

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	67
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	68
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注.....	68

8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	70
9 开放式基金份额变动	70
10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	73
11 影响投资者决策的其他重要信息	74
12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

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	1,419,384,926.89 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@huanan.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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	-23,282,802.60
本期利润	-46,403,070.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0326
本期加权平均净值利润率	-3.91%
本期基金份额净值增长率	-4.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	682,067,883.58
期末可供分配基金份额利润	0.4805
期末基金资产净值	1,114,586,431.07
期末基金份额净值	0.785
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	438.90%

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）。

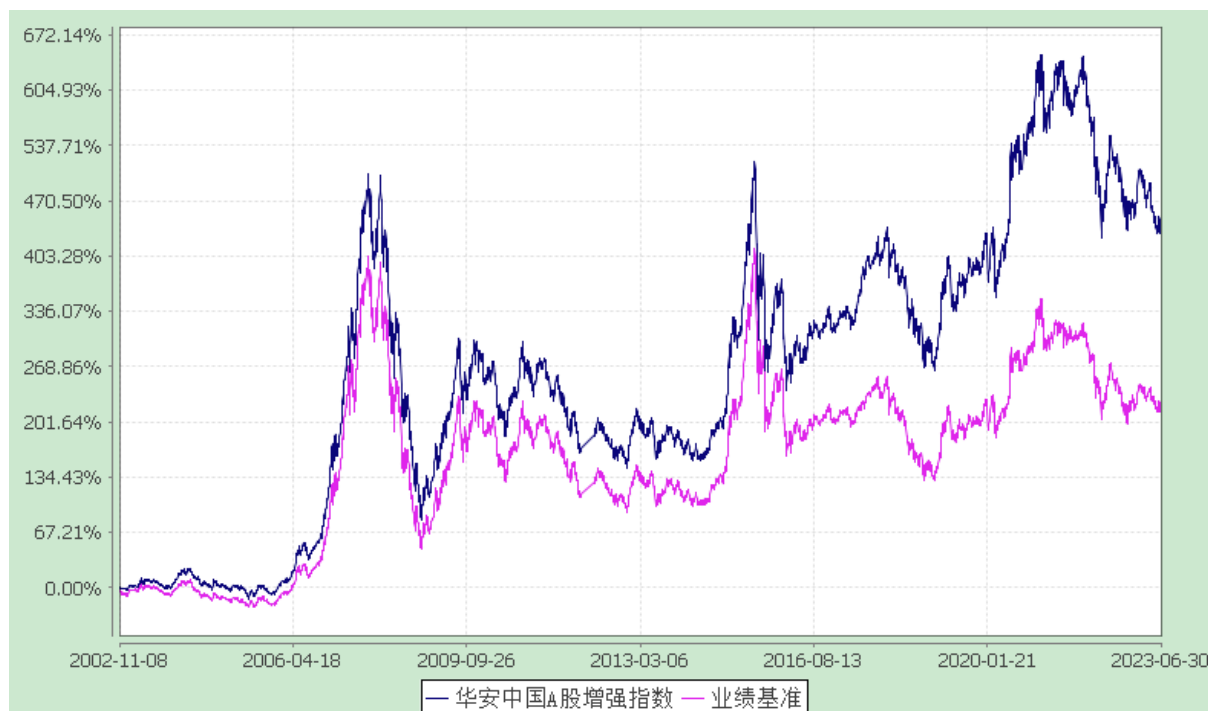
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.55%	0.84%	0.73%	0.84%	0.82%	0.00%
过去三个月	-7.21%	0.80%	-5.44%	0.77%	-1.77%	0.03%
过去六个月	-4.03%	0.83%	-1.11%	0.77%	-2.92%	0.06%
过去一年	-17.11%	0.94%	-13.83%	0.91%	-3.28%	0.03%
过去三年	-2.46%	1.24%	-5.16%	1.13%	2.70%	0.11%
自基金合同生效起至今	438.90%	1.53%	217.30%	1.50%	221.60%	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
 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
 （2002 年 11 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日）



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 2023 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 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	2017-12-	-	19 年	理学博士，19 年证券、基金从业

	<p>经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理</p>	<p>25</p>		<p>经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师。2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金)、华安中证银行指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为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</p>
--	------------------------------	-----------	--	--

					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。
马韬	本基金的基金经理	2018-01-15	-	8 年	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	58,155,343,687.85	2008-04-25
	私募资产管理计划	2.00	200,333,530.57	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	16.00	58,355,677,218.42	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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、不同投资组合日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 7 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

2023 年上半年国内宏观经济复苏面临一定的压力，工业企业利润依然呈现负增长，不过最新数据显示经济压力在边际上已经所缓和。库存处于快速去化的阶段之中，按照现有速度推断，预期在较快的时间窗口内就能看到这一轮库存周期见底。最新 PMI 数据显示经济景气度有所回升，结构上来看医药 PMI 持续上升，专用设备制造业、电气机构有所下降。

权益市场在上半年也同样表现出一定的压力，呈现出较为明显的主题结构性行情。除了 AI、中特估等个别板块表现较强以外，其他行业板块均无亮眼表现，尤其是像新能源、医药、消费等传统优势赛道表现较为疲弱。随着资金持续涌入 AI 板块，量化模型产生了一定不适应的情况。我们在模型中会及时加入最新的行情数据进行适应性的训练，争取尽快平稳度过阶段性的回撤。本基金配置上仍然兼顾均衡，选择基本面较好且与技术面发生共振的优质股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.785 元，本报告期份额净值增长率为-4.03%，同期业绩比较基准增长率为-1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，全球宏观不确定性因素仍然较多，但国内相关托底政策将加力护航经济平稳恢复，当前市场相关风险因素释放也较为充分，未来对权益市场表现不必过度悲观。从具体节奏来看，对证券市场整体的判断应该是继续演绎结构性行情，在没有特别明显增量资金的情况下，板块和行业之间的轮动效应可能会加强。在基本配置上，仍然看好两大投资方向，顺周期板块目前处于左侧磨底的过程之中，随着宏观经济逐渐复苏相关板块大概率会跑出不错的超额收益；另一方面，此次 AI 行业变革是历史难遇的大产业周期，相关产业链条也会涌现出大量的投资机会。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	70,445,356.56	43,214,524.67
结算备付金		2,350,013.92	1,903,828.31
存出保证金		178,128.18	168,522.87
交易性金融资产	6.4.7.2	1,053,118,623.46	1,134,785,272.71
其中：股票投资		1,053,117,427.82	1,108,706,355.24
基金投资		-	-

债券投资		1,195.64	26,078,917.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	431,710.55
应收股利		-	-
应收申购款		262,599.87	374,976.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,126,354,721.99	1,180,878,835.85
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,379,760.44	-
应付赎回款		423,028.15	737,655.94
应付管理人报酬		917,318.34	996,049.94
应付托管费		183,463.66	199,209.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,864,720.33	3,609,601.03
负债合计		11,768,290.92	5,542,518.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	432,518,547.49	437,577,480.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	682,067,883.58	737,758,836.79
净资产合计		1,114,586,431.07	1,175,336,317.49
负债和净资产总计		1,126,354,721.99	1,180,878,835.85

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.785 元，基金份额总额 1,419,384,926.89 份。

6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-39,213,109.43	-185,868,144.29
1.利息收入		138,281.73	69,270.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	138,281.73	69,270.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,235,979.13	-111,363,704.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-27,054,118.19	-119,430,563.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	43,904.67	729,318.80
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	10,774,234.39	7,337,540.59
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-23,120,268.26	-74,581,309.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,856.23	7,599.28
减：二、营业总支出		7,189,961.43	8,383,584.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,893,027.62	6,887,653.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,178,605.55	1,377,530.77
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		0.37	3.79
8. 其他费用	6.4.7.16	118,327.89	118,396.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-46,403,070.86	-194,251,728.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-46,403,070.86	-194,251,728.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-46,403,070.86	-194,251,728.73

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
二、本期期初净资产（基金净值）	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,058,933.21	-	-55,690,953.21	-60,749,886.42
（一）、综合收益总额	-	-	-46,403,070.86	-46,403,070.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,058,933.21	-	-9,287,882.35	-14,346,815.56
其中：1.基金申购款	24,307,446.02	-	41,952,499.85	66,259,945.87
2.基金赎回款	-29,366,379.23	-	-51,240,382.20	-80,606,761.43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	432,518,547.49	-	682,067,883.58	1,114,586,431.07
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	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
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	-70,702,680.62	-	-334,368,648.19	-

动额(减少以“-”号填列)				405,071,328.81
(一)、综合收益总额	-	-	-194,251,728.73	194,251,728.73
(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)	-70,702,680.62	-	-140,116,919.46	210,819,600.08
其中: 1.基金申购款	39,811,577.61	-	79,432,008.55	119,243,586.16
2.基金赎回款	-110,514,258.23	-	-219,548,928.01	330,063,186.24
(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)	429,655,126.42	-	906,114,109.64	1,335,769,236.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金，跟踪标的的成份指数由上证 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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生

的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	70,445,356.56
等于: 本金	70,439,366.60
加: 应计利息	5,989.96
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	70,445,356.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,161,867,728.05	-	1,053,117,427.82	-108,750,300.23

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.84	1,195.64	194.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.84	1,195.64	194.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,161,868,728.05	0.84	1,053,118,623.46	-108,750,105.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,255,624.39
其中：交易所市场	3,253,193.20
银行间市场	2,431.19
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	49,588.57
其他	500,000.00

合计	3,864,720.33
----	--------------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,435,985,601.62	437,577,480.70
本期申购	79,769,709.62	24,307,446.02
本期赎回（以“-”号填列）	-96,370,384.35	-29,366,379.23
本期末	1,419,384,926.89	432,518,547.49

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	899,151,209.15	-161,392,372.36	737,758,836.79
本期利润	-23,282,802.60	-23,120,268.26	-46,403,070.86
本期基金份额交易产生的变动数	-10,360,205.77	1,072,323.42	-9,287,882.35
其中：基金申购款	50,617,987.60	-8,665,487.75	41,952,499.85
基金赎回款	-60,978,193.37	9,737,811.17	-51,240,382.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	865,508,200.78	-183,440,317.20	682,067,883.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	17,091.86
其他	1,457.22
合计	138,281.73

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,054,118.19
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-27,054,118.19

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,765,376,779.89
减：卖出股票成本总额	1,787,134,138.36
减：交易费用	5,296,759.72
买卖股票差价收入	-27,054,118.19

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	18,286.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,618.67
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	43,904.67

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,564,648.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,006,143.95
减：应计利息总额	532,844.52
减：交易费用	41.64

买卖债券差价收入	25,618.67
----------	-----------

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,774,234.39
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	10,774,234.39

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-23,120,268.26
——股票投资	-23,172,745.81
——债券投资	52,477.55
——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	-23,120,268.26

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	3,882.63
基金转换费收入	973.60

合计	4,856.23
----	----------

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行汇划费	231.95
合计	118,327.89

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

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

	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,953,468,649.79	55.66%	458,301,443.80	19.15%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,433,077.60	99.92%	1,367,000.00	1.21%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,819,267.69	55.92%	1,819,267.69	55.92%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	426,817.16	19.35%	426,817.16	19.35%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,893,027.62	6,887,653.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,735,315.93	1,818,890.89

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,178,605.55	1,377,530.77

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	70,445,356.56	119,732.65	31,784,194.84	51,630.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303.00	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	601916	浙商银行	老股东配售	30.00	60.60
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318.00	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508.00	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581.00	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499.00	30,873.13
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759.00	562,375.50

公司					
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	301263	泰恩康	网下申购	6,813.00	135,783.09

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688343	云天励飞	2023-03-28	1-6 个月（含）	新股限售	43.92	50.67	15,393	676,060.56	779,963.31	-
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6 个月（含）	新股限售	11.10	17.04	3,910	43,401.00	66,626.40	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6 个月（含）	新股限售	23.77	42.89	1,447	34,395.19	62,061.83	-
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6 个月（含）	新股限售	5.69	5.41	10,605	60,342.45	57,373.05	-
688361	中科飞测	2023-05-12	1-6 个月	新股限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-

			(含)							
688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6个月(含)	新股限售	37.88	29.49	1,716	65,002.08	50,604.84	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	1-6个月(含)	新股限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
001287	中电港	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6个月(含)	新股限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688507	索辰科技	2023-04-10	1-6个月(含)	新股限售	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023-06-21	1-6个月(含)	新股限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
601061	中信金属	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	6.58	7.58	3,440	22,635.20	26,075.20	-
301293	三博脑科	2023-04-25	1-6个月(含)	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6个月(含)	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航天南湖	2023-05-08	1-6个月(含)	新股限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-

688570	天玛智控	2023-05-29	1-6 个月 (含)	新股限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	1-6 个月 (含)	新股限售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	1-6 个月 (含)	新股限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	1-6 个月 (含)	新股限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301399	英特科技	2023-05-16	1-6 个月 (含)	新股限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	1-6 个月 (含)	新股限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
688334	西高院	2023-06-09	1-6 个月 (含)	新股限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1-6 个月 (含)	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	1-6 个月 (含)	新股限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	1-6 个月 (含)	新股限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6 个月 (含)	新股限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

688620	安凯微	2023-06-15	1-6 个月 (含)	新股限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	1-6 个月 (含)	新股限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6 个月 (含)	新股限售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1-6 个月 (含)	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	1-6 个月 (含)	新股限售	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	1-6 个月 (含)	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	1-6 个月 (含)	新股限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6 个月 (含)	新股限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	1-6 个月 (含)	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6 个月 (含)	新股限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6 个月 (含)	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
30132	新莱	2023-	1-6 个月	新股	39.06	39.36	228	8,905.	8,974.	-

3	福	05-29	月 (含)	限售				68	08	
688429	时创能源	2023-06-20	1-6个月 (含)	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6个月 (含)	新股限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6个月 (含)	新股限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月 (含)	新股限售	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月 (含)	新股限售-送股	-	25.10	97	-	2,434.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	1-6个月 (含)	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	1-6个月 (含)	新股限售	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1-6个月 (含)	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023-03-28	1-6个月 (含)	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	1-6个月 (含)	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1-6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

			(含)							
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6个月(含)	新股限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6个月(含)	新股限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	1-6个月(含)	新股限售	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	1-6个月(含)	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6个月(含)	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6个月(含)	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
601916	浙商银行	2023-06-27	1个月内(含)	配股未上市	2.02	2.64	30	60.60	79.20	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-

)							
30120 2	朗威 股份	2023- 06-28	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	25.82	25.82	2,754	71,108 .28	71,108 .28	-
68860 3	天承 科技	2023- 06-30	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	55.00	55.00	1,251	68,805 .00	68,805 .00	-
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	36.90	36.90	1,775	65,497 .50	65,497 .50	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘 单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00054 0	中天金 融	2023- 05-19	重大事 项或临 时停牌	0.01	-	-	100	297.00	1.00	-
00067 1	阳光 城	2023- 06-12	重大事 项或临 时停牌	0.01	-	-	100	631.00	1.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经

营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处

的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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上市公司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%。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金的生息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，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	70,445,356.56	-	-	-	70,445,356.56
结算备付金	2,350,013.92	-	-	-	2,350,013.92
存出保证金	178,128.18	-	-	-	178,128.18
交易性金融资产	1,195.64	-	-	1,053,117,427.82	1,053,118,623.46
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	262,599.87	262,599.87
资产总计	72,974,694.30	-	-	1,053,380,027.69	1,126,354,721.99
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	-	-	-	6,379,760.44	6,379,760.44
应付赎回款	-	-	-	423,028.15	423,028.15
应付管理人报酬	-	-	-	917,318.34	917,318.34
应付托管费	-	-	-	183,463.66	183,463.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,864,720.33	3,864,720.33
负债总计	-	-	-	11,768,290.92	11,768,290.92
利率敏感度缺口	72,974,694.30	-	-	1,041,611,736.77	1,114,586,431.07
上年度末 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

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0001%(2022 年 12 月 31 日：2.22%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取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。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，投资组合中股票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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,053,117,427.82	94.49	1,108,706,355.24	94.33
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,053,117,427.82	94.49	1,109,284,113.82	94.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	58,060,000.00	62,140,000.00
	2.业绩比较基准下降 5%	-58,060,000.00	-62,140,000.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,050,965,312.53	1,108,188,197.90
第二层次	471,091.22	25,501,158.89
第三层次	1,682,219.71	1,095,915.92
合计	1,053,118,623.46	1,134,785,272.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,053,117,427.82	93.50
	其中：股票	1,053,117,427.82	93.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,195.64	0.00
	其中：债券	1,195.64	0.00
	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	72,795,370.48	6.46
8	其他各项资产	440,728.05	0.04
9	合计	1,126,354,721.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 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	12,380,295.90	1.11
B	采矿业	30,496,086.71	2.74

C	制造业	486,723,282.64	43.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,697,495.00	0.87
E	建筑业	30,850,917.25	2.77
F	批发和零售业	2,894,611.47	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	28,231,037.68	2.53
H	住宿和餐饮业	23,065.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,412,980.57	5.06
J	金融业	154,003,765.11	13.82
K	房地产业	9,145,599.26	0.82
L	租赁和商务服务业	8,498,045.78	0.76
M	科学研究和技术服务业	26,297,467.07	2.36
N	水利、环境和公共设施管理业	5,271.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,160.00	0.00
Q	卫生和社会工作	7,413,116.07	0.67
R	文化、体育和娱乐业	5,461,391.34	0.49
S	综合	721.00	0.00
	合计	868,548,308.85	77.93

7.2.2 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	635.60	0.00
B	采矿业	3,264,424.23	0.29
C	制造业	152,802,476.70	13.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,409,653.23	0.40
E	建筑业	2,337,148.64	0.21
F	批发和零售业	179,700.16	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	51,934.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,251,409.60	1.37
J	金融业	88,598.30	0.01
K	房地产业	3,966.00	0.00
L	租赁和商务服务业	1,177.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	3,934,535.94	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	94,790.79	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,124,885.92	0.19
S	综合	-	-
	合计	184,569,118.97	16.56

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	30,233	51,124,003.00	4.59
2	300750	宁德时代	148,412	33,955,181.48	3.05
3	000333	美的集团	467,285	27,532,432.20	2.47
4	600030	中信证券	1,172,233	23,186,768.74	2.08
5	300274	阳光电源	182,500	21,284,975.00	1.91
6	600036	招商银行	628,600	20,592,936.00	1.85
7	601318	中国平安	397,834	18,459,497.60	1.66
8	601169	北京银行	3,627,700	16,796,251.00	1.51
9	603259	药明康德	265,357	16,534,394.67	1.48
10	002142	宁波银行	611,410	15,468,673.00	1.39
11	300059	东方财富	1,085,825	15,418,715.00	1.38
12	000858	五粮液	92,544	15,137,422.08	1.36
13	688111	金山办公	28,126	13,281,659.72	1.19
14	601577	长沙银行	1,611,500	12,505,240.00	1.12
15	002594	比亚迪	46,900	12,112,863.00	1.09
16	600690	海尔智家	515,120	12,095,017.60	1.09
17	002371	北方华创	36,900	11,721,285.00	1.05
18	601668	中国建筑	1,967,600	11,294,024.00	1.01
19	601628	中国人寿	310,500	10,855,080.00	0.97

20	600809	山西汾酒	57,100	10,567,497.00	0.95
21	300012	华测检测	499,732	9,744,774.00	0.87
22	601390	中国中铁	1,281,300	9,712,254.00	0.87
23	300782	卓胜微	97,900	9,460,077.00	0.85
24	002138	顺络电子	382,500	9,145,575.00	0.82
25	600745	闻泰科技	181,900	8,894,910.00	0.80
26	002475	立讯精密	268,032	8,697,638.40	0.78
27	600050	中国联通	1,804,200	8,660,160.00	0.78
28	300454	深信服	75,900	8,595,675.00	0.77
29	601012	隆基绿能	296,891	8,511,864.97	0.76
30	600256	广汇能源	1,239,800	8,505,028.00	0.76
31	000513	丽珠集团	202,400	7,875,384.00	0.71
32	600150	中国船舶	236,500	7,783,215.00	0.70
33	002415	海康威视	233,700	7,737,807.00	0.69
34	600118	中国卫星	272,900	7,698,509.00	0.69
35	601333	广深铁路	1,918,800	7,598,448.00	0.68
36	300498	温氏股份	408,200	7,490,470.00	0.67
37	002518	科士达	186,100	7,445,861.00	0.67
38	600011	华能国际	792,600	7,339,476.00	0.66
39	000100	TCL 科技	1,810,380	7,132,897.20	0.64
40	000568	泸州老窖	32,900	6,894,853.00	0.62
41	601088	中国神华	222,600	6,844,950.00	0.61
42	000157	中联重科	997,800	6,735,150.00	0.60
43	002938	鹏鼎控股	272,800	6,626,312.00	0.59
44	601800	中国交建	597,000	6,513,270.00	0.58
45	600048	保利发展	496,600	6,470,698.00	0.58
46	002984	森麒麟	199,700	6,282,562.00	0.56
47	600588	用友网络	301,100	6,172,550.00	0.55
48	603885	吉祥航空	396,800	6,122,624.00	0.55
49	002271	东方雨虹	222,000	6,051,720.00	0.54
50	600183	生益科技	413,900	5,877,380.00	0.53
51	000661	长春高新	41,500	5,656,450.00	0.51
52	600547	山东黄金	240,200	5,639,896.00	0.51
53	300413	芒果超媒	157,290	5,380,890.90	0.48
54	601888	中国中免	47,270	5,224,753.10	0.47
55	600426	华鲁恒升	166,500	5,099,895.00	0.46
56	601728	中国电信	879,000	4,948,770.00	0.44
57	600968	海油发展	1,599,900	4,911,693.00	0.44
58	601111	中国国航	594,532	4,898,943.68	0.44
59	000063	中兴通讯	107,400	4,890,996.00	0.44
60	600559	老白干酒	199,400	4,887,294.00	0.44
61	002714	牧原股份	115,886	4,884,594.90	0.44
62	300760	迈瑞医疗	16,088	4,823,182.40	0.43
63	603501	韦尔股份	47,695	4,676,017.80	0.42

64	600760	中航沈飞	103,236	4,645,620.00	0.42
65	002465	海格通信	434,000	4,487,560.00	0.40
66	002429	兆驰股份	813,000	4,471,500.00	0.40
67	002044	美年健康	623,600	4,433,796.00	0.40
68	600967	内蒙一机	432,100	4,364,210.00	0.39
69	601688	华泰证券	310,124	4,270,407.48	0.38
70	002352	顺丰控股	91,500	4,125,735.00	0.37
71	600867	通化东宝	394,900	4,122,756.00	0.37
72	600380	健康元	318,644	4,049,965.24	0.36
73	000893	亚钾国际	175,200	4,019,088.00	0.36
74	300014	亿纬锂能	66,200	4,005,100.00	0.36
75	000001	平安银行	354,200	3,977,666.00	0.36
76	002410	广联达	122,080	3,966,379.20	0.36
77	688777	中控技术	63,078	3,960,036.84	0.36
78	300124	汇川技术	61,100	3,923,231.00	0.35
79	600893	航发动力	92,166	3,894,935.16	0.35
80	603986	兆易创新	34,800	3,697,500.00	0.33
81	002600	领益智造	534,000	3,689,940.00	0.33
82	000425	徐工机械	538,500	3,645,645.00	0.33
83	002459	晶澳科技	86,296	3,598,543.20	0.32
84	600703	三安光电	201,000	3,465,240.00	0.31
85	000739	普洛药业	194,800	3,455,752.00	0.31
86	000725	京东方 A	825,100	3,374,659.00	0.30
87	002624	完美世界	198,900	3,359,421.00	0.30
88	600879	航天电子	393,600	3,341,664.00	0.30
89	600276	恒瑞医药	69,600	3,333,840.00	0.30
90	601618	中国中冶	837,800	3,326,066.00	0.30
91	300450	先导智能	90,657	3,279,063.69	0.29
92	002468	申通快递	301,400	3,261,148.00	0.29
93	002027	分众传媒	477,800	3,253,818.00	0.29
94	300296	利亚德	495,900	3,238,227.00	0.29
95	000651	格力电器	88,100	3,216,531.00	0.29
96	300223	北京君正	36,000	3,179,160.00	0.29
97	603799	华友钴业	67,914	3,117,931.74	0.28
98	688981	中芯国际	61,397	3,101,776.44	0.28
99	600845	宝信软件	58,384	2,966,491.04	0.27
100	002850	科达利	21,600	2,856,600.00	0.26
101	601939	建设银行	455,400	2,850,804.00	0.26
102	603305	旭升集团	100,600	2,803,722.00	0.25
103	600309	万华化学	31,700	2,784,528.00	0.25
104	600763	通策医疗	27,600	2,673,336.00	0.24
105	002409	雅克科技	31,600	2,303,008.00	0.21
106	000733	振华科技	23,600	2,262,060.00	0.20
107	600699	均胜电子	127,600	2,250,864.00	0.20

108	600021	上海电力	207,700	2,236,929.00	0.20
109	601319	中国人保	382,700	2,234,968.00	0.20
110	603993	洛阳钼业	419,300	2,234,869.00	0.20
111	601336	新华保险	60,500	2,224,585.00	0.20
112	001979	招商蛇口	168,500	2,195,555.00	0.20
113	601377	兴业证券	357,240	2,186,308.80	0.20
114	600938	中国海油	117,800	2,134,536.00	0.19
115	601816	京沪高铁	391,700	2,060,342.00	0.18
116	688599	天合光能	46,031	1,961,380.91	0.18
117	002466	天齐锂业	27,200	1,901,552.00	0.17
118	002129	TCL 中环	57,000	1,892,400.00	0.17
119	600755	厦门国贸	243,000	1,880,820.00	0.17
120	000776	广发证券	119,645	1,759,977.95	0.16
121	002252	上海莱士	232,500	1,746,075.00	0.16
122	002532	天山铝业	285,200	1,708,348.00	0.15
123	603338	浙江鼎力	26,200	1,467,462.00	0.13
124	603129	春风动力	8,600	1,392,340.00	0.12
125	603707	健友股份	101,940	1,376,190.00	0.12
126	600132	重庆啤酒	14,400	1,327,104.00	0.12
127	603486	科沃斯	15,900	1,236,543.00	0.11
128	688122	西部超导	21,293	1,186,658.89	0.11
129	603185	弘元绿能	15,200	1,133,160.00	0.10
130	002727	一心堂	37,000	976,800.00	0.09
131	002180	纳思达	23,300	798,025.00	0.07
132	002463	沪电股份	33,210	695,417.40	0.06
133	601689	拓普集团	6,400	516,480.00	0.05
134	000002	万 科 A	33,813	474,058.26	0.04
135	600438	通威股份	12,500	428,875.00	0.04
136	300601	康泰生物	15,000	380,850.00	0.03
137	600522	中天科技	23,800	378,658.00	0.03
138	002812	恩捷股份	3,900	375,765.00	0.03
139	002555	三七互娱	8,300	289,504.00	0.03
140	600919	江苏银行	38,100	280,035.00	0.03
141	601288	农业银行	56,700	200,151.00	0.02
142	601398	工商银行	36,900	177,858.00	0.02
143	300015	爱尔眼科	9,416	174,666.80	0.02
144	002920	德赛西威	1,100	171,391.00	0.02
145	600346	恒力石化	11,880	170,240.40	0.02
146	002493	荣盛石化	14,250	165,870.00	0.01
147	601857	中国石油	21,000	156,870.00	0.01
148	002311	海大集团	3,100	145,204.00	0.01
149	601872	招商轮船	23,300	134,907.00	0.01
150	600000	浦发银行	17,800	128,872.00	0.01
151	601229	上海银行	22,300	128,225.00	0.01

152	300244	迪安诊断	4,829	123,767.27	0.01
153	600016	民生银行	32,900	123,375.00	0.01
154	601166	兴业银行	7,100	111,115.00	0.01
155	601985	中国核电	15,600	109,980.00	0.01
156	603444	吉比特	200	98,222.00	0.01
157	300308	中际旭创	635	93,630.75	0.01
158	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.01
159	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.01
160	603288	海天味业	1,585	74,257.25	0.01
161	002739	万达电影	5,886	73,810.44	0.01
162	000538	云南白药	1,120	58,777.60	0.01
163	002683	广东宏大	1,900	55,936.00	0.01
164	600352	浙江龙盛	5,700	53,295.00	0.00
165	688037	芯源微	296	50,601.20	0.00
166	300896	爱美客	100	44,495.00	0.00
167	000895	双汇发展	1,800	44,082.00	0.00
168	000401	冀东水泥	5,500	40,535.00	0.00
169	002080	中材科技	1,844	37,838.88	0.00
170	688598	金博股份	200	34,300.00	0.00
171	000876	新希望	2,900	33,872.00	0.00
172	688390	固德威	200	33,372.00	0.00
173	600436	片仔癀	100	28,636.00	0.00
174	300751	迈为股份	160	27,100.80	0.00
175	000596	古井贡酒	100	24,738.00	0.00
176	601211	国泰君安	1,600	22,384.00	0.00
177	000800	一汽解放	2,600	21,762.00	0.00
178	603290	斯达半导	100	21,520.00	0.00
179	600754	锦江酒店	500	21,170.00	0.00
180	002001	新和成	1,247	19,203.80	0.00
181	601360	三六零	1,500	18,810.00	0.00
182	300769	德方纳米	160	17,636.80	0.00
183	002049	紫光国微	185	17,251.25	0.00
184	002127	南极电商	4,496	17,219.68	0.00
185	688220	翱捷科技	200	15,078.00	0.00
186	603345	安井食品	100	14,680.00	0.00
187	600563	法拉电子	100	13,730.00	0.00
188	300474	景嘉微	150	13,498.50	0.00
189	300502	新易盛	196	13,322.12	0.00
190	002607	中公教育	2,800	13,160.00	0.00
191	002304	洋河股份	100	13,135.00	0.00
192	600702	舍得酒业	100	12,395.00	0.00
193	601799	星宇股份	100	12,360.00	0.00
194	002821	凯莱英	100	11,786.00	0.00
195	688005	容百科技	200	10,804.00	0.00

196	300661	圣邦股份	130	10,676.90	0.00
197	688556	高测股份	200	10,628.00	0.00
198	300763	锦浪科技	100	10,410.00	0.00
199	600600	青岛啤酒	100	10,363.00	0.00
200	688139	海尔生物	200	10,294.00	0.00
201	600536	中国软件	208	9,751.04	0.00
202	603613	国联股份	261	9,638.73	0.00
203	300496	中科创达	100	9,635.00	0.00
204	603833	欧派家居	100	9,580.00	0.00
205	300567	精测电子	100	9,515.00	0.00
206	300487	蓝晓科技	150	9,363.00	0.00
207	600941	中国移动	100	9,330.00	0.00
208	603160	汇顶科技	200	9,250.00	0.00
209	000977	浪潮信息	190	9,215.00	0.00
210	603737	三棵树	140	9,158.80	0.00
211	000799	酒鬼酒	100	9,015.00	0.00
212	603899	晨光股份	200	8,928.00	0.00
213	603713	密尔克卫	100	8,909.00	0.00
214	600486	扬农化工	100	8,742.00	0.00
215	002460	赣锋锂业	140	8,534.40	0.00
216	300595	欧普康视	280	8,453.20	0.00
217	002179	中航光电	182	8,253.70	0.00
218	603236	移远通信	140	8,079.40	0.00
219	603127	昭衍新药	196	8,016.40	0.00
220	603882	金城医学	100	7,550.00	0.00
221	002916	深南电路	100	7,537.00	0.00
222	002738	中矿资源	140	7,131.60	0.00
223	002568	百润股份	196	7,124.60	0.00
224	300316	晶盛机电	100	7,090.00	0.00
225	603260	合盛硅业	100	7,002.00	0.00
226	002230	科大讯飞	100	6,796.00	0.00
227	603939	益丰药房	182	6,734.00	0.00
228	603658	安图生物	130	6,724.90	0.00
229	300122	智飞生物	150	6,630.00	0.00
230	603267	鸿远电子	100	6,530.00	0.00
231	300347	泰格医药	100	6,454.00	0.00
232	601100	恒立液压	100	6,433.00	0.00
233	600584	长电科技	200	6,234.00	0.00
234	000999	华润三九	100	6,066.00	0.00
235	300747	锐科激光	195	5,943.60	0.00
236	600779	水井坊	100	5,899.00	0.00
237	600085	同仁堂	100	5,756.00	0.00
238	601021	春秋航空	100	5,747.00	0.00
239	603659	璞泰来	145	5,541.90	0.00

240	601877	正泰电器	200	5,530.00	0.00
241	600529	山东药玻	200	5,444.00	0.00
242	000423	东阿阿胶	100	5,345.00	0.00
243	603369	今世缘	100	5,280.00	0.00
244	603806	福斯特	140	5,206.60	0.00
245	603019	中科曙光	100	5,090.00	0.00
246	300073	当升科技	100	5,033.00	0.00
247	002032	苏泊尔	100	5,000.00	0.00
248	603816	顾家家居	130	4,959.50	0.00
249	300699	光威复材	160	4,936.00	0.00
250	603589	口子窖	100	4,935.00	0.00
251	300628	亿联网络	140	4,909.80	0.00
252	603606	东方电缆	100	4,903.00	0.00
253	300803	指南针	100	4,859.00	0.00
254	603233	大参林	173	4,845.73	0.00
255	300438	鹏辉能源	100	4,804.00	0.00
256	300558	贝达药业	100	4,803.00	0.00
257	300604	长川科技	100	4,749.00	0.00
258	300777	中简科技	100	4,726.00	0.00
259	000400	许继电气	200	4,610.00	0.00
260	600009	上海机场	100	4,542.00	0.00
261	300726	宏达电子	100	4,472.00	0.00
262	600089	特变电工	200	4,458.00	0.00
263	600570	恒生电子	100	4,429.00	0.00
264	603179	新泉股份	100	4,389.00	0.00
265	000963	华东医药	100	4,337.00	0.00
266	002557	洽洽食品	100	4,155.00	0.00
267	002709	天赐材料	100	4,119.00	0.00
268	002368	太极股份	100	4,117.00	0.00
269	002648	卫星化学	274	4,099.04	0.00
270	300373	扬杰科技	100	4,057.00	0.00
271	300251	光线传媒	500	4,045.00	0.00
272	300418	昆仑万维	100	4,028.00	0.00
273	300999	金龙鱼	100	3,999.00	0.00
274	002236	大华股份	200	3,950.00	0.00
275	600511	国药股份	100	3,885.00	0.00
276	603883	老百姓	130	3,880.50	0.00
277	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.00
278	000988	华工科技	100	3,801.00	0.00
279	600323	瀚蓝环境	200	3,786.00	0.00
280	603517	绝味食品	100	3,715.00	0.00
281	601127	赛力斯	100	3,677.00	0.00
282	002472	双环传动	100	3,630.00	0.00
283	002223	鱼跃医疗	100	3,599.00	0.00

284	002603	以岭药业	140	3,596.60	0.00
285	002335	科华数据	100	3,595.00	0.00
286	600660	福耀玻璃	100	3,585.00	0.00
287	002153	石基信息	255	3,570.00	0.00
288	002151	北斗星通	100	3,516.00	0.00
289	002595	豪迈科技	100	3,513.00	0.00
290	603678	火炬电子	100	3,446.00	0.00
291	002430	杭氧股份	100	3,436.00	0.00
292	000860	顺鑫农业	100	3,369.00	0.00
293	300357	我武生物	100	3,363.00	0.00
294	002690	美亚光电	130	3,347.50	0.00
295	300212	易华录	100	3,323.00	0.00
296	002925	盈趣科技	170	3,298.00	0.00
297	600161	天坛生物	120	3,258.00	0.00
298	300253	卫宁健康	300	3,246.00	0.00
299	300618	寒锐钴业	100	3,241.00	0.00
300	600332	白云山	100	3,188.00	0.00
301	000938	紫光股份	100	3,185.00	0.00
302	600885	宏发股份	100	3,185.00	0.00
303	002294	信立泰	100	3,119.00	0.00
304	600998	九州通	298	3,093.24	0.00
305	600196	复星医药	100	3,090.00	0.00
306	002262	恩华药业	100	3,083.00	0.00
307	603027	千禾味业	144	3,041.28	0.00
308	600460	士兰微	100	3,027.00	0.00
309	002050	三花智控	100	3,026.00	0.00
310	603712	七一二	100	3,021.00	0.00
311	600685	中船防务	100	2,995.00	0.00
312	600188	兖矿能源	100	2,992.00	0.00
313	002439	启明星辰	100	2,976.00	0.00
314	002422	科伦药业	100	2,968.00	0.00
315	000831	中国稀土	100	2,960.00	0.00
316	300363	博腾股份	100	2,959.00	0.00
317	300408	三环集团	100	2,935.00	0.00
318	603000	人民网	100	2,920.00	0.00
319	600566	济川药业	100	2,904.00	0.00
320	600887	伊利股份	100	2,832.00	0.00
321	002268	电科网安	100	2,787.00	0.00
322	600406	国电南瑞	120	2,772.00	0.00
323	002074	国轩高科	100	2,762.00	0.00
324	300285	国瓷材料	100	2,740.00	0.00
325	600999	招商证券	200	2,714.00	0.00
326	300298	三诺生物	100	2,704.00	0.00
327	600079	人福医药	100	2,694.00	0.00

328	000768	中航西飞	100	2,675.00	0.00
329	300142	沃森生物	100	2,645.00	0.00
330	002008	大族激光	100	2,620.00	0.00
331	601601	中国太保	100	2,598.00	0.00
332	002384	东山精密	100	2,590.00	0.00
333	600862	中航高科	100	2,531.00	0.00
334	002508	老板电器	100	2,529.00	0.00
335	601138	工业富联	100	2,520.00	0.00
336	600372	中航电子	166	2,519.88	0.00
337	002353	杰瑞股份	100	2,513.00	0.00
338	600060	海信视像	100	2,475.00	0.00
339	000738	航发控制	100	2,440.00	0.00
340	002831	裕同科技	100	2,439.00	0.00
341	601066	中信建投	100	2,420.00	0.00
342	300146	汤臣倍健	100	2,398.00	0.00
343	600111	北方稀土	100	2,398.00	0.00
344	002507	涪陵榨菜	130	2,380.30	0.00
345	603866	桃李面包	235	2,378.20	0.00
346	600585	海螺水泥	100	2,374.00	0.00
347	000951	中国重汽	140	2,359.00	0.00
348	300433	蓝思科技	200	2,352.00	0.00
349	600316	洪都航空	100	2,345.00	0.00
350	600482	中国动力	100	2,344.00	0.00
351	300003	乐普医疗	100	2,261.00	0.00
352	002156	通富微电	100	2,260.00	0.00
353	601607	上海医药	100	2,241.00	0.00
354	600141	兴发集团	100	2,222.00	0.00
355	601966	玲珑轮胎	100	2,222.00	0.00
356	002389	航天彩虹	100	2,221.00	0.00
357	600900	长江电力	100	2,206.00	0.00
358	601231	环旭电子	139	2,079.44	0.00
359	603858	步长制药	100	2,059.00	0.00
360	002372	伟星新材	100	2,054.00	0.00
361	600498	烽火通信	100	2,037.00	0.00
362	600131	国网信通	100	2,019.00	0.00
363	000021	深科技	100	1,999.00	0.00
364	002414	高德红外	255	1,981.35	0.00
365	600859	王府井	100	1,979.00	0.00
366	002299	圣农发展	100	1,915.00	0.00
367	600416	湘电股份	100	1,909.00	0.00
368	600549	厦门钨业	100	1,903.00	0.00
369	603218	日月股份	100	1,899.00	0.00
370	600362	江西铜业	100	1,898.00	0.00
371	600803	新奥股份	100	1,898.00	0.00

372	600258	首旅酒店	100	1,895.00	0.00
373	000997	新大陆	100	1,890.00	0.00
374	600875	东方电气	100	1,865.00	0.00
375	600741	华域汽车	100	1,846.00	0.00
376	600521	华海药业	100	1,841.00	0.00
377	601225	陕西煤业	100	1,819.00	0.00
378	000519	中兵红箭	100	1,809.00	0.00
379	002558	巨人网络	100	1,793.00	0.00
380	002497	雅化集团	100	1,778.00	0.00
381	002241	歌尔股份	100	1,775.00	0.00
382	300773	拉卡拉	100	1,744.00	0.00
383	002572	索菲亚	100	1,742.00	0.00
384	002216	三全食品	110	1,713.80	0.00
385	601058	赛轮轮胎	150	1,708.50	0.00
386	601615	明阳智能	100	1,688.00	0.00
387	300024	机器人	100	1,667.00	0.00
388	600031	三一重工	100	1,663.00	0.00
389	002601	龙佰集团	100	1,650.00	0.00
390	300207	欣旺达	100	1,632.00	0.00
391	601699	潞安环能	100	1,632.00	0.00
392	000623	吉林敖东	100	1,604.00	0.00
393	002030	达安基因	160	1,595.20	0.00
394	000581	威孚高科	100	1,575.00	0.00
395	600637	东方明珠	200	1,564.00	0.00
396	000960	锡业股份	100	1,555.00	0.00
397	002436	兴森科技	100	1,550.00	0.00
398	000998	隆平高科	100	1,535.00	0.00
399	002326	永太科技	100	1,529.00	0.00
400	002625	光启技术	100	1,526.00	0.00
401	600884	杉杉股份	100	1,514.00	0.00
402	600674	川投能源	100	1,505.00	0.00
403	600066	宇通客车	100	1,474.00	0.00
404	600487	亨通光电	100	1,466.00	0.00
405	002019	亿帆医药	100	1,460.00	0.00
406	600233	圆通速递	100	1,456.00	0.00
407	600535	天士力	100	1,451.00	0.00
408	600004	白云机场	100	1,434.00	0.00
409	600848	上海临港	120	1,434.00	0.00
410	600104	上汽集团	100	1,417.00	0.00
411	600176	中国巨石	100	1,416.00	0.00
412	600977	中国电影	100	1,405.00	0.00
413	600895	张江高科	100	1,392.00	0.00
414	000066	中国长城	100	1,383.00	0.00
415	600160	巨化股份	100	1,378.00	0.00

416	002373	千方科技	100	1,364.00	0.00
417	600827	百联股份	100	1,337.00	0.00
418	600598	北大荒	100	1,333.00	0.00
419	601233	桐昆股份	100	1,325.00	0.00
420	600739	辽宁成大	100	1,315.00	0.00
421	000625	长安汽车	100	1,293.00	0.00
422	600392	盛和资源	100	1,287.00	0.00
423	000807	云铝股份	100	1,273.00	0.00
424	600886	国投电力	100	1,265.00	0.00
425	600026	中远海能	100	1,264.00	0.00
426	600418	江淮汽车	100	1,259.00	0.00
427	000729	燕京啤酒	100	1,247.00	0.00
428	000338	潍柴动力	100	1,246.00	0.00
429	601717	郑煤机	100	1,245.00	0.00
430	600958	东方证券	128	1,241.60	0.00
431	300144	宋城演艺	100	1,240.00	0.00
432	600801	华新水泥	100	1,235.00	0.00
433	601838	成都银行	100	1,221.00	0.00
434	002203	海亮股份	100	1,201.00	0.00
435	300009	安科生物	120	1,200.00	0.00
436	600926	杭州银行	100	1,175.00	0.00
437	002152	广电运通	100	1,172.00	0.00
438	601881	中国银河	100	1,161.00	0.00
439	002405	四维图新	100	1,158.00	0.00
440	000987	越秀资本	182	1,155.70	0.00
441	600019	宝钢股份	200	1,124.00	0.00
442	002511	中顺洁柔	100	1,115.00	0.00
443	601958	金铝股份	100	1,115.00	0.00
444	000878	云南铜业	100	1,105.00	0.00
445	600153	建发股份	100	1,091.00	0.00
446	600061	国投资本	152	1,082.24	0.00
447	300383	光环新网	100	1,075.00	0.00
448	300070	碧水源	200	1,072.00	0.00
449	002078	太阳纸业	100	1,069.00	0.00
450	002202	金风科技	100	1,062.00	0.00
451	000830	鲁西化工	100	1,056.00	0.00
452	601168	西部矿业	100	1,051.00	0.00
453	002250	联化科技	100	1,046.00	0.00
454	600597	光明乳业	100	1,040.00	0.00
455	000039	中集集团	150	1,033.50	0.00
456	600489	中金黄金	100	1,033.00	0.00
457	600399	抚顺特钢	100	1,020.00	0.00
458	000547	航天发展	100	1,000.00	0.00
459	600528	中铁工业	100	988.00	0.00

460	601878	浙商证券	100	988.00	0.00
461	601186	中国铁建	100	985.00	0.00
462	002212	天融信	100	970.00	0.00
463	601989	中国重工	200	964.00	0.00
464	002120	韵达股份	100	956.00	0.00
465	601899	紫金矿业	83	943.71	0.00
466	601919	中远海控	100	940.00	0.00
467	600837	海通证券	100	922.00	0.00
468	002185	华天科技	100	920.00	0.00
469	000050	深天马 A	100	918.00	0.00
470	601727	上海电气	200	914.00	0.00
471	601456	国联证券	100	910.00	0.00
472	601555	东吴证券	130	902.20	0.00
473	600873	梅花生物	100	893.00	0.00
474	002244	滨江集团	100	882.00	0.00
475	000069	华侨城 A	200	880.00	0.00
476	002736	国信证券	100	873.00	0.00
477	600143	金发科技	100	873.00	0.00
478	600057	厦门象屿	100	870.00	0.00
479	002221	东华能源	100	865.00	0.00
480	600415	小商品城	100	853.00	0.00
481	002926	华西证券	100	831.00	0.00
482	601117	中国化学	100	828.00	0.00
483	601990	南京证券	100	818.00	0.00
484	002939	长城证券	100	813.00	0.00
485	600100	同方股份	100	812.00	0.00
486	000930	中粮科技	100	810.00	0.00
487	600737	中粮糖业	100	805.00	0.00
488	601198	东兴证券	100	802.00	0.00
489	601009	南京银行	100	800.00	0.00
490	002602	世纪华通	100	759.00	0.00
491	000723	美锦能源	100	754.00	0.00
492	601006	大秦铁路	100	743.00	0.00
493	600667	太极实业	100	726.00	0.00
494	600673	东阳光	100	721.00	0.00
495	002966	苏州银行	110	720.50	0.00
496	601519	大智慧	100	716.00	0.00
497	300017	网宿科技	100	711.00	0.00
498	002065	东华软件	100	706.00	0.00
499	600642	申能股份	100	699.00	0.00
500	000089	深圳机场	100	695.00	0.00
501	000686	东北证券	100	694.00	0.00
502	002340	格林美	100	691.00	0.00
503	600918	中泰证券	100	691.00	0.00

504	600655	豫园股份	100	686.00	0.00
505	300376	易事特	100	670.00	0.00
506	600027	华电国际	100	669.00	0.00
507	002385	大北农	100	660.00	0.00
508	000027	深圳能源	100	659.00	0.00
509	601901	方正证券	100	654.00	0.00
510	000728	国元证券	100	652.00	0.00
511	601766	中国中车	100	650.00	0.00
512	002092	中泰化学	100	645.00	0.00
513	600028	中国石化	100	636.00	0.00
514	600606	绿地控股	231	635.25	0.00
515	002673	西部证券	100	635.00	0.00
516	600177	雅戈尔	100	631.00	0.00
517	600155	华创云信	100	622.00	0.00
518	600516	方大炭素	100	620.00	0.00
519	600909	华安证券	130	607.10	0.00
520	600029	南方航空	100	603.00	0.00
521	600820	隧道股份	100	601.00	0.00
522	600583	海油工程	100	585.00	0.00
523	000783	长江证券	100	580.00	0.00
524	601328	交通银行	100	580.00	0.00
525	601669	中国电建	100	574.00	0.00
526	002797	第一创业	100	572.00	0.00
527	002456	欧菲光	100	560.00	0.00
528	002500	山西证券	100	558.00	0.00
529	600500	中化国际	100	556.00	0.00
530	601600	中国铝业	100	549.00	0.00
531	000559	万向钱潮	100	545.00	0.00
532	601825	沪农商行	100	545.00	0.00
533	000598	兴蓉环境	100	543.00	0.00
534	300026	红日药业	100	542.00	0.00
535	600015	华夏银行	100	541.00	0.00
536	601179	中国西电	100	541.00	0.00
537	600390	五矿资本	100	538.00	0.00
538	600733	北汽蓝谷	100	538.00	0.00
539	002010	传化智联	100	532.00	0.00
540	600018	上港集团	100	525.00	0.00
541	601997	贵阳银行	100	516.00	0.00
542	600023	浙能电力	100	507.00	0.00
543	600497	驰宏锌锗	100	502.00	0.00
544	600704	物产中大	100	494.00	0.00
545	601658	邮储银行	100	489.00	0.00
546	000488	晨鸣纸业	100	485.00	0.00
547	000932	华菱钢铁	100	477.00	0.00

548	600115	中国东航	100	476.00	0.00
549	000060	中金岭南	100	475.00	0.00
550	600507	方大特钢	100	463.00	0.00
551	000166	申万宏源	100	462.00	0.00
552	000883	湖北能源	100	456.00	0.00
553	000402	金融街	100	452.00	0.00
554	002081	金螳螂	100	451.00	0.00
555	601118	海南橡胶	100	448.00	0.00
556	601608	中信重工	100	421.00	0.00
557	600863	内蒙华电	100	415.00	0.00
558	002266	浙富控股	100	413.00	0.00
559	601216	君正集团	100	410.00	0.00
560	000778	新兴铸管	100	408.00	0.00
561	000629	钒钛股份	100	391.00	0.00
562	601988	中国银行	100	391.00	0.00
563	000825	太钢不锈	100	387.00	0.00
564	600705	中航产融	100	383.00	0.00
565	600320	振华重工	100	373.00	0.00
566	600782	新钢股份	100	371.00	0.00
567	601375	中原证券	100	371.00	0.00
568	600369	西南证券	100	365.00	0.00
569	601077	渝农商行	100	359.00	0.00
570	601000	唐山港	100	353.00	0.00
571	601916	浙商银行	130	343.20	0.00
572	600282	南钢股份	100	337.00	0.00
573	601106	中国一重	100	336.00	0.00
574	000750	国海证券	100	335.00	0.00
575	600688	上海石化	100	311.00	0.00
576	601818	光大银行	100	307.00	0.00
577	600219	南山铝业	100	302.00	0.00
578	000627	天茂集团	100	300.00	0.00
579	601162	天风证券	100	298.00	0.00
580	002506	协鑫集成	100	293.00	0.00
581	000630	铜陵有色	100	289.00	0.00
582	600008	首创环保	100	288.00	0.00
583	002958	青农商行	100	272.00	0.00
584	600170	上海建工	100	269.00	0.00
585	601099	太平洋	100	258.00	0.00
586	600808	马钢股份	100	257.00	0.00
587	600208	新湖中宝	100	248.00	0.00
588	601866	中远海发	100	247.00	0.00
589	603077	和邦生物	100	243.00	0.00
590	601868	中国能建	100	234.00	0.00
591	002131	利欧股份	100	230.00	0.00

592	002936	郑州银行	100	230.00	0.00
593	000709	河钢股份	100	226.00	0.00
594	601992	金隅集团	100	218.00	0.00
595	600297	广汇汽车	100	208.00	0.00
596	600010	包钢股份	100	179.00	0.00
597	600022	山东钢铁	100	142.00	0.00
598	601005	重庆钢铁	100	140.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603889	新澳股份	891,300.00	6,693,663.00	0.60
2	300236	上海新阳	164,200.00	6,510,530.00	0.58
3	688177	百奥泰	229,611.00	6,132,909.81	0.55
4	603587	地素时尚	413,200.00	6,049,248.00	0.54
5	002387	维信诺	633,100.00	5,805,527.00	0.52
6	300185	通裕重工	1,998,700.00	5,576,373.00	0.50
7	603666	亿嘉和	120,800.00	5,454,120.00	0.49
8	603508	思维列控	301,800.00	5,145,690.00	0.46
9	688018	乐鑫科技	37,705.00	4,894,863.10	0.44
10	688167	炬光科技	43,336.00	4,660,786.80	0.42
11	603328	依顿电子	550,400.00	4,557,312.00	0.41
12	000528	柳工	576,100.00	4,551,190.00	0.41
13	688277	天智航	246,217.00	4,540,241.48	0.41
14	603277	银都股份	206,100.00	4,501,224.00	0.40
15	603877	太平鸟	177,800.00	4,494,784.00	0.40
16	603076	乐惠国际	92,600.00	4,427,206.00	0.40
17	000690	宝新能源	619,300.00	4,347,486.00	0.39
18	600449	宁夏建材	272,100.00	4,233,876.00	0.38
19	688088	虹软科技	96,366.00	4,119,646.50	0.37
20	002293	罗莱生活	349,900.00	4,023,850.00	0.36
21	601208	东材科技	297,200.00	3,774,440.00	0.34
22	603859	能科科技	73,300.00	3,747,829.00	0.34
23	300729	乐歌股份	198,400.00	3,539,456.00	0.32
24	601163	三角轮胎	220,900.00	3,505,683.00	0.31
25	300866	安克创新	40,000.00	3,500,000.00	0.31
26	603920	世运电路	175,900.00	3,435,327.00	0.31
27	002035	华帝股份	468,700.00	3,327,770.00	0.30
28	600391	航发科技	137,000.00	3,303,070.00	0.30
29	688076	诺泰生物	90,483.00	3,219,385.14	0.29

30	600339	中油工程	777,700.00	3,165,239.00	0.28
31	300740	水羊股份	199,300.00	3,089,150.00	0.28
32	603279	景津装备	95,400.00	2,991,744.00	0.27
33	603081	大丰实业	134,100.00	2,464,758.00	0.22
34	002668	奥马电器	277,100.00	2,394,144.00	0.21
35	600375	汉马科技	310,872.00	2,356,409.76	0.21
36	600502	安徽建工	441,100.00	2,329,008.00	0.21
37	603855	华荣股份	87,400.00	2,324,840.00	0.21
38	002867	周大生	129,400.00	2,300,732.00	0.21
39	688153	唯捷创芯	31,301.00	2,289,981.16	0.21
40	603228	景旺电子	87,800.00	2,252,070.00	0.20
41	603808	歌力思	170,100.00	2,233,413.00	0.20
42	300480	光力科技	96,000.00	2,194,560.00	0.20
43	002609	捷顺科技	188,200.00	2,194,412.00	0.20
44	688100	威胜信息	70,117.00	2,090,187.77	0.19
45	603103	横店影视	124,000.00	2,088,160.00	0.19
46	688588	凌志软件	129,728.00	2,017,270.40	0.18
47	600312	平高电气	115,500.00	1,431,045.00	0.13
48	603416	信捷电气	34,000.00	1,404,540.00	0.13
49	600835	上海机电	77,500.00	1,331,450.00	0.12
50	603533	掌阅科技	35,000.00	970,200.00	0.09
51	688343	云天励飞	15,393.00	779,963.31	0.07
52	603611	诺力股份	21,100.00	555,774.00	0.05
53	688443	智翔金泰	17,157.00	527,886.15	0.05
54	688623	双元科技	1,776.00	162,256.88	0.01
55	688334	西高院	8,879.00	157,912.84	0.01
56	301210	金杨股份	2,801.00	143,168.37	0.01
57	301395	仁信新材	5,196.00	138,629.28	0.01
58	688620	安凯微	10,157.00	135,209.66	0.01
59	301141	中科磁业	2,617.00	119,750.28	0.01
60	601065	江盐集团	8,748.00	116,094.39	0.01
61	688631	莱斯信息	3,357.00	108,400.08	0.01
62	301488	豪恩汽电	2,618.00	104,144.04	0.01
63	301355	南王科技	5,624.00	99,516.05	0.01
64	301232	飞沃科技	1,643.00	99,339.12	0.01
65	301376	致欧科技	4,192.00	98,850.60	0.01
66	301386	未来电器	3,776.00	94,554.26	0.01
67	301176	逸豪新材	5,431.00	93,304.58	0.01
68	688420	美腾科技	2,408.00	93,261.84	0.01
69	301170	锡南科技	2,496.00	92,283.70	0.01
70	301373	凌玮科技	2,764.00	89,376.38	0.01
71	301281	科源制药	3,368.00	88,415.20	0.01
72	301203	国泰环保	2,243.00	79,964.22	0.01
73	301202	朗威股份	3,060.00	79,009.20	0.01

74	688603	天承科技	1,391.00	76,505.00	0.01
75	301261	恒工精密	1,973.00	72,803.70	0.01
76	601136	首创证券	4,739.00	67,151.63	0.01
77	688472	阿特斯	3,910.00	66,626.40	0.01
78	301358	湖南裕能	1,447.00	62,061.83	0.01
79	688469	中芯集成	10,605.00	57,373.05	0.01
80	001269	欧晶科技	765.00	56,250.45	0.01
81	600925	苏能股份	8,960.00	55,283.20	0.00
82	688361	中科飞测	831.00	53,740.77	0.00
83	001328	登康口腔	1,445.00	46,323.05	0.00
84	603125	常青科技	1,596.00	44,779.00	0.00
85	301325	曼恩斯特	364.00	39,293.80	0.00
86	300327	中颖电子	1,400.00	39,144.00	0.00
87	603281	江瀚新材	1,208.00	37,303.04	0.00
88	001311	多利科技	649.00	37,272.07	0.00
89	001282	三联锻造	1,045.00	37,026.15	0.00
90	301200	大族数控	857.00	34,177.16	0.00
91	605090	九丰能源	1,526.00	34,075.58	0.00
92	001330	博纳影业	3,564.00	33,073.92	0.00
93	301330	熵基科技	902.00	32,273.56	0.00
94	001338	永顺泰	1,649.00	30,407.56	0.00
95	001360	南矿集团	1,762.00	30,163.44	0.00
96	001287	中电港	1,386.00	29,133.72	0.00
97	688576	西山科技	240.00	28,898.40	0.00
98	601089	福元医药	1,749.00	28,508.70	0.00
99	688507	索辰科技	222.00	27,108.42	0.00
100	001322	箭牌家居	1,595.00	26,700.30	0.00
101	688582	芯动联科	648.00	26,360.64	0.00
102	601061	中信金属	3,440.00	26,075.20	0.00
103	301263	泰恩康	1,228.00	25,640.64	0.00
104	301327	华宝新能	315.00	24,919.65	0.00
105	001367	海森药业	549.00	24,687.92	0.00
106	001337	四川黄金	795.00	24,557.55	0.00
107	301356	天振股份	1,105.00	24,199.50	0.00
108	001308	康冠科技	867.00	23,807.82	0.00
109	301293	三博脑科	333.00	23,782.86	0.00
110	001324	长青科技	1,131.00	23,764.29	0.00
111	301303	真兰仪表	1,058.00	23,614.56	0.00
112	301368	丰立智能	337.00	23,317.03	0.00
113	301195	北路智控	495.00	23,047.20	0.00
114	301339	通行宝	913.00	22,943.69	0.00
115	688552	航天南湖	956.00	22,466.00	0.00
116	688570	天玛智控	884.00	22,391.72	0.00
117	301307	美利信	687.00	21,887.82	0.00

118	301171	易点天下	985.00	21,768.50	0.00
119	001314	亿道信息	508.00	21,478.24	0.00
120	001236	弘业期货	1,399.00	21,446.67	0.00
121	301219	腾远钴业	553.00	20,660.08	0.00
122	601022	宁波远洋	1,983.00	20,603.37	0.00
123	301363	美好医疗	445.00	19,575.55	0.00
124	001323	慕思股份	573.00	19,459.08	0.00
125	601121	宝地矿业	2,532.00	19,344.48	0.00
126	301152	天力锂能	433.00	19,337.78	0.00
127	603235	天新药业	572.00	17,937.92	0.00
128	301377	鼎泰高科	770.00	17,710.00	0.00
129	603209	兴通股份	833.00	17,667.93	0.00
130	301296	新巨丰	1,042.00	17,588.96	0.00
131	301328	维峰电子	287.00	16,341.78	0.00
132	301439	泓淋电力	949.00	16,038.10	0.00
133	603282	亚光股份	457.00	15,771.07	0.00
134	301115	建科股份	685.00	15,659.10	0.00
135	301399	英特科技	293.00	15,110.01	0.00
136	301280	珠城科技	419.00	14,983.44	0.00
137	301305	朗坤环境	753.00	14,826.57	0.00
138	301121	紫建电子	290.00	14,685.60	0.00
139	301361	众智科技	517.00	14,574.23	0.00
140	603070	万控智造	775.00	14,484.75	0.00
141	603190	亚通精工	470.00	14,382.00	0.00
142	301338	凯格精机	360.00	14,004.00	0.00
143	688512	慧智微	721.00	13,814.36	0.00
144	603237	五芳斋	455.00	13,800.15	0.00
145	603057	紫燕食品	549.00	13,796.37	0.00
146	301132	满坤科技	468.00	13,754.52	0.00
147	301382	蜂助手	408.00	13,398.72	0.00
148	603162	海通发展	774.00	13,196.70	0.00
149	603153	上海建科	740.00	13,135.00	0.00
150	301277	新天地	659.00	12,857.09	0.00
151	603051	鹿山新材	272.00	12,737.76	0.00
152	301345	涛涛车业	266.00	12,406.24	0.00
153	301270	汉仪股份	210.00	11,468.10	0.00
154	001278	一彬科技	473.00	11,247.94	0.00
155	603073	彩蝶实业	530.00	11,055.80	0.00
156	001333	光华股份	426.00	10,705.38	0.00
157	301290	东星医疗	330.00	10,576.50	0.00
158	301313	凡拓数创	247.00	10,455.51	0.00
159	001260	坤泰股份	484.00	10,401.16	0.00
160	301318	维海德	309.00	10,366.95	0.00
161	001366	播恩集团	645.00	9,945.90	0.00

162	001331	胜通能源	539.00	9,847.53	0.00
163	688479	友车科技	332.00	9,790.68	0.00
164	301398	星源卓镁	255.00	9,562.50	0.00
165	301265	华新环保	819.00	9,516.78	0.00
166	001299	美能能源	576.00	9,394.56	0.00
167	001222	源飞宠物	608.00	9,199.04	0.00
168	301323	新莱福	228.00	8,974.08	0.00
169	603280	南方路机	363.00	8,922.54	0.00
170	001368	通达创智	351.00	8,922.42	0.00
171	688429	时创能源	346.00	8,833.38	0.00
172	001238	浙江正特	374.00	8,800.22	0.00
173	603151	邦基科技	535.00	8,741.90	0.00
174	001256	炜冈科技	474.00	8,721.60	0.00
175	603065	宿迁联盛	581.00	8,656.90	0.00
176	001231	农心科技	355.00	8,445.45	0.00
177	603182	嘉华股份	546.00	8,255.52	0.00
178	688535	华海诚科	161.00	8,248.03	0.00
179	301316	慧博云通	359.00	8,203.15	0.00
180	301285	鸿日达	565.00	8,186.85	0.00
181	603291	联合水务	536.00	8,152.56	0.00
182	601133	柏诚股份	664.00	8,140.64	0.00
183	301388	欣灵电气	292.00	7,840.20	0.00
184	002840	华统股份	500.00	7,820.00	0.00
185	301337	亚华电子	232.00	7,045.84	0.00
186	301428	世纪恒通	229.00	7,007.40	0.00
187	301319	唯特偶	115.00	6,882.75	0.00
188	002281	光迅科技	100.00	3,709.00	0.00
189	603317	天味食品	220.00	3,214.20	0.00
190	603638	艾迪精密	140.00	2,872.80	0.00
191	601098	中南传媒	200.00	2,320.00	0.00
192	688176	亚虹医药	195.00	2,279.55	0.00
193	300188	美亚柏科	100.00	2,079.00	0.00
194	002773	康弘药业	100.00	1,912.00	0.00
195	002626	金达威	100.00	1,879.00	0.00
196	002146	荣盛发展	1,200.00	1,848.00	0.00
197	600562	国睿科技	100.00	1,620.00	0.00
198	300463	迈克生物	100.00	1,512.00	0.00
199	001914	招商积余	100.00	1,505.00	0.00
200	002242	九阳股份	100.00	1,495.00	0.00
201	600776	东方通信	100.00	1,425.00	0.00
202	600373	中文传媒	100.00	1,332.00	0.00
203	000555	神州信息	100.00	1,230.00	0.00
204	002399	海普瑞	100.00	1,147.00	0.00
205	600267	海正药业	100.00	1,138.00	0.00

206	300271	华宇软件	100.00	1,108.00	0.00
207	000672	上峰水泥	120.00	1,095.60	0.00
208	600305	恒顺醋业	100.00	1,086.00	0.00
209	300058	蓝色光标	100.00	967.00	0.00
210	600201	生物股份	100.00	951.00	0.00
211	002099	海翔药业	100.00	859.00	0.00
212	002233	塔牌集团	100.00	772.00	0.00
213	002382	蓝帆医疗	100.00	718.00	0.00
214	600167	联美控股	100.00	697.00	0.00
215	600398	海澜之家	100.00	688.00	0.00
216	002124	天邦食品	140.00	635.60	0.00
217	002563	森马服饰	100.00	622.00	0.00
218	002191	劲嘉股份	100.00	602.00	0.00
219	601598	中国外运	100.00	466.00	0.00
220	002110	三钢闽光	100.00	422.00	0.00
221	002075	沙钢股份	100.00	401.00	0.00
222	600376	首开股份	100.00	390.00	0.00
223	600567	山鹰国际	100.00	229.00	0.00
224	600340	华夏幸福	100.00	221.00	0.00
225	000415	渤海租赁	100.00	210.00	0.00
227	000671	阳光城	100.00	1.00	0.00
226	000540	中天金融	100.00	1.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603486	科沃斯	25,510,989.00	2.17
2	600276	恒瑞医药	25,385,798.48	2.16
3	601318	中国平安	23,974,777.00	2.04
4	600011	华能国际	20,360,645.00	1.73
5	000301	东方盛虹	18,456,085.93	1.57
6	601169	北京银行	17,572,191.00	1.50
7	600763	通策医疗	17,457,201.44	1.49
8	002984	森麒麟	17,432,313.44	1.48
9	300450	先导智能	17,246,785.73	1.47
10	002352	顺丰控股	16,172,401.85	1.38
11	000100	TCL 科技	16,027,169.00	1.36
12	002044	美年健康	15,439,153.88	1.31
13	601111	中国国航	15,416,185.00	1.31

14	000425	徐工机械	14,801,289.00	1.26
15	601577	长沙银行	14,753,919.00	1.26
16	300957	贝泰妮	14,504,941.00	1.23
17	603338	浙江鼎力	14,346,591.28	1.22
18	600375	汉马科技	14,199,941.00	1.21
19	000063	中兴通讯	13,924,640.72	1.18
20	600183	生益科技	13,826,576.49	1.18

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	43,821,803.30	3.73
2	601111	中国国航	37,818,584.64	3.22
3	600011	华能国际	31,214,152.00	2.66
4	300760	迈瑞医疗	29,196,460.00	2.48
5	601888	中国中免	25,450,359.00	2.17
6	002463	沪电股份	25,363,598.11	2.16
7	300454	深信服	25,157,234.80	2.14
8	603486	科沃斯	22,500,454.40	1.91
9	688111	金山办公	21,526,935.86	1.83
10	600547	山东黄金	21,334,288.34	1.82
11	300308	中际旭创	20,896,267.19	1.78
12	002180	纳思达	19,092,281.34	1.62
13	002850	科达利	18,407,124.92	1.57
14	300896	爱美客	16,859,598.00	1.43
15	000301	东方盛虹	15,852,947.00	1.35
16	688072	拓荆科技	15,777,430.10	1.34
17	002405	四维图新	15,776,630.76	1.34
18	002532	天山铝业	15,546,839.33	1.32
19	002371	北方华创	15,529,214.00	1.32
20	688176	亚虹医药	15,307,719.89	1.30

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,754,718,961.75
卖出股票的收入（成交）总额	1,765,376,779.89

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,195.64	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,195.64	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113668	鹿山转债	10	1,195.64	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

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 11 月 28 日，北京银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理结汇、售汇业务；违反外汇登记管理规定，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2022〕20 号）没收违法所得 349,067.43 元人民币，罚款 156.5 万元人民币。2023 年 6 月 16 日，北京银行因小微企业划型不准确、收费政策执行及整改不到位等违法违规事项，被北京银保监局（京银保监罚决字〔2023〕16 号）责令改正、给予罚款合计 4830 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。2023 年 1 月 9 日，宁波银行因违规开展异地互联网贷

款业务、互联网贷款业务整改不到位、资信见证业务开展不审慎、资信见证业务整改不到位、贷款“三查”不尽职、新产品管理不严格等问题，被宁波银保监局（甬银保监罚决字（2023）1号）给予罚款人民币 220 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。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	178,128.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	262,599.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	440,728.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(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
86,431	16,422.17	11,681,703.77	0.82%	1,407,703,223.12	99.18%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	682,257.36	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 11 月 8 日）基金份额总额	1,762,466,123.89
本报告期期初基金份额总额	1,435,985,601.62
本报告期基金总申购份额	79,769,709.62
减：本报告期基金总赎回份额	96,370,384.35

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,419,384,926.89

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	1	1,953,468,649.79	55.66%	1,819,267.69	55.92%	-

浙商证券	1	1,440,689,310.84	41.05%	1,327,307.38	40.80%	-
招商证券	1	115,725,042.82	3.30%	106,618.13	3.28%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

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

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

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

（1）对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

（2）填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
国泰君安证券	1,433,077.60	99.92%	-	-	-	-
浙商证券	655.18	0.05%	-	-	-	-
招商证券	500.00	0.03%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2023-01-20
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（亿道信息）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-03
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（多利科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-17
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（宿迁联盛）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-15
5	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
6	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 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	2023-04-21
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（友车科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-05
8	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(中科飞测)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2023-05-13

		定媒介	
9	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（浙商配股）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-06-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》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、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日