

华安中证 500 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：招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。

基金托管人招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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	59
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.11 投资组合报告附注	59
8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60

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	60
9 开放式基金份额变动	60
10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
11 影响投资者决策的其他重要信息	63
12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中证 500 指数增强	
基金主代码	014587	
交易代码	014587	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 24 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	187,092,343.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014587	014588
报告期末下属分级基金的份额总额	77,755,169.90 份	109,337,173.70 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p>
投资策略	<p>本基金为股票指数增强型基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，综合分析比较不同金融资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。</p> <p>本基金主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。</p> <p>（1）指数化被动投资策略</p> <p>参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并通过分析投资组合相对标的指数的暴露度等因素，对组合跟踪效果进行评估，及时调整投资组合，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。</p> <p>（2）量化增强投资策略</p> <p>本基金将基于数量化投资分析及基本面研究等方法智能筛选优质上市公司、优化投资组合，根据模型结果结合市场环境进行组合投资，以争取实现指数增强型的目标。</p> <p>（3）模型的应用与调整</p> <p>在正常的市场情况下，本基金将主要依据量化增强模型的运行结果来进行组合的构建。同时，基金管理人也会定期对模型的有效性进行检验和更新，</p>

	以反映市场结构趋势的变化。在市场出现非正常波动或基金管理人预测市场可能出现重大非正常波动时，本基金将结合市场情况做出具有一定前瞻性的判断，及时调整各因子类别的具体组成及权重。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	0755-83077987
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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、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）	
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-2,603,190.40	-5,187,735.71
本期利润	-3,307,051.31	-4,660,009.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0327	-0.0316
本期加权平均净值利润率	-3.37%	-3.27%
本期基金份额净值增长率	-2.88%	-3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	-6,132,483.55	-9,069,478.76
期末可供分配基金份额利润	-0.0789	-0.0829
期末基金资产净值	71,622,686.35	100,267,694.94
期末基金份额净值	0.9211	0.9171
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-7.89%	-8.29%

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

华安中证 500 指数增强 A

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	-0.11%	0.82%	-0.77%	0.89%	0.66%	-0.07%
过去三个月	-6.16%	0.72%	-5.11%	0.78%	-1.05%	-0.06%
过去六个月	-2.88%	0.70%	2.18%	0.75%	-5.06%	-0.05%
过去一年	-11.03%	0.87%	-6.68%	0.91%	-4.35%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.89%	0.85%	0.54%	0.95%	-8.43%	-0.10%

华安中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	-0.13%	0.82%	-0.77%	0.89%	0.64%	-0.07%
过去三个月	-6.26%	0.72%	-5.11%	0.78%	-1.15%	-0.06%
过去六个月	-3.07%	0.70%	2.18%	0.75%	-5.25%	-0.05%
过去一年	-11.38%	0.87%	-6.68%	0.91%	-4.70%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.29%	0.85%	0.54%	0.95%	-8.83%	-0.10%

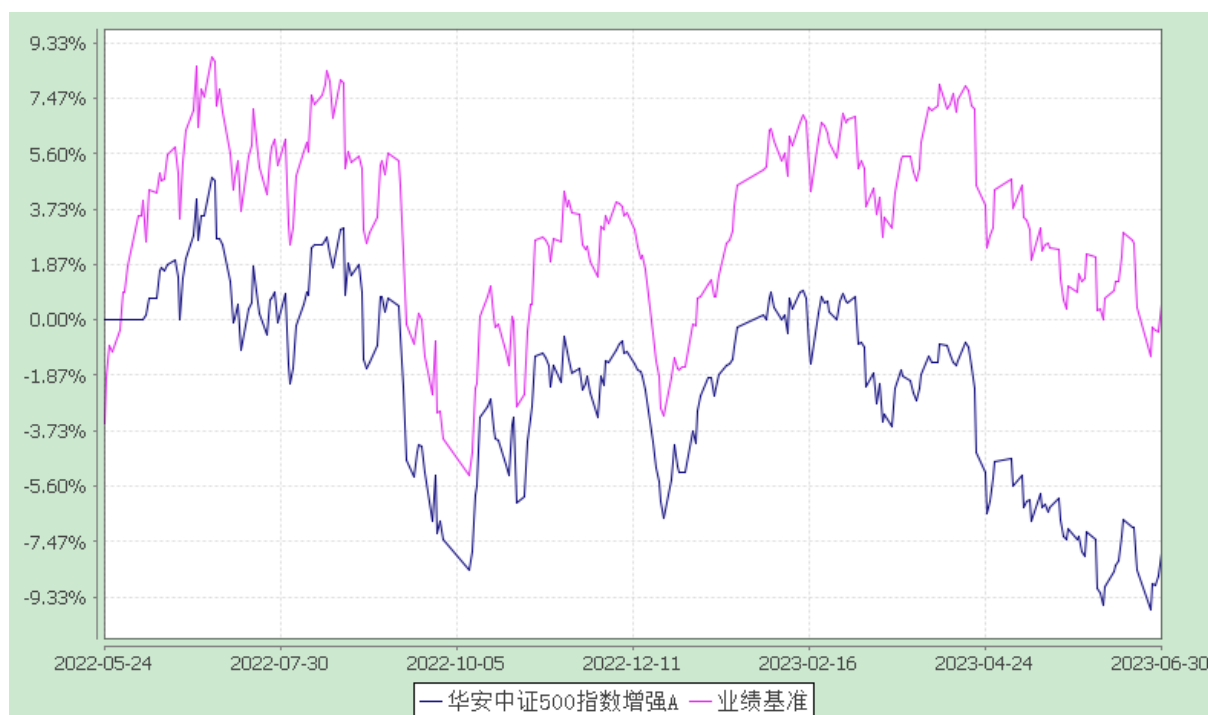
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中证 500 指数增强型证券投资基金

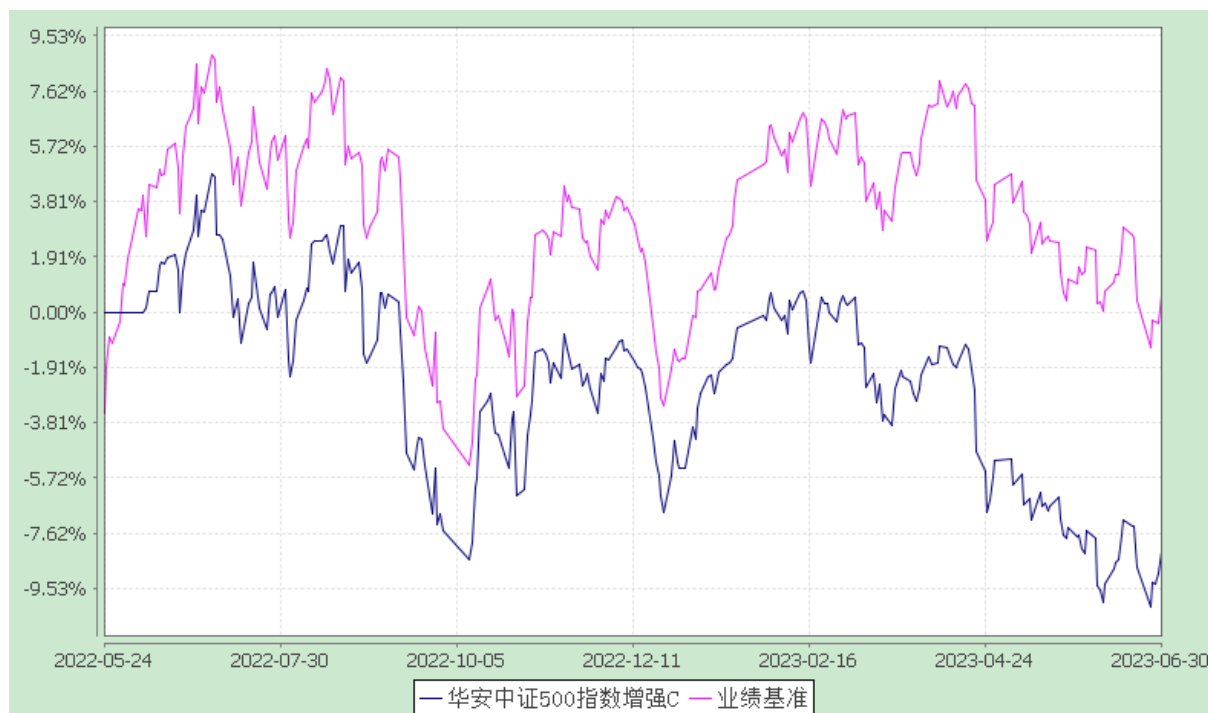
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 5 月 24 日至 2023 年 6 月 30 日)

华安中证 500 指数增强 A



华安中证 500 指数增强 C



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		
马韬	本基金的基金	2022-05-2	-	8 年	硕士研究生，8 年证券、基金行业

	经理	4			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。
朱宝臣	本基金的基金经理、量化投资部总监	2022-05-30	-	15 年	硕士研究生, 15 年证券、基金行业从业经验。曾任中信证券风险控制部高级经理、中金国际金融有限公司资产管理部量化团队负责人、中金基金管理有限公司量化投资部量化投资负责人。2021 年 8 月加入华安基金, 现任量化投资部总监、基金经理。2022 年 5 月起, 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 8 月起, 同时担任华安中证 1000 指数增强型证券投资基金、华安创新医药锐选量化股票型发起式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。

2023 年 7 月 8 日公司发布公告, 自 2023 年 7 月 7 日起朱宝臣先生不再担任此基金的基金经理。

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交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同

日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

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

本基金坚持以量化基本面为核心的投资框架，并不断深耕量化交易策略，通过量化基本面策略建立未来基本面向好、景气度提升且估值性价比高的基础配置组合，再通过量化交易型策略在配置组合之上提升一定的交易频率，获取市场短期非理性定价带来的交易性收益。

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 A 类份额净值为 0.9211 元，本报告期份额净值增长率为 -2.88%，同期业绩比较基准增长率为 2.18%，本基金 C 类份额净值为 0.9171 元，本报告期份额净值增长率为 -3.07%，同期业绩比较基准增长率为 2.18%。

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。

作为中证 500 指数增强基金的管理人，从量化基本面模型上看，景气度模型依旧是接下来一段时间操作的重点，但是会更加紧密的配合估值模型和交易模型；在交易类策略中，也会密切留意市场流动性的变动对交易模型的冲击，总体的来说，我们将在跟踪指数的前提下，继续坚持量化因子策略，勤勉尽责，力争为投资者获得长期稳定的超额回报。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核控制制度和风险控制制度，我行在履行托管职责

中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 500 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	8,618,042.53	5,514,065.40
结算备付金		4,793,112.65	850,854.96
存出保证金		355,452.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	158,397,454.10	102,658,649.46
其中：股票投资		158,226,807.70	102,658,649.46
基金投资		-	-
债券投资		170,646.40	-
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		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		62,794.04	183,044.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		172,226,855.32	109,206,614.08
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	6.4.7.3	-	-
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		92,422.47	408,567.41
应付管理人报酬		88,134.34	56,851.93
应付托管费		22,033.57	14,212.99
应付销售服务费		35,238.75	26,160.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	98,644.15	110,000.00
负债合计		336,474.03	615,793.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	187,092,343.60	114,696,615.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-15,201,962.31	-6,105,794.09
净资产合计		171,890,381.29	108,590,821.01
负债和净资产总计		172,226,855.32	109,206,614.08

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 187,092,343.60 份，其中 A 类基金份额净值 0.9211 元，基金份额总额 77,755,169.90 份；C 类基金份额净值 0.9171 元，基金份额总额 109,337,173.70 份。

6.2 利润表

会计主体：华安中证 500 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 5 月 24 日（基 金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-6,692,364.40	4,496,584.27

1.利息收入		38,303.14	87,678.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,303.14	18,347.86
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		-	69,331.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,557,743.54	2,809,583.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-8,806,381.33	2,125,944.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	25,048.28	-684.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	365,744.78	-
股利收益	6.4.7.15	1,857,844.73	684,323.52
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-176,135.06	606,677.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,211.06	992,644.13
减：二、营业总支出		1,274,696.77	221,682.19
1. 管理人报酬		718,782.88	125,226.96
2. 托管费		179,695.68	31,306.76
3. 销售服务费		283,524.76	42,491.05
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		1,789.86	-
8. 其他费用	6.4.7.18	90,903.59	22,657.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,967,061.17	4,274,902.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,967,061.17	4,274,902.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,967,061.17	4,274,902.08

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安中证 500 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）	114,696,615.10	-	-6,105,794.09	108,590,821.01
二、本期期初净资产（基金净值）	114,696,615.10	-	-6,105,794.09	108,590,821.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	72,395,728.50	-	-9,096,168.22	63,299,560.28
（一）、综合收益总额	-	-	-7,967,061.17	-7,967,061.17
（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）	72,395,728.50	-	-1,129,107.05	71,266,621.45
其中：1.基金申购款	221,133,378.29	-	-4,598,068.96	216,535,309.33
2.基金赎回款	-148,737,649.79	-	3,468,961.91	-145,268,687.88
（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）	187,092,343.60	-	-15,201,962.31	171,890,381.29

项目	上年度可比期间			
	2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	309,758,591.90	-	-	309,758,591.90

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-222,152,242.11	-	3,080,477.13	-219,071,764.98
（一）、综合收益总额	-	-	4,265,507.31	4,265,507.31
（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）	-222,152,242.11	-	-1,185,030.18	-223,337,272.29
其中：1.基金申购款	3,836,563.59	-	62,350.65	3,898,914.24
2.基金赎回款	-225,988,805.70	-	-1,247,380.83	-227,236,186.53
（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）	87,606,349.79	-	3,080,477.13	90,686,826.92

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

华安中证 500 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”)证监许可[2021]3892 号《关于准予华安中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 309,690,238.71 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0331 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 309,758,591.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 68,353.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销

售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购或申购基金时收取认购费或申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购费或申购费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。当法律法规或监管机构的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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》、《华安中证 500 指数增强型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	8,618,042.53
等于：本金	8,617,202.88
加：应计利息	839.65
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	8,618,042.53

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	161,991,590.35	-	158,226,807.70	-3,764,782.65	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	137,300.00	78.44	170,646.40	33,267.96
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	137,300.00	78.44	170,646.40	33,267.96
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	162,128,890.35	78.44	158,397,454.10	-3,731,514.69	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,375,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,375,200.00	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
其他	9,384.00
合计	98,644.15

6.4.7.7 实收基金

华安中证 500 指数增强 A

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	账面金额
上年度末	34,529,467.81	34,529,467.81
本期申购	102,487,526.25	102,487,526.25
本期赎回（以“-”号填列）	-59,261,824.16	-59,261,824.16
本期末	77,755,169.90	77,755,169.90

华安中证 500 指数增强 C

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	账面金额
上年度末	80,167,147.29	80,167,147.29

本期申购	118,645,852.04	118,645,852.04
本期赎回（以“-”号填列）	-89,475,825.63	-89,475,825.63
本期末	109,337,173.70	109,337,173.70

6.4.7.8 未分配利润

华安中证 500 指数增强 A

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	-129,264.75	-1,652,804.89	-1,782,069.64
本期利润	-2,603,190.40	-703,860.91	-3,307,051.31
本期基金份额交易产生的变动数	-1,687,665.09	644,302.49	-1,043,362.60
其中：基金申购款	-1,233,301.92	-720,128.49	-1,953,430.41
基金赎回款	-454,363.17	1,364,430.98	910,067.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,420,120.24	-1,712,363.31	-6,132,483.55

华安中证 500 指数增强 C

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	-491,876.57	-3,831,847.88	-4,323,724.45
本期利润	-5,187,735.71	527,725.85	-4,660,009.86
本期基金份额交易产生的变动数	-982,763.66	897,019.21	-85,744.45
其中：基金申购款	-1,706,419.28	-938,219.27	-2,644,638.55
基金赎回款	723,655.62	1,835,238.48	2,558,894.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,662,375.94	-2,407,102.82	-9,069,478.76

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	22,439.80
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	15,863.34

其他	-
合计	38,303.14

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	-8,806,381.33
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	-8,806,381.33

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	1,442,034,428.89
减：卖出股票成本总额	1,448,249,755.14
减：交易费用	2,591,055.08
买卖股票差价收入	-8,806,381.33

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	94.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	24,953.49
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	25,048.28

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	152,003.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	127,000.00
减：应计利息总额	19.21
减：交易费用	30.42
买卖债券差价收入	24,953.49

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	365,744.78
合计	365,744.78

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	1,857,844.73
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	1,857,844.73

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	-170,615.06
——股票投资	-203,883.02
——债券投资	33,267.96
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-5,520.00
——权证投资	-
——期货投资	-5,520.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的	-

预估增值税	
合计	-176,135.06

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	2,876.54
基金转换费收入	334.52
合计	3,211.06

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,643.44
合计	90,903.59

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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 关联方报酬

6.4.10.1.1 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5月24日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	718,782.88	-
其中：支付销售机构的客户维护费	198,640.19	43,072.87

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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.1.2 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5月24日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	179,695.68	-

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.1.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	2.50	2.50
华安基金管理有限公司	-	128,858.44	128,858.44
招商银行股份有限公司	-	859.81	859.81
合计	-	129,720.75	129,720.75

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年5月24日（基金合同生效日）至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证500指数增强A	华安中证500指数增强C	合计
华安基金管理有限公司	-	8,788.66	8,788.66
招商银行股份有限公司	-	198.97	198.97
合计	-	8,987.63	8,987.63

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金，再由华安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.2 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.2.1 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。

6.4.10.3 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5月24日（基金合同生效日）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
	招商银行	8,618,042.53	22,439.80	-

6.4.10.4 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118036	力合转债	2023-06-28	1-6个月(含)	配债未上市	100.00	100.00	230.00	23,000.00	23,000.45	-

6.4.11.2 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
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项或临时停牌	6.97	2023-07-03	7.40	54,800.00	395,635.41	381,956.00	-

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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。

6.4.11.3.2 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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组合持仓集中度指标、流通受限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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 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	8,618,042.53	-	-	-	8,618,042.53
结算备付金	4,793,112.65	-	-	-	4,793,112.65
存出保证金	355,452.00	-	-	-	355,452.00
交易性金融资产	170,646.40	-	-	158,226,807.70	158,397,454.10
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	62,794.04	62,794.04
资产总计	13,937,253.58	-	-	158,289,601.74	172,226,855.32
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	-	-	-	92,422.47	92,422.47
应付管理人报酬	-	-	-	88,134.34	88,134.34
应付托管费	-	-	-	22,033.57	22,033.57
应付销售服务费	-	-	-	35,238.75	35,238.75
应交税费	-	-	-	0.75	0.75
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	98,644.15	98,644.15

负债总计	-	-	-	336,474.03	336,474.03
利率敏感度缺口	13,937,253.58	-	-	157,953,127.71	171,890,381.29
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	5,514,065.40	-	-	-	5,514,065.40
结算备付金	850,854.96	-	-	-	850,854.96
交易性金融资产	-	-	-	102,658,649.46	102,658,649.46
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	183,044.26	183,044.26
资产总计	6,364,920.36	-	-	102,841,693.72	109,206,614.08
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	-	-	-	408,567.41	408,567.41
应付管理人报酬	-	-	-	56,851.93	56,851.93
应付托管费	-	-	-	14,212.99	14,212.99
应付销售服务费	-	-	-	26,160.74	26,160.74
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	615,793.07	615,793.07
利率敏感度缺口	6,364,920.36	-	-	102,225,900.65	108,590,821.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.2 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 0.10%(2022 年 12 月 31 日：无)，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)。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 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	158,226,807. 70	92.05	102,658,649.4 6	94.54

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	158,226,807.	92.05	102,658,649.4	94.54
	70		6	

6.4.12.4.3.2 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
	业绩比较基准上升 5%	7,520,000.00	4,570,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-7,520,000.00	-4,570,000.00

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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	157,992,497.65	102,658,649.46

第二层次	404,956.45	-
第三层次	-	-
合计	158,397,454.10	102,658,649.46

6.4.13.2.2 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.14 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	158,226,807.70	91.87
	其中：股票	158,226,807.70	91.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	170,646.40	0.10
	其中：债券	170,646.40	0.10
	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	13,411,155.18	7.79
8	其他各项资产	418,246.04	0.24
9	合计	172,226,855.32	100.00

7.2 报告期末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	1,895,418.00	1.10
B	采矿业	5,832,136.50	3.39
C	制造业	103,474,223.79	60.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,107,053.00	2.39
E	建筑业	1,729,332.00	1.01
F	批发和零售业	4,684,830.06	2.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,793,234.00	2.21
H	住宿和餐饮业	316,465.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,679,326.45	6.21
J	金融业	10,640,283.00	6.19
K	房地产业	1,867,864.00	1.09
L	租赁和商务服务业	2,783,495.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	1,394,136.90	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	1,262,560.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	511,920.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	3,151,935.00	1.83
S	综合	102,595.00	0.06
	合计	158,226,807.70	92.05

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

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	600372	中航电子	78,200	1,187,076.00	0.69
2	002429	兆驰股份	195,100	1,073,050.00	0.62
3	002624	完美世界	60,800	1,026,912.00	0.60
4	601058	赛轮轮胎	89,700	1,021,683.00	0.59
5	002028	思源电气	21,800	1,018,496.00	0.59
6	300037	新宙邦	19,400	1,006,666.00	0.59
7	601555	东吴证券	143,500	995,890.00	0.58
8	600765	中航重机	35,400	938,454.00	0.55
9	002465	海格通信	90,700	937,838.00	0.55
10	300146	汤臣倍健	39,000	935,220.00	0.54
11	600536	中国软件	19,500	914,160.00	0.53
12	300296	利亚德	139,200	908,976.00	0.53
13	601108	财通证券	122,500	886,900.00	0.52
14	300012	华测检测	45,400	885,300.00	0.52
15	600699	均胜电子	49,100	866,124.00	0.50
16	600161	天坛生物	31,900	866,085.00	0.50
17	603889	新澳股份	114,500	859,895.00	0.50
18	000783	长江证券	147,300	854,340.00	0.50
19	002409	雅克科技	11,600	845,408.00	0.49
20	603444	吉比特	1,700	834,887.00	0.49
21	300073	当升科技	16,500	830,445.00	0.48
22	600109	国金证券	95,200	825,384.00	0.48
23	600060	海信视像	33,000	816,750.00	0.48
24	601577	长沙银行	104,400	810,144.00	0.47
25	002138	顺络电子	33,200	793,812.00	0.46
26	002850	科达利	6,000	793,500.00	0.46
27	002568	百润股份	21,800	792,430.00	0.46
28	600079	人福医药	29,400	792,036.00	0.46
29	600487	亨通光电	54,000	791,640.00	0.46
30	300144	宋城演艺	63,700	789,880.00	0.46
31	600298	安琪酵母	21,700	785,757.00	0.46
32	600879	航天电子	92,100	781,929.00	0.45
33	002797	第一创业	136,700	781,924.00	0.45
34	000975	银泰黄金	66,600	779,220.00	0.45
35	300832	新产业	13,200	778,800.00	0.45
36	002025	航天电器	12,200	778,360.00	0.45
37	300866	安克创新	8,800	770,000.00	0.45
38	600563	法拉电子	5,600	768,880.00	0.45

39	300568	星源材质	44,700	768,393.00	0.45
40	605358	立昂微	20,800	763,984.00	0.44
41	601990	南京证券	91,600	749,288.00	0.44
42	600497	驰宏锌锗	147,500	740,450.00	0.43
43	600642	申能股份	105,900	740,241.00	0.43
44	300604	长川科技	15,500	736,095.00	0.43
45	000738	航发控制	30,000	732,000.00	0.43
46	603589	口子窖	14,700	725,445.00	0.42
47	000400	许继电气	31,300	721,465.00	0.42
48	600521	华海药业	39,100	719,831.00	0.42
49	300003	乐普医疗	31,600	714,476.00	0.42
50	688390	固德威	4,280	714,160.80	0.42
51	600549	厦门钨业	37,500	713,625.00	0.42
52	000998	隆平高科	46,300	710,705.00	0.41
53	601333	广深铁路	178,100	705,276.00	0.41
54	600862	中航高科	27,700	701,087.00	0.41
55	600489	中金黄金	67,200	694,176.00	0.40
56	002056	横店东磁	37,900	690,159.00	0.40
57	000997	新大陆	36,500	689,850.00	0.40
58	600481	双良节能	49,200	687,816.00	0.40
59	300185	通裕重工	246,300	687,177.00	0.40
60	603228	景旺电子	26,700	684,855.00	0.40
61	600166	福田汽车	201,400	684,760.00	0.40
62	600637	东方明珠	87,400	683,468.00	0.40
63	600516	方大炭素	110,000	682,000.00	0.40
64	600885	宏发股份	21,400	681,590.00	0.40
65	688002	睿创微纳	15,200	680,960.00	0.40
66	600021	上海电力	63,000	678,510.00	0.39
67	688301	奕瑞科技	2,400	677,832.00	0.39
68	600529	山东药玻	24,900	677,778.00	0.39
69	002373	千方科技	49,600	676,544.00	0.39
70	600704	物产中大	136,100	672,334.00	0.39
71	002507	涪陵榨菜	36,660	671,244.60	0.39
72	002683	广东宏大	22,800	671,232.00	0.39
73	600967	内蒙一机	66,200	668,620.00	0.39
74	002340	格林美	96,700	668,197.00	0.39
75	688009	中国通号	114,800	665,840.00	0.39
76	600118	中国卫星	23,600	665,756.00	0.39
77	603939	益丰药房	17,980	665,260.00	0.39
78	002595	豪迈科技	18,900	663,957.00	0.39
79	000623	吉林敖东	41,300	662,452.00	0.39
80	600498	烽火通信	32,500	662,025.00	0.39
81	002203	海亮股份	55,000	660,550.00	0.38
82	600380	健康元	51,900	659,649.00	0.38

83	601991	大唐发电	199,100	659,021.00	0.38
84	002080	中材科技	32,100	658,692.00	0.38
85	002299	圣农发展	34,300	656,845.00	0.38
86	600970	中材国际	51,200	652,800.00	0.38
87	002430	杭氧股份	18,900	649,404.00	0.38
88	300383	光环新网	60,400	649,300.00	0.38
89	002152	广电运通	55,300	648,116.00	0.38
90	002422	科伦药业	21,700	644,056.00	0.37
91	002531	天顺风能	42,200	642,706.00	0.37
92	002372	伟星新材	31,100	638,794.00	0.37
93	002353	杰瑞股份	25,400	638,302.00	0.37
94	600348	华阳股份	80,250	634,777.50	0.37
95	603338	浙江鼎力	11,300	632,913.00	0.37
96	600415	小商品城	74,100	632,073.00	0.37
97	002384	东山精密	24,400	631,960.00	0.37
98	603517	绝味食品	17,000	631,550.00	0.37
99	600528	中铁工业	63,900	631,332.00	0.37
100	000878	云南铜业	57,100	630,955.00	0.37
101	002926	华西证券	75,700	629,067.00	0.37
102	600998	九州通	60,047	623,287.86	0.36
103	300682	朗新科技	26,700	621,576.00	0.36
104	600435	北方导航	54,000	620,460.00	0.36
105	600820	隧道股份	103,200	620,232.00	0.36
106	600909	华安证券	132,700	619,709.00	0.36
107	600535	天士力	42,500	616,675.00	0.36
108	600418	江淮汽车	48,900	615,651.00	0.36
109	600655	豫园股份	89,200	611,912.00	0.36
110	601598	中国外运	130,500	608,130.00	0.35
111	600038	中直股份	15,200	605,264.00	0.35
112	603456	九洲药业	22,000	602,360.00	0.35
113	000060	中金岭南	126,700	601,825.00	0.35
114	600329	达仁堂	13,400	601,526.00	0.35
115	000636	风华高科	39,000	598,260.00	0.35
116	300009	安科生物	59,700	597,000.00	0.35
117	002500	山西证券	106,200	592,596.00	0.34
118	002185	华天科技	62,900	578,680.00	0.34
119	000050	深天马 A	62,600	574,668.00	0.33
120	002223	鱼跃医疗	15,900	572,241.00	0.33
121	601958	金铂股份	51,300	571,995.00	0.33
122	300357	我武生物	17,000	571,710.00	0.33
123	603596	伯特利	7,200	570,672.00	0.33
124	603233	大参林	20,320	569,163.20	0.33
125	600096	云天化	33,100	565,017.00	0.33
126	603712	七一二	18,700	564,927.00	0.33

127	002625	光启技术	37,000	564,620.00	0.33
128	600316	洪都航空	24,000	562,800.00	0.33
129	601231	环旭电子	37,600	562,496.00	0.33
130	603885	吉祥航空	36,300	560,109.00	0.33
131	300373	扬杰科技	13,800	559,866.00	0.33
132	000739	普洛药业	31,300	555,262.00	0.32
133	600517	国网英大	96,000	547,200.00	0.32
134	603218	日月股份	28,600	543,114.00	0.32
135	002867	周大生	30,400	540,512.00	0.31
136	002690	美亚光电	20,900	538,175.00	0.31
137	002387	维信诺	58,600	537,362.00	0.31
138	000598	兴蓉环境	98,400	534,312.00	0.31
139	002985	北摩高科	12,100	533,852.00	0.31
140	300861	美畅股份	12,300	533,451.00	0.31
141	603568	伟明环保	30,400	532,304.00	0.31
142	600755	厦门国贸	68,700	531,738.00	0.31
143	000778	新兴铸管	130,000	530,400.00	0.31
144	002183	怡亚通	104,000	530,400.00	0.31
145	688188	柏楚电子	2,800	527,968.00	0.31
146	600598	北大荒	39,600	527,868.00	0.31
147	002155	湖南黄金	43,100	525,820.00	0.31
148	600906	财达证券	72,900	524,880.00	0.31
149	600582	天地科技	90,000	524,700.00	0.31
150	000528	柳工	66,300	523,770.00	0.30
151	688277	天智航	28,379	523,308.76	0.30
152	000513	丽珠集团	13,400	521,394.00	0.30
153	603877	太平鸟	20,600	520,768.00	0.30
154	002925	盈趣科技	26,800	519,920.00	0.30
155	000157	中联重科	76,600	517,050.00	0.30
156	601179	中国西电	95,400	516,114.00	0.30
157	600718	东软集团	48,400	515,944.00	0.30
158	603277	银都股份	23,600	515,424.00	0.30
159	000066	中国长城	37,100	513,093.00	0.30
160	002035	华帝股份	72,200	512,620.00	0.30
161	002044	美年健康	72,000	511,920.00	0.30
162	000969	安泰科技	53,800	509,486.00	0.30
163	603127	昭衍新药	12,441	508,836.90	0.30
164	002745	木林森	55,300	508,760.00	0.30
165	300236	上海新阳	12,800	507,520.00	0.30
166	000581	威孚高科	32,200	507,150.00	0.30
167	603076	乐惠国际	10,600	506,786.00	0.29
168	000807	云铝股份	39,800	506,654.00	0.29
169	603225	新凤鸣	45,800	506,090.00	0.29
170	002468	申通快递	46,700	505,294.00	0.29

171	300251	光线传媒	62,300	504,007.00	0.29
172	688208	道通科技	16,600	503,146.00	0.29
173	600663	陆家嘴	50,600	499,422.00	0.29
174	300888	稳健医疗	11,900	495,873.00	0.29
175	603638	艾迪精密	24,100	494,532.00	0.29
176	688076	诺泰生物	13,889	494,170.62	0.29
177	002511	中顺洁柔	44,200	492,830.00	0.29
178	300413	芒果超媒	14,400	492,624.00	0.29
179	000559	万向钱潮	90,200	491,590.00	0.29
180	688029	南微医学	6,000	489,360.00	0.28
181	600449	宁夏建材	31,200	485,472.00	0.28
182	002010	传化智联	89,400	475,608.00	0.28
183	002368	太极股份	11,400	469,338.00	0.27
184	688779	长远锂科	41,600	468,832.00	0.27
185	301029	怡合达	10,480	468,246.40	0.27
186	000785	居然之家	122,500	466,725.00	0.27
187	002966	苏州银行	71,100	465,705.00	0.27
188	300257	开山股份	30,600	464,202.00	0.27
189	600373	中文传媒	34,500	459,540.00	0.27
190	300058	蓝色光标	47,300	457,391.00	0.27
191	601098	中南传媒	39,400	457,040.00	0.27
192	601611	中国核建	54,000	456,300.00	0.27
193	300136	信维通信	22,400	449,792.00	0.26
194	603650	彤程新材	13,700	449,360.00	0.26
195	600126	杭钢股份	102,900	446,586.00	0.26
196	300017	网宿科技	62,500	444,375.00	0.26
197	000089	深圳机场	63,300	439,935.00	0.26
198	600580	卧龙电驱	30,000	438,300.00	0.25
199	600597	光明乳业	41,900	435,760.00	0.25
200	603786	科博达	6,600	433,620.00	0.25
201	002273	水晶光电	36,100	431,034.00	0.25
202	000537	广宇发展	36,700	428,289.00	0.25
203	688690	纳微科技	11,000	427,350.00	0.25
204	600167	联美控股	61,300	427,261.00	0.25
205	002249	大洋电机	74,800	426,360.00	0.25
206	001914	招商积余	28,300	425,915.00	0.25
207	000937	冀中能源	66,500	424,270.00	0.25
208	000967	盈峰环境	84,000	424,200.00	0.25
209	002705	新宝股份	23,500	423,705.00	0.25
210	601168	西部矿业	40,000	420,400.00	0.24
211	300253	卫宁健康	38,500	416,570.00	0.24
212	600143	金发科技	47,100	411,183.00	0.24
213	600486	扬农化工	4,700	410,874.00	0.24
214	600271	航天信息	30,000	410,700.00	0.24

215	688819	天能股份	11,133	410,139.72	0.24
216	601568	北元集团	77,800	410,006.00	0.24
217	002444	巨星科技	18,600	406,968.00	0.24
218	601869	长飞光纤	10,800	399,708.00	0.23
219	601139	深圳燃气	54,100	394,389.00	0.23
220	603927	中科软	10,200	393,312.00	0.23
221	002563	森马服饰	62,800	390,616.00	0.23
222	002557	洽洽食品	9,300	386,415.00	0.22
223	600623	华谊集团	61,700	384,391.00	0.22
224	601298	青岛港	54,800	381,956.00	0.22
225	002065	东华软件	53,400	377,004.00	0.22
226	603317	天味食品	25,800	376,938.00	0.22
227	688516	奥特维	2,000	376,800.00	0.22
228	600511	国药股份	9,600	372,960.00	0.22
229	601969	海南矿业	56,200	369,796.00	0.22
230	000869	张裕 A	12,000	367,920.00	0.21
231	601198	东兴证券	45,300	363,306.00	0.21
232	603920	世运电路	18,500	361,305.00	0.21
233	603855	华荣股份	13,400	356,440.00	0.21
234	600299	安迪苏	44,700	356,259.00	0.21
235	300729	乐歌股份	19,930	355,551.20	0.21
236	000333	美的集团	6,000	353,520.00	0.21
237	300088	长信科技	58,600	353,358.00	0.21
238	600859	王府井	17,800	352,262.00	0.20
239	688153	唯捷创芯	4,807	351,680.12	0.20
240	002153	石基信息	25,090	351,260.00	0.20
241	002151	北斗星通	9,800	344,568.00	0.20
242	000553	安道麦 A	40,800	344,352.00	0.20
243	600350	山东高速	53,700	342,069.00	0.20
244	300741	华宝股份	15,800	338,436.00	0.20
245	300480	光力科技	14,700	336,042.00	0.20
246	600391	航发科技	13,900	335,129.00	0.19
247	000547	航天发展	33,100	331,000.00	0.19
248	603737	三棵树	5,040	329,716.80	0.19
249	603868	飞科电器	5,200	328,068.00	0.19
250	300740	水羊股份	20,700	320,850.00	0.19
251	002901	大博医疗	10,200	317,016.00	0.18
252	600258	首旅酒店	16,700	316,465.00	0.18
253	688588	凌志软件	20,011	311,171.05	0.18
254	002019	亿帆医药	21,100	308,060.00	0.18
255	688385	复旦微电	6,142	307,714.20	0.18
256	300070	碧水源	57,100	306,056.00	0.18
257	600315	上海家化	10,400	301,704.00	0.18
258	600066	宇通客车	20,200	297,748.00	0.17

259	002244	滨江集团	33,500	295,470.00	0.17
260	603160	汇顶科技	6,200	286,750.00	0.17
261	002544	普天科技	12,200	279,380.00	0.16
262	002670	国盛金控	31,100	273,058.00	0.16
263	603883	老百姓	9,100	271,635.00	0.16
264	688100	威胜信息	9,000	268,290.00	0.16
265	600155	华创云信	43,000	267,460.00	0.16
266	600801	华新水泥	20,900	258,115.00	0.15
267	603081	大丰实业	14,000	257,320.00	0.15
268	000027	深圳能源	38,900	256,351.00	0.15
269	688589	力合微	6,200	252,588.00	0.15
270	600095	湘财股份	32,000	249,600.00	0.15
271	600707	彩虹股份	52,200	248,472.00	0.14
272	688234	天岳先进	3,200	236,608.00	0.14
273	603379	三美股份	9,700	228,047.00	0.13
274	601928	凤凰传媒	19,700	224,580.00	0.13
275	600027	华电国际	33,300	222,777.00	0.13
276	601828	美凯龙	46,200	221,298.00	0.13
277	000402	金融街	48,400	218,768.00	0.13
278	002945	华林证券	14,900	203,832.00	0.12
279	600835	上海机电	11,800	202,724.00	0.12
280	001872	招商港口	11,600	200,332.00	0.12
281	600873	梅花生物	22,200	198,246.00	0.12
282	600482	中国动力	8,300	194,552.00	0.11
283	002078	太阳纸业	18,100	193,489.00	0.11
284	688006	杭可科技	6,259	190,711.73	0.11
285	600500	中化国际	32,300	179,588.00	0.10
286	300307	慈星股份	22,800	155,724.00	0.09
287	600363	联创光电	4,100	152,110.00	0.09
288	603266	天龙股份	10,400	144,664.00	0.08
289	603311	金海高科	11,600	143,840.00	0.08
290	603096	新经典	6,800	138,448.00	0.08
291	688772	珠海冠宇	6,600	132,990.00	0.08
292	688686	奥普特	800	131,584.00	0.08
293	688777	中控技术	2,030	127,443.40	0.07
294	600556	天下秀	16,400	116,276.00	0.07
295	000009	中国宝安	8,500	102,595.00	0.06
296	603688	石英股份	900	102,456.00	0.06
297	600863	内蒙华电	24,100	100,015.00	0.06
298	603355	莱克电气	3,900	99,099.00	0.06
299	600956	新天绿能	10,800	94,176.00	0.05
300	300182	捷成股份	13,600	85,816.00	0.05
301	688320	禾川科技	1,622	78,212.84	0.05
302	002092	中泰化学	11,800	76,110.00	0.04

303	600378	昊华科技	1,900	71,516.00	0.04
304	688116	天奈科技	1,400	64,050.00	0.04
305	603026	胜华新材	1,000	59,250.00	0.03
306	600377	宁沪高速	5,100	50,133.00	0.03
307	300363	博腾股份	1,500	44,385.00	0.03
308	600056	中国医药	1,100	14,278.00	0.01
309	603707	健友股份	200	2,700.00	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	002422	科伦药业	9,325,674.00	8.59
2	600489	中金黄金	9,106,628.66	8.39
3	688122	西部超导	8,818,315.95	8.12
4	601872	招商轮船	8,708,861.25	8.02
5	600879	航天电子	8,413,983.10	7.75
6	603605	珀莱雅	7,843,133.71	7.22
7	300699	光威复材	7,334,073.20	6.75
8	603658	安图生物	7,110,782.22	6.55
9	000999	华润三九	7,088,495.00	6.53
10	600487	亨通光电	7,070,221.00	6.51
11	000807	云铝股份	6,923,724.31	6.38
12	002353	杰瑞股份	6,885,049.23	6.34
13	600873	梅花生物	6,881,061.00	6.34
14	002430	杭氧股份	6,838,460.04	6.30
15	600967	内蒙一机	6,758,041.00	6.22
16	002738	中矿资源	6,726,554.60	6.19
17	600970	中材国际	6,615,762.00	6.09
18	600998	九州通	6,550,220.00	6.03
19	002080	中材科技	6,480,875.00	5.97
20	600901	江苏金租	6,453,702.00	5.94
21	688009	中国通号	6,390,987.48	5.89
22	002625	光启技术	6,364,738.26	5.86
23	002152	广电运通	6,343,168.25	5.84
24	600079	人福医药	6,238,921.62	5.75
25	300682	朗新科技	6,227,086.00	5.73
26	300115	长盈精密	6,181,555.00	5.69
27	600528	中铁工业	6,110,425.00	5.63
28	002384	东山精密	6,053,036.00	5.57

29	300296	利亚德	5,992,451.00	5.52
30	603613	国联股份	5,981,411.00	5.51
31	002025	航天电器	5,971,560.00	5.50
32	000739	普洛药业	5,939,777.00	5.47
33	600021	上海电力	5,885,778.00	5.42
34	002340	格林美	5,885,444.00	5.42
35	002056	横店东磁	5,832,613.00	5.37
36	601108	财通证券	5,779,363.30	5.32
37	601298	青岛港	5,774,610.00	5.32
38	002385	大北农	5,772,406.00	5.32
39	600546	山煤国际	5,752,563.00	5.30
40	300568	星源材质	5,738,422.00	5.28
41	300866	安克创新	5,716,577.00	5.26
42	300832	新产业	5,716,458.00	5.26
43	688063	派能科技	5,667,128.95	5.22
44	000997	新大陆	5,642,837.46	5.20
45	603737	三棵树	5,550,642.00	5.11
46	600373	中文传媒	5,528,345.00	5.09
47	600765	中航重机	5,451,039.00	5.02
48	601666	平煤股份	5,431,536.63	5.00
49	600704	物产中大	5,404,189.00	4.98
50	002294	信立泰	5,401,267.00	4.97
51	600195	中牧股份	5,393,908.29	4.97
52	002508	老板电器	5,337,242.00	4.92
53	688301	奕瑞科技	5,318,627.22	4.90
54	300146	汤臣倍健	5,292,011.74	4.87
55	300373	扬杰科技	5,288,220.00	4.87
56	600820	隧道股份	5,222,915.69	4.81
57	600131	国网信通	5,182,319.00	4.77
58	300070	碧水源	5,166,013.00	4.76
59	002250	联化科技	5,147,262.37	4.74
60	002128	电投能源	5,129,545.00	4.72
61	000513	丽珠集团	5,113,455.00	4.71
62	002409	雅克科技	5,067,128.00	4.67
63	600329	达仁堂	5,063,927.00	4.66
64	688390	固德威	5,063,075.28	4.66
65	002273	水晶光电	5,029,382.97	4.63
66	601098	中南传媒	5,005,028.03	4.61
67	002690	美亚光电	4,985,313.50	4.59
68	600160	巨化股份	4,981,677.00	4.59
69	603233	大参林	4,950,606.96	4.56
70	002531	天顺风能	4,945,233.00	4.55
71	300308	中际旭创	4,879,529.00	4.49
72	600642	申能股份	4,864,723.06	4.48

73	600985	淮北矿业	4,844,482.00	4.46
74	300724	捷佳伟创	4,824,017.05	4.44
75	002372	伟星新材	4,806,690.00	4.43
76	688002	睿创微纳	4,801,583.47	4.42
77	002078	太阳纸业	4,780,374.28	4.40
78	300003	乐普医疗	4,775,005.20	4.40
79	601156	东航物流	4,749,289.00	4.37
80	002572	索菲亚	4,740,520.00	4.37
81	300088	长信科技	4,740,114.00	4.37
82	603345	安井食品	4,725,969.00	4.35
83	603379	三美股份	4,700,155.00	4.33
84	688385	复旦微电	4,684,407.69	4.31
85	601699	潞安环能	4,674,154.00	4.30
86	300630	普利制药	4,662,496.00	4.29
87	000598	兴蓉环境	4,655,407.00	4.29
88	300009	安科生物	4,654,129.40	4.29
89	601958	金钼股份	4,634,673.00	4.27
90	300888	稳健医疗	4,632,786.60	4.27
91	600500	中化国际	4,551,064.00	4.19
92	002081	金螳螂	4,512,750.00	4.16
93	300390	天华新能	4,342,417.24	4.00
94	600066	宇通客车	4,295,903.00	3.96
95	601139	深圳燃气	4,276,053.00	3.94
96	600511	国药股份	4,248,423.00	3.91
97	300136	信维通信	4,209,097.00	3.88
98	601168	西部矿业	4,183,699.00	3.85
99	601058	赛轮轮胎	4,163,151.00	3.83
100	000738	航发控制	4,136,483.90	3.81
101	600064	南京高科	4,117,661.32	3.79
102	600566	济川药业	4,110,762.00	3.79
103	600623	华谊集团	4,096,017.00	3.77
104	603688	石英股份	4,033,618.00	3.71
105	000581	威孚高科	4,030,801.97	3.71
106	600859	王府井	4,015,177.00	3.70
107	300144	宋城演艺	3,982,068.85	3.67
108	002497	雅化集团	3,963,837.00	3.65
109	603355	莱克电气	3,942,946.00	3.63
110	002266	浙富控股	3,935,687.12	3.62
111	603267	鸿远电子	3,896,318.00	3.59
112	600161	天坛生物	3,880,849.40	3.57
113	603056	德邦股份	3,876,277.76	3.57
114	600143	金发科技	3,853,789.00	3.55
115	601607	上海医药	3,840,375.87	3.54
116	600673	东阳光	3,834,334.00	3.53

117	600298	安琪酵母	3,800,950.00	3.50
118	601717	郑煤机	3,774,032.00	3.48
119	002595	豪迈科技	3,730,856.00	3.44
120	002242	九阳股份	3,717,083.00	3.42
121	300037	新宙邦	3,714,725.40	3.42
122	000878	云南铜业	3,710,263.14	3.42
123	300604	长川科技	3,707,763.00	3.41
124	603589	口子窖	3,695,850.00	3.40
125	002048	宁波华翔	3,667,986.00	3.38
126	600862	中航高科	3,661,656.11	3.37
127	601869	长飞光纤	3,661,208.00	3.37
128	002925	盈趣科技	3,645,236.28	3.36
129	600060	海信视像	3,634,727.00	3.35
130	002867	周大生	3,634,036.76	3.35
131	600718	东软集团	3,631,953.13	3.34
132	000400	许继电气	3,630,538.95	3.34
133	002624	完美世界	3,628,707.19	3.34
134	600895	张江高科	3,605,086.00	3.32
135	600398	海澜之家	3,602,320.61	3.32
136	603707	健友股份	3,583,990.00	3.30
137	601179	中国西电	3,574,864.00	3.29
138	600482	中国动力	3,574,128.46	3.29
139	603444	吉比特	3,570,707.00	3.29
140	600885	宏发股份	3,530,442.00	3.25
141	002929	润建股份	3,505,444.00	3.23
142	600498	烽火通信	3,497,072.44	3.22
143	002030	达安基因	3,456,563.00	3.18
144	600486	扬农化工	3,444,307.00	3.17
145	000729	燕京啤酒	3,430,927.00	3.16
146	600827	百联股份	3,397,023.00	3.13
147	002192	融捷股份	3,378,613.65	3.11
148	600499	科达制造	3,374,856.03	3.11
149	600549	厦门钨业	3,373,246.00	3.11
150	300257	开山股份	3,341,846.00	3.08
151	603456	九洲药业	3,310,104.00	3.05
152	688819	天能股份	3,304,368.67	3.04
153	603883	老百姓	3,301,857.24	3.04
154	000401	冀东水泥	3,301,436.86	3.04
155	000933	神火股份	3,264,476.85	3.01
156	601231	环旭电子	3,230,765.00	2.98
157	300358	楚天科技	3,217,317.00	2.96
158	600026	中远海能	3,207,411.00	2.95
159	000009	中国宝安	3,198,842.00	2.95
160	603712	七一二	3,190,476.00	2.94

161	603648	畅联股份	3,178,510.00	2.93
162	688586	江航装备	3,162,615.82	2.91
163	688777	中控技术	3,159,582.34	2.91
164	002398	垒知集团	3,157,259.12	2.91
165	603939	益丰药房	3,156,014.00	2.91
166	000559	万向钱潮	3,151,808.35	2.90
167	603868	飞科电器	3,150,579.00	2.90
168	603893	瑞芯微	3,140,624.00	2.89
169	688779	长远锂科	3,136,459.50	2.89
170	600109	国金证券	3,124,714.49	2.88
171	002396	星网锐捷	3,122,700.00	2.88
172	002299	圣农发展	3,121,669.00	2.87
173	600415	小商品城	3,116,978.00	2.87
174	600027	华电国际	3,116,645.00	2.87
175	600392	盛和资源	3,109,420.79	2.86
176	002249	大洋电机	3,093,665.00	2.85
177	002790	瑞尔特	3,089,853.00	2.85
178	300558	贝达药业	3,081,305.00	2.84
179	603228	景旺电子	3,075,216.00	2.83
180	002683	广东宏大	3,068,314.00	2.83
181	000030	富奥股份	3,067,186.45	2.82
182	000975	银泰黄金	3,065,760.00	2.82
183	600637	东方明珠	3,063,042.93	2.82
184	601577	长沙银行	3,040,490.00	2.80
185	601555	东吴证券	3,024,227.53	2.78
186	300251	光线传媒	3,016,316.00	2.78
187	000623	吉林敖东	2,999,479.70	2.76
188	601990	南京证券	2,991,449.00	2.75
189	002568	百润股份	2,975,937.40	2.74
190	603160	汇顶科技	2,968,341.00	2.73
191	600271	航天信息	2,966,499.00	2.73
192	000988	华工科技	2,923,510.00	2.69
193	600699	均胜电子	2,909,894.00	2.68
194	600299	安迪苏	2,891,817.00	2.66
195	688099	晶晨股份	2,848,273.11	2.62
196	600580	卧龙电驱	2,844,709.00	2.62
197	600258	首旅酒店	2,824,998.00	2.60
198	600529	山东药玻	2,812,064.00	2.59
199	601997	贵阳银行	2,807,012.00	2.58
200	601908	京运通	2,803,741.00	2.58
201	603026	胜华新材	2,801,232.53	2.58
202	300073	当升科技	2,790,594.00	2.57
203	300861	美畅股份	2,773,736.00	2.55
204	002368	太极股份	2,760,875.50	2.54

205	603127	昭衍新药	2,758,466.32	2.54
206	002429	兆驰股份	2,748,960.00	2.53
207	600535	天士力	2,745,672.00	2.53
208	000591	太阳能	2,734,196.00	2.52
209	002203	海亮股份	2,727,821.00	2.51
210	688006	杭可科技	2,703,602.26	2.49
211	300447	全信股份	2,701,201.00	2.49
212	000932	华菱钢铁	2,678,704.00	2.47
213	600210	紫江企业	2,675,977.00	2.46
214	000050	深天马 A	2,670,328.00	2.46
215	600348	华阳股份	2,647,115.00	2.44
216	603156	养元饮品	2,645,398.00	2.44
217	603977	国泰集团	2,645,270.32	2.44
218	300363	博腾股份	2,640,383.00	2.43
219	601611	中国核建	2,634,166.00	2.43
220	002705	新宝股份	2,626,600.00	2.42
221	300357	我武生物	2,624,916.50	2.42
222	002281	光迅科技	2,615,971.00	2.41
223	000887	中鼎股份	2,615,730.00	2.41
224	601928	凤凰传媒	2,601,951.60	2.40
225	600517	国网英大	2,600,180.00	2.39
226	603927	中科软	2,595,045.37	2.39
227	600380	健康元	2,578,420.00	2.37
228	002797	第一创业	2,565,494.09	2.36
229	601198	东兴证券	2,525,498.00	2.33
230	600399	抚顺特钢	2,523,348.00	2.32
231	002407	多氟多	2,518,898.60	2.32
232	002465	海格通信	2,503,270.00	2.31
233	002155	湖南黄金	2,474,462.00	2.28
234	600155	华创云信	2,473,716.00	2.28
235	600096	云天化	2,435,142.00	2.24
236	300285	国瓷材料	2,427,546.00	2.24
237	300376	易事特	2,416,981.00	2.23
238	002507	涪陵榨菜	2,413,501.00	2.22
239	000636	风华高科	2,412,911.71	2.22
240	601598	中国外运	2,406,082.00	2.22
241	000930	中粮科技	2,401,076.00	2.21
242	603568	伟明环保	2,396,623.30	2.21
243	002028	思源电气	2,385,267.72	2.20
244	603816	顾家家居	2,380,168.74	2.19
245	002563	森马服饰	2,371,214.00	2.18
246	002701	奥瑞金	2,370,228.00	2.18
247	600801	华新水泥	2,361,819.00	2.17
248	688029	南微医学	2,358,074.80	2.17

249	600376	首开股份	2,342,933.90	2.16
250	603339	四方科技	2,333,835.00	2.15
251	002739	万达电影	2,306,016.00	2.12
252	002850	科达利	2,284,265.00	2.10
253	300012	华测检测	2,266,941.00	2.09
254	300017	网宿科技	2,255,748.00	2.08
255	001696	宗申动力	2,226,776.00	2.05
256	002985	北摩高科	2,218,870.00	2.04
257	600435	北方导航	2,190,616.00	2.02
258	002966	苏州银行	2,188,850.00	2.02
259	300001	特锐德	2,187,950.00	2.01

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	601872	招商轮船	9,020,112.24	8.31
2	688122	西部超导	8,828,342.73	8.13
3	002422	科伦药业	8,765,828.00	8.07
4	600489	中金黄金	8,507,538.00	7.83
5	002738	中矿资源	8,178,557.62	7.53
6	600901	江苏金租	7,854,170.75	7.23
7	600879	航天电子	7,829,264.00	7.21
8	603605	珀莱雅	7,592,855.60	6.99
9	000999	华润三九	7,456,744.10	6.87
10	002430	杭氧股份	7,236,109.00	6.66
11	002353	杰瑞股份	7,174,675.00	6.61
12	603658	安图生物	7,132,343.76	6.57
13	300115	长盈精密	6,973,560.43	6.42
14	300308	中际旭创	6,930,771.95	6.38
15	002384	东山精密	6,901,079.67	6.36
16	600373	中文传媒	6,814,044.00	6.27
17	000997	新大陆	6,698,261.00	6.17
18	600546	山煤国际	6,686,594.00	6.16
19	300699	光威复材	6,587,798.40	6.07
20	601298	青岛港	6,569,402.00	6.05
21	688063	派能科技	6,498,743.60	5.98
22	600160	巨化股份	6,495,145.00	5.98
23	600873	梅花生物	6,492,541.00	5.98
24	300724	捷佳伟创	6,433,889.25	5.92
25	600967	内蒙一机	6,360,335.00	5.86
26	002273	水晶光电	6,315,498.39	5.82

27	000807	云铝股份	6,304,729.45	5.81
28	600970	中材国际	6,245,452.00	5.75
29	002056	横店东磁	6,233,764.88	5.74
30	600998	九州通	6,212,276.00	5.72
31	600487	亨通光电	6,194,019.00	5.70
32	601699	潞安环能	6,155,964.00	5.67
33	300373	扬杰科技	6,043,215.30	5.57
34	688009	中国通号	5,869,678.47	5.41
35	300682	朗新科技	5,861,014.06	5.40
36	600528	中铁工业	5,840,864.00	5.38
37	300568	星源材质	5,838,305.80	5.38
38	002409	雅克科技	5,833,683.00	5.37
39	600820	隧道股份	5,826,386.41	5.37
40	688390	固德威	5,809,701.04	5.35
41	601666	平煤股份	5,809,396.00	5.35
42	002625	光启技术	5,774,250.00	5.32
43	002152	广电运通	5,744,410.00	5.29
44	600195	中牧股份	5,743,495.00	5.29
45	002080	中材科技	5,735,297.00	5.28
46	600765	中航重机	5,731,350.92	5.28
47	600985	淮北矿业	5,695,575.00	5.24
48	688385	复旦微电	5,693,036.74	5.24
49	603613	国联股份	5,651,272.00	5.20
50	300146	汤臣倍健	5,639,536.00	5.19
51	002128	电投能源	5,633,296.00	5.19
52	300390	天华新能	5,610,049.00	5.17
53	600079	人福医药	5,440,083.00	5.01
54	002294	信立泰	5,410,281.18	4.98
55	600131	国网信通	5,394,103.00	4.97
56	300070	碧水源	5,378,448.84	4.95
57	300866	安克创新	5,347,644.99	4.92
58	002508	老板电器	5,324,309.60	4.90
59	300296	利亚德	5,286,954.00	4.87
60	002385	大北农	5,221,452.00	4.81
61	000739	普洛药业	5,193,946.00	4.78
62	002497	雅化集团	5,181,706.05	4.77
63	002250	联化科技	5,174,523.00	4.77
64	600021	上海电力	5,130,161.00	4.72
65	601108	财通证券	5,125,541.57	4.72
66	002340	格林美	5,118,830.00	4.71
67	002048	宁波华翔	5,111,468.00	4.71
68	300832	新产业	5,034,740.41	4.64
69	603737	三棵树	4,916,712.00	4.53
70	600499	科达制造	4,912,111.00	4.52

71	002025	航天电器	4,881,172.00	4.50
72	600895	张江高科	4,862,287.00	4.48
73	600704	物产中大	4,834,491.00	4.45
74	601098	中南传媒	4,811,600.92	4.43
75	601156	东航物流	4,791,952.00	4.41
76	600329	达仁堂	4,776,612.80	4.40
77	000513	丽珠集团	4,682,862.91	4.31
78	601058	赛轮轮胎	4,682,389.00	4.31
79	603379	三美股份	4,674,413.92	4.30
80	603345	安井食品	4,670,250.00	4.30
81	002572	索菲亚	4,668,995.64	4.30
82	600143	金发科技	4,658,972.00	4.29
83	603444	吉比特	4,658,387.11	4.29
84	000878	云南铜业	4,644,466.77	4.28
85	300630	普利制药	4,577,327.00	4.22
86	300088	长信科技	4,567,729.00	4.21
87	688301	奕瑞科技	4,563,777.86	4.20
88	002081	金螳螂	4,496,554.42	4.14
89	002078	太阳纸业	4,490,575.52	4.14
90	600060	海信视像	4,459,902.00	4.11
91	601717	郑煤机	4,436,747.00	4.09
92	002690	美亚光电	4,429,692.20	4.08
93	002372	伟星新材	4,384,257.54	4.04
94	688819	天能股份	4,356,507.72	4.01
95	600066	宇通客车	4,354,948.00	4.01
96	600862	中航高科	4,299,826.00	3.96
97	600064	南京高科	4,292,291.00	3.95
98	002281	光迅科技	4,283,084.00	3.94
99	688002	睿创微纳	4,244,940.71	3.91
100	600500	中化国际	4,242,616.00	3.91
101	601231	环旭电子	4,235,114.00	3.90
102	600566	济川药业	4,231,898.00	3.90
103	300136	信维通信	4,208,671.39	3.88
104	000598	兴蓉环境	4,201,957.00	3.87
105	600642	申能股份	4,185,958.00	3.85
106	603688	石英股份	4,164,549.00	3.84
107	603355	莱克电气	4,106,967.60	3.78
108	600511	国药股份	4,066,235.00	3.74
109	601607	上海医药	4,061,228.00	3.74
110	601869	长飞光纤	4,038,454.78	3.72
111	300003	乐普医疗	4,017,978.00	3.70
112	002531	天顺风能	4,012,968.00	3.70
113	603267	鸿远电子	3,998,535.66	3.68
114	600298	安琪酵母	3,996,413.00	3.68

115	300009	安科生物	3,988,868.40	3.67
116	603233	大参林	3,963,170.28	3.65
117	601168	西部矿业	3,913,459.00	3.60
118	002266	浙富控股	3,895,081.70	3.59
119	601139	深圳燃气	3,876,789.00	3.57
120	300888	稳健医疗	3,875,598.60	3.57
121	600210	紫江企业	3,858,313.00	3.55
122	600398	海澜之家	3,849,530.00	3.54
123	600673	东阳光	3,818,135.00	3.52
124	603707	健友股份	3,737,997.61	3.44
125	601908	京运通	3,732,304.00	3.44
126	601958	金铂股份	3,716,164.00	3.42
127	600623	华谊集团	3,709,547.00	3.42
128	000581	威孚高科	3,695,349.18	3.40
129	601577	长沙银行	3,591,724.00	3.31
130	002929	润建股份	3,547,063.00	3.27
131	600482	中国动力	3,452,586.00	3.18
132	002242	九阳股份	3,446,580.00	3.17
133	000988	华工科技	3,440,703.40	3.17
134	002595	豪迈科技	3,434,710.66	3.16
135	000933	神火股份	3,419,174.00	3.15
136	601997	贵阳银行	3,411,360.00	3.14
137	000738	航发控制	3,404,286.00	3.13
138	002925	盈趣科技	3,387,659.00	3.12
139	600827	百联股份	3,378,781.00	3.11
140	002030	达安基因	3,354,438.00	3.09
141	300861	美畅股份	3,349,675.60	3.08
142	603977	国泰集团	3,333,114.84	3.07
143	002203	海亮股份	3,329,365.00	3.07
144	000729	燕京啤酒	3,327,179.00	3.06
145	002705	新宝股份	3,305,141.00	3.04
146	600859	王府井	3,297,670.11	3.04
147	603927	中科软	3,281,710.00	3.02
148	603056	德邦股份	3,276,450.78	3.02
149	300358	楚天科技	3,272,421.00	3.01
150	603893	瑞芯微	3,244,871.68	2.99
151	300073	当升科技	3,235,796.99	2.98
152	600026	中远海能	3,234,313.00	2.98
153	603127	昭衍新药	3,203,673.18	2.95
154	002398	垒知集团	3,183,430.00	2.93
155	300558	贝达药业	3,176,613.60	2.93
156	603648	畅联股份	3,176,549.00	2.93
157	000401	冀东水泥	3,160,048.00	2.91
158	600549	厦门钨业	3,154,719.00	2.91

159	600718	东软集团	3,152,389.47	2.90
160	688586	江航装备	3,140,710.03	2.89
161	002867	周大生	3,137,812.34	2.89
162	600161	天坛生物	3,137,345.65	2.89
163	002985	北摩高科	3,129,352.50	2.88
164	601179	中国西电	3,123,980.00	2.88
165	002396	星网锐捷	3,105,227.00	2.86
166	603456	九洲药业	3,086,638.00	2.84
167	000009	中国宝安	3,078,220.00	2.83
168	603589	口子窖	3,077,319.00	2.83
169	000030	富奥股份	3,077,233.17	2.83
170	300144	宋城演艺	3,063,508.98	2.82
171	600392	盛和资源	3,051,777.00	2.81
172	600109	国金证券	3,047,240.61	2.81
173	002465	海格通信	3,027,540.00	2.79
174	002790	瑞尔特	2,978,325.00	2.74
175	300357	我武生物	2,971,718.00	2.74
176	000012	南玻 A	2,967,141.91	2.73
177	688777	中控技术	2,961,096.66	2.73
178	300037	新宙邦	2,946,197.02	2.71
179	002624	完美世界	2,932,580.29	2.70
180	603868	飞科电器	2,908,563.00	2.68
181	002249	大洋电机	2,900,572.00	2.67
182	603883	老百姓	2,894,288.00	2.67
183	002444	巨星科技	2,891,557.00	2.66
184	688099	晶晨股份	2,878,929.65	2.65
185	000400	许继电气	2,869,926.93	2.64
186	600486	扬农化工	2,863,719.00	2.64
187	300017	网宿科技	2,854,025.00	2.63
188	600498	烽火通信	2,847,763.00	2.62
189	300257	开山股份	2,842,275.00	2.62
190	300447	全信股份	2,830,498.00	2.61
191	300604	长川科技	2,819,386.00	2.60
192	002192	融捷股份	2,817,860.00	2.59
193	600027	华电国际	2,805,598.00	2.58
194	600271	航天信息	2,789,677.82	2.57
195	688006	杭可科技	2,776,479.86	2.56
196	000591	太阳能	2,750,757.00	2.53
197	603156	养元饮品	2,747,647.40	2.53
198	000559	万向钱潮	2,714,230.00	2.50
199	603228	景旺电子	2,700,863.00	2.49
200	603160	汇顶科技	2,666,601.00	2.46
201	600529	山东药玻	2,662,713.00	2.45
202	000932	华菱钢铁	2,653,292.00	2.44

203	002507	涪陵榨菜	2,641,662.16	2.43
204	600580	卧龙电驱	2,633,622.00	2.43
205	600885	宏发股份	2,630,383.00	2.42
206	603026	胜华新材	2,589,793.10	2.38
207	600299	安迪苏	2,589,575.00	2.38
208	300376	易事特	2,511,335.00	2.31
209	600415	小商品城	2,508,357.00	2.31
210	600377	宁沪高速	2,496,877.00	2.30
211	300251	光线传媒	2,494,562.00	2.30
212	000970	中科三环	2,487,799.00	2.29
213	002407	多氟多	2,463,377.40	2.27
214	001696	宗申动力	2,451,794.60	2.26
215	600637	东方明珠	2,448,122.00	2.25
216	603339	四方科技	2,447,766.00	2.25
217	000887	中鼎股份	2,439,632.00	2.25
218	688779	长远锂科	2,425,699.59	2.23
219	603712	七一二	2,421,188.00	2.23
220	002557	洽洽食品	2,404,656.00	2.21
221	300285	国瓷材料	2,384,438.00	2.20
222	300024	机器人	2,366,209.00	2.18
223	002683	广东宏大	2,356,302.00	2.17
224	000930	中粮科技	2,353,008.00	2.17
225	000975	银泰黄金	2,351,971.00	2.17
226	601928	凤凰传媒	2,347,708.00	2.16
227	000623	吉林敖东	2,337,020.88	2.15
228	603939	益丰药房	2,334,441.00	2.15
229	002299	圣农发展	2,326,290.00	2.14
230	300363	博腾股份	2,324,805.00	2.14
231	601128	常熟银行	2,318,818.00	2.14
232	002739	万达电影	2,292,432.50	2.11
233	600399	抚顺特钢	2,284,780.00	2.10
234	300001	特锐德	2,282,750.00	2.10
235	600258	首旅酒店	2,265,466.57	2.09
236	002701	奥瑞金	2,246,157.00	2.07
237	600376	首开股份	2,219,829.00	2.04
238	601611	中国核建	2,217,343.00	2.04
239	600155	华创云信	2,213,006.00	2.04
240	002368	太极股份	2,204,954.00	2.03
241	600728	佳都科技	2,188,360.00	2.02
242	601990	南京证券	2,184,470.00	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,504,021,796.40
卖出股票的收入（成交）总额	1,442,034,428.89

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）	170,646.40	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	170,646.40	0.10

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	127082	亚科转债	693	85,096.91	0.05
2	113669	景 23 转债	450	62,549.04	0.04
3	118036	力合转债	230	23,000.45	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1 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**

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	355,452.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,794.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	418,246.04

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票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

份额级别	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
华安中证 500 指数增强 A	720	107,993.29	51,186,527.44	65.83%	26,568,642.46	34.17%
华安中证 500 指数增强 C	8,125	13,456.88	41,763,284.76	38.20%	67,573,888.94	61.80%
合计	8,845	21,152.33	92,949,812.20	49.68%	94,142,531.40	50.32%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华安中证 500 指数增强 A	364,055.46	0.47%
	华安中证 500 指数增强 C	10.01	0.00%
	合计	364,065.47	0.19%

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

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 5 月 24 日）基金份额总额	133,507,750.06	176,250,841.84
本报告期期初基金份额总额	34,529,467.81	80,167,147.29

本报告期基金总申购份额	102,487,526.25	118,645,852.04
减：本报告期基金总赎回份额	59,261,824.16	89,475,825.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	77,755,169.90	109,337,173.70

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
广发证券	2	2,946,056,225.29	100.00%	917,111.54	100.00%	-

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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
广发证券	416,303.12	100.00%	-	-	-	-

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	华安中证 500 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	华安中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2023 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	2023-03-03
3	华安中证 500 指数增强型证券投资基金(华安中证 500 指数增强 A)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	2023-03-03
4	华安中证 500 指数增强型证券投资基金(华安中证 500 指数增强 C)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	2023-03-03
5	华安中证 500 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	华安中证 500 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

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

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
机构	1	20230113-202306 30	0.00	51,186 ,527.4 4	0.00	51,186,527. 44	27.36%
	2	20230116-202306 30	0.00	102,11 5,375.	60,352,0 91.18	41,763,284. 76	22.32%

				94			
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安中证 500 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中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，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