3.00
2	600011	华能国际	41,896,382.86	2.41
3	300059	东方财富	39,496,993.40	2.27
4	601668	中国建筑	39,424,460.00	2.26
5	002714	牧原股份	36,372,197.47	2.09
6	000661	长春高新	35,831,676.00	2.06

7	002475	立讯精密	34,271,883.00	1.97
8	600745	闻泰科技	32,047,372.89	1.84
9	300896	爱美客	31,112,074.44	1.79
10	002549	凯美特气	31,016,526.54	1.78
11	688111	金山办公	29,916,125.14	1.72
12	000977	浪潮信息	29,868,753.60	1.72
13	000975	银泰黄金	29,256,697.28	1.68
14	688122	西部超导	29,134,895.50	1.67
15	600426	华鲁恒升	26,955,538.70	1.55
16	002405	四维图新	26,518,225.78	1.52
17	002142	宁波银行	26,455,097.77	1.52
18	603799	华友钴业	25,765,434.60	1.48
19	601888	中国中免	25,684,257.00	1.48
20	600522	中天科技	25,504,015.10	1.47

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	600519	贵州茅台	68,530,141.89	3.94
2	601111	中国国航	63,941,317.59	3.67
3	002475	立讯精密	49,571,685.00	2.85
4	600188	兖矿能源	43,637,813.60	2.51
5	002714	牧原股份	42,936,001.84	2.47
6	002549	凯美特气	38,643,356.00	2.22
7	601899	紫金矿业	38,470,292.85	2.21
8	300124	汇川技术	35,174,024.00	2.02
9	603613	国联股份	34,634,019.63	1.99
10	300750	宁德时代	33,667,373.36	1.93
11	002311	海大集团	33,001,748.00	1.90
12	300896	爱美客	31,904,602.60	1.83
13	601888	中国中免	31,141,403.84	1.79
14	600522	中天科技	30,715,227.20	1.76
15	002415	海康威视	30,635,492.95	1.76
16	000975	银泰黄金	28,982,261.52	1.66
17	688122	西部超导	28,257,439.30	1.62
18	688111	金山办公	27,891,286.08	1.60
19	300144	宋城演艺	27,229,980.62	1.56
20	300395	菲利华	25,314,209.00	1.45

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	2,685,206,326.77
卖出股票的收入（成交）总额	2,849,353,963.41

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。

### 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	25,501,158.89	2.17
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）	577,758.58	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,078,917.47	2.22

### 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	019666	22 国债 01	249,960	25,501,158.89	2.17
2	110053	苏银转债	4,670	577,758.58	0.05



### 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。

### 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 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

本基金本报告期没有投资国债期货。

#### 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 2022 年 4 月 11 日, 宁波银行因代理保险销售不规范, 被宁波银保监局(甬银保监罚决字(2022) 30 号) 给予罚款人民币 30 万元的行政处罚。2022 年 4 月 11 日, 宁波银行因信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位, 被宁波银保监局(甬银保监罚决字(2022) 28 号) 给予罚款人民币 220 万元的行政处罚。2022 年 4 月 21 日, 宁波银行因薪酬管理不到位、关联交易管理不规范等违法违规事项, 被宁波银保监局(甬银保监罚决字(2022) 35 号) 给予罚款人民币 270 万元的行政处罚。2022 年 5 月 27 日, 宁波银行因非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范等违法违规事项, 被宁波银保监局(甬

银保监罚决字〔2022〕44 号) 给予罚款人民币 290 万元的行政处罚。2022 年 9 月 8 日, 宁波银行因柜面业务内控管理不到位, 被宁波银保监局(甬银保监罚决字〔2022〕60 号) 给予罚款人民币 25 万元的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日, 招商银行因监管标准化数据(EAST) 系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规事项, 被中国银行保险监督管理委员会(银保监罚决字〔2022〕21 号) 给予罚款 300 万元的行政处罚。2022 年 9 月 9 日, 招商银行因个人经营贷款挪用至房地产市场等违法违规事项, 被中国银行保险监督管理委员会(银保监罚决字〔2022〕48 号) 给予罚款 460 万元的行政处罚。2022 年 8 月 31 日, 招商银行因违反账户管理规定、违反清算管理规定等违法违规事项, 被中国人民银行(银罚决字〔2022〕1 号) 给予警告, 没收违法所得 5.692641 万元, 罚款 3423.5 万元的行政处罚。

本基金投资上述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。

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	168,522.87
2	应收清算款	431,710.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	374,976.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	975,210.16

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110053	苏银转债	577,758.58	0.05

### 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

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。

## §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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
88,861	16,159.91	11,726,602.74	0.82%	1,424,258,998.88	99.18%

### 9.2 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	527,089.21	0.04%

### 9.3 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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究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。

### 9.4 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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产
		持有本人管理的产

许之彦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

## §10 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)基金份额总额	1,762,466,123.89
本报告期期初基金份额总额	1,641,864,151.26
本报告期基金总申购份额	246,531,859.79
减：本报告期基金总赎回份额	452,410,409.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,435,985,601.62

## §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：

2022年4月30日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告》，范伟隽先生离任本基金管理人的首席信息官。

2022年12月30日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》，任志浩先生新任本基金管理人的首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 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情况为人民币 100,000.00 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

##### 11.7.1 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。

##### 11.7.2 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。

#### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	1	2,177,262,632.50	39.51%	2,001,179.83	39.30%	-
国泰君安证券	1	1,969,870,349.07	35.75%	1,834,150.30	36.02%	-
银河证券	2	942,302,710.04	17.10%	873,322.52	17.15%	-
广发证券	1	421,294,779.75	7.64%	383,927.61	7.54%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
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，最大限度地调调整体资源，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：

无

### 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
浙商证券	416.56	0.00%	-	-	-	-
国泰君安证券	8,110,061.26	6.80%	-	-	-	-
银河证券	111,236,673.30	93.20%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	300.00	0.00%	-	-	-	-

### 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
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（天岳先进）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
3	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 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	2022-01-21
4	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
5	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（万控智造）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-04
6	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	2022-03-15
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（泰恩康）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-23
8	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 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	2022-03-30
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2022-04-21
10	华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-30
11	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（宝立食品）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-07-09
12	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2022-07-20

13	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2022-08-30
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（嘉华股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-09-03
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（浙江正特）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-09-10
16	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（哈铁科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-09-29
17	华安基金管理有限公司关于公司股东股权变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-10-12
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（星环科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-10-12
19	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-10-17
20	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2022-10-25
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（欣灵电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-10-27
22	华安基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-08
23	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（丰立智能）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-08
24	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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	2022-12-19
25	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2022 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	2022-12-19
26	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	2022-12-27
27	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	2022-12-27



		定媒介	
28	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## §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

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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》及其更新
- 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；

### 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

二〇二三年三月三十日