

华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
(原上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金)

2023 年 3 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：二〇二三年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	华安上证50ETF
场内简称	上证50基
基金主代码	510190
交易代码	510190
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年2月23日
报告期末基金份额总额	21,650,796.00份
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	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 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。
业绩比较基准	上证 50 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。
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

2.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	华安上证龙头ETF
场内简称	龙头ETF
基金主代码	510190
交易代码	510190
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年11月18日
报告期末基金份额总额	16,650,796.00份
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	本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数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票及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合，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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证龙头企业指数
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。
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
-------	--------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 2 月 23 日（基金合同生效日）-2023 年 3 月 31 日)
	华安上证 50ETF
1.本期已实现收益	-1,249,230.89
2.本期利润	-2,372,276.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1337
4.期末基金资产净值	76,971,053.36
5.期末基金份额净值	3.5551

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 2 月 22 日)
	华安上证龙头 ETF
1.本期已实现收益	-1,481,669.72
2.本期利润	4,346,031.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.2237

4.期末基金资产净值	61,568,225.64
5.期末基金份额净值	3.698

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

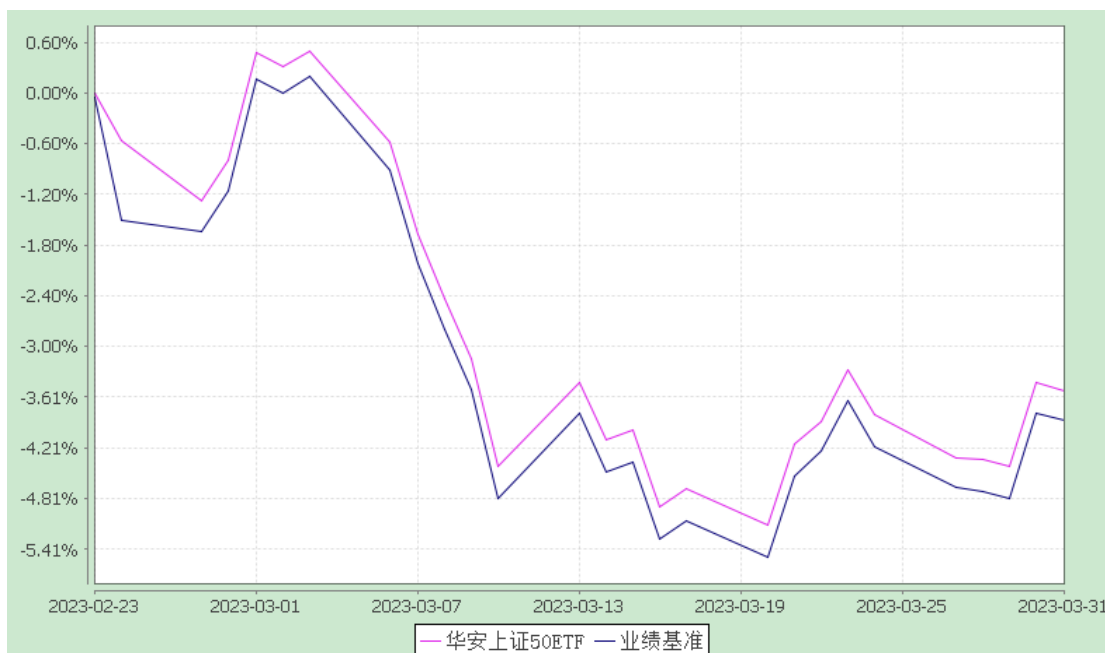
（报告期：2023年2月23日-2023年3月31日）

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.53%	0.72%	-3.88%	0.76%	0.35%	-0.04%

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2023 年 2 月 23 日-2023 年 3 月 31 日)



3.2.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

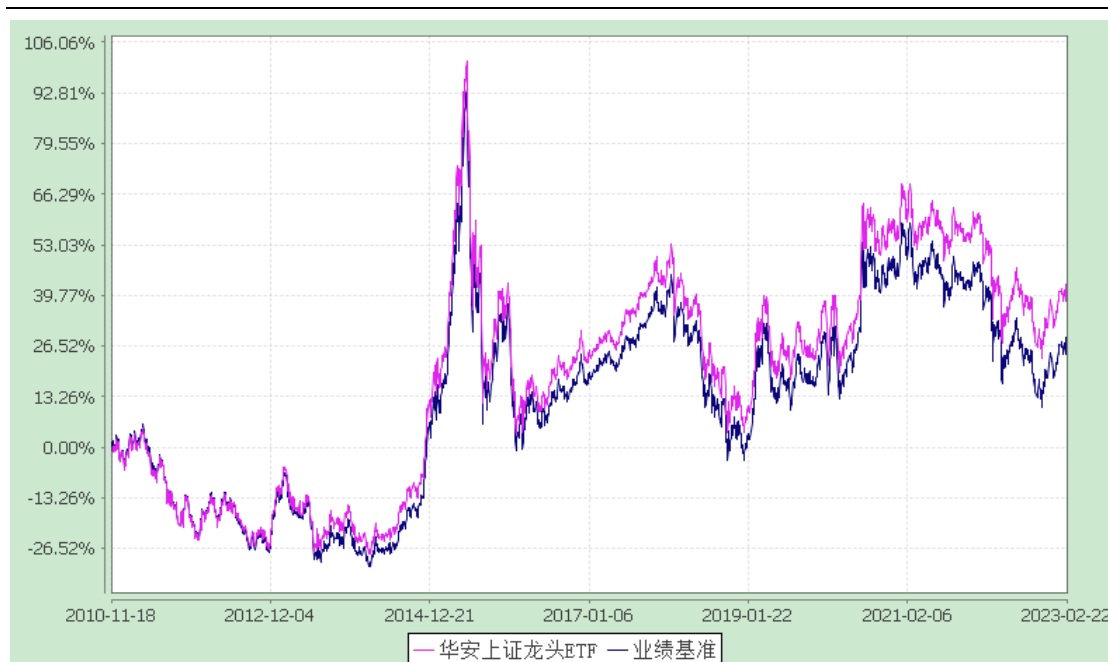
(报告期: 2023年1月1日-2023年2月22日)

3.2.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	7.44%	0.85%	7.77%	0.87%	-0.33%	-0.02%
过去六个月	1.65%	0.98%	1.72%	1.01%	-0.07%	-0.03%
过去一年	-6.92%	1.15%	-8.75%	1.19%	1.83%	-0.04%
过去三年	1.62%	1.14%	-2.73%	1.17%	4.35%	-0.03%
过去五年	0.00%	1.24%	-4.84%	1.27%	4.84%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.69%	1.36%	27.76%	1.38%	13.93%	-0.02%

3.2.2.2 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

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2010年11月18日-2023年2月22日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘璇子	本基金的基金经理	2020-11-02	-	8 年	硕士研究生，8 年基金行业从业经验。2014 年 7 月应届毕业生加入华安基金，曾任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020 年 11 月起，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（2023 年 2 月起，转型为华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金）。2021 年 1 月起，同时担任华安创业板 50 指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证

				<p>券投资基金的基金经理。 2021 年 8 月起,同时担任华安 CES 半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2022 年 7 月,同时担任华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起,同时担任华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证内地新能源主题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 4 月起,同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起,同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2022 年 9 月起,同时担任华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月起,同时担任华安中证上海环交所碳中和指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起,同时担任华安中证基建指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起,同时担任华安上证科创板芯片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。</p>
--	--	--	--	--

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会

同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 2 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年以强政策预期开局，复工复产在 2 月全面开启，产需加速回温，尤其是服务业消费修复速度较快，生产端传统经济修复弹性较高，3 月经济延续回暖态势，制造业 PMI51.9，小幅回落，非制造业 PMI58.2，服务业景气度持续上升。

一季度 A 股市场呈现结构性行情，1 月市场以政策预期主导，2 月定价经济弱复苏趋势，3 月聚焦人工智能、央企价值重估等主题投资机会，计算机、传媒、通信、电子等行业涨幅靠前。一季度沪深 300 指数上涨 4.63%，中证 500 指数上涨 8.1%，上证 50 指数上涨 1.01%。

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

报告期内，本基金于 2023 年 2 月 23 日转型。转型后截至 2023 年 3 月 31 日，华安上证 50ETF 份额净值为 3.5551 元，份额净值增长率为-3.53%，同期业绩比较基准增长率为-3.88%。

转型前截至 2023 年 2 月 22 日，上证龙头 ETF 份额净值为 3.698 元，份额净值增长率为 7.44%，同期业绩比较基准增长率为 7.77%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，国内经济复苏确定性将进一步增强，消费有望继续回暖，基建投资仍将保持较高景气，政策将继续在扩大内需、基础设施建设、科技创新、绿色发展等领域发力。二季度企业盈利有望加速改善，为权益市场表现提供支撑。

随着国内经济修复，市场信心也逐步恢复，风险偏好有望提升，人民币资产对海外资金的吸引力也得到抬升。二季度持续关注政策导向的科技创新、国企改革与内需修复等方向，包括数字经济、人工智能、低估值国企等领域的投资机会。上证 50 指数聚集沪市优质蓝筹资产，在中国特色估值体系的作用下，具备较好的投资价值。

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。

4.4.4 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2023年2月23日-2023年3月31日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	76,519,158.00	98.56
	其中: 股票	76,519,158.00	98.56
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,107,332.35	1.43
7	其他各项资产	10,310.46	0.01
8	合计	77,636,800.81	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.1.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,432,700.00	7.06
C	制造业	37,781,230.00	49.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,246,762.00	4.22
E	建筑业	1,915,176.00	2.45

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	791,954.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,024,758.00	1.33
J	金融业	21,300,651.00	27.67
K	房地产业	1,140,291.00	1.48
L	租赁和商务服务业	2,088,936.00	2.93
M	科学研究和技术服务业	1,796,700.00	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,519,158.00	99.41

5.1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.1.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,400	13,468,000.00	17.50
2	601318	中国平安	122,100	5,567,760.00	7.23
3	600036	招商银行	139,400	4,777,238.00	6.21
4	601166	兴业银行	163,000	2,753,070.00	3.58
5	601012	隆基绿能	68,100	2,751,921.00	3.58
6	600900	长江电力	127,800	2,715,750.00	3.53
7	600030	中信证券	109,900	2,250,752.00	2.92
8	600276	恒瑞医药	50,400	2,158,128.00	2.80
9	600887	伊利股份	72,000	2,096,640.00	2.72
10	601888	中国中免	11,400	2,088,936.00	2.71

5.1.3.2 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.1.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 2022 年 8 月 22 日，中国平安因未按照规定进行国际收支统计申报，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2022〕23 号）责令改正、给予警告，并处罚款人民币 30 万

元。

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。

2022 年 9 月 9 日，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）41 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。2022 年 9 月 28 日，兴业银行因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）50 号）给予罚款 450 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,310.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,310.46

5.1.11.4 报告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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1.11.5.1 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。

5.1.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

5.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2023年1月1日-2023年2月22日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	59,507,294.67	96.33
	其中：股票	59,507,294.67	96.33
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,270,102.87	3.67
7	其他各项资产	185.41	0.00
8	合计	61,777,582.95	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	535,148.00	0.87
B	采矿业	2,960,552.20	4.81
C	制造业	28,034,479.05	45.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,614,771.00	2.62

E	建筑业	1,511,110.72	2.45
F	批发和零售业	3,865,645.00	6.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,018,248.13	1.65
H	住宿和餐饮业	1,239,948.00	2.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,128,789.82	8.33
J	金融业	6,762,410.12	10.98
K	房地产业	1,521,887.53	2.47
L	租赁和商务服务业	1,802,991.00	2.93
M	科学研究和技术服务业	604,080.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	1,100,497.10	1.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	668,735.00	1.09
R	文化、体育和娱乐业	1,138,002.00	1.85
S	综合	-	-
	合计	59,507,294.67	96.65

5.2.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601360	三六零	78,200	911,030.00	1.48
2	603993	洛阳钼业	116,400	714,696.00	1.16
3	601728	中国电信	122,200	694,096.00	1.13
4	603833	欧派家居	4,840	677,842.00	1.10
5	600845	宝信软件	13,800	673,302.00	1.09
6	603882	金域医学	7,900	668,735.00	1.09
7	600705	中航产融	152,034	665,908.92	1.08
8	600031	三一重工	34,400	665,296.00	1.08
9	600415	小商品城	122,200	657,436.00	1.07
10	600519	贵州茅台	355	651,780.00	1.06

5.2.3.2 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.2.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.2.7 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。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.2.10.2 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。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	185.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185.41

5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 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。

5.2.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

§6 开放式基金份额变动

6.1 华安上证50交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	16,650,796.00
报告期期间基金总申购份额	5,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,650,796.00

6.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

本报告期初基金份额总额	16,650,796.00
报告期期间基金总申购份额	19,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	19,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	16,650,796.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.1.1 华安上证50交易型开放式指数证券投资基金

无。

7.1.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 华安上证50交易型开放式指数证券投资基金

8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230223-20230331	10,845,876.00	4,471,000.00	107,200.00	15,209,676.00	70.25%
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。							

8.2 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基	1	20230101-202302	11,265,	19,040,	19,460,00	10,845,876.0	65.14%

金		22	876.00	000.00	0.00	0	
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。							

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金合同》
- 2、《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

9.2 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>。

9.3 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
二〇二三年四月二十一日