华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金)
2026 年中期报告

2026 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 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 2026 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
1.2 目录 3

§2 基金简介 6

2.1 基金基本情况（转型后） 6
2.1 基金基本情况（转型前） 6
2.2 基金产品说明（转型后） 7
2.2 基金产品说明（转型前） 7
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料(转型后) 8
2.5 其他相关资料(转型前) 9

§3 主要财务指标和基金净值表现 9

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后） 9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) 10
3.2 基金净值表现（转型后） 11
3.2 基金净值表现（转型前） 13

§4 管理人报告 16

4.1 基金管理人及基金经理情况 16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 21
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 21
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 22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 23
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 23
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 24
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 24

§5 托管人报告 24

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 24
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 24
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 24

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） 24

6.1 资产负债表 24
6.2 利润表 26
6.3 净资产变动表 27
6.4 报表附注 28

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） 57

6.1 资产负债表 57
6.2 利润表 58
6.3 净资产变动表 59
6.4 报表附注 61

§7 投资组合报告（转型后） 82

7.1 期末基金资产组合情况 82
7.2 期末投资目标基金明细 82
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合 83
7.4 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 83
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 83
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合 84
7.7 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 84
7.8 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 84
7.9 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 85
7.10 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 85
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 85
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 85
7.13 投资组合报告附注 85

§7 投资组合报告（转型前） 86

7.1 期末基金资产组合情况 86
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 86
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 87
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 88
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 90
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 90
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 90
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 90
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 90
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 90
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 91
7.12 投资组合报告附注 91

§8 基金份额持有人信息（转型后） 92

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 92
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 92
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情况 92
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 93

§8 基金份额持有人信息（转型前） 93

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 93
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 94
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情况 94
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 94

§9 开放式基金份额变动（转型后） 94

§9 开放式基金份额变动（转型前） 95

§10 重大事件揭示 95

10.1 基金份额持有人大会决议 95
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 95
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 96
10.4 基金投资策略的改变 96
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 96
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 96
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型后) 96
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型前) 99
10.8 其他重大事件 101

§11 影响投资者决策的其他重要信息 102

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（转型后） 102
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（转型前） 103

§12 备查文件目录 103

12.1 备查文件目录 103
12.2 存放地点 103
12.3 查阅方式 103

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接	
基金主代码	022083	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 3 月 18 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	899,092,599.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	022083	022084
报告期末下属分级基金的份额总额	379,580,360.82 份	519,512,238.66 份

2.1.1 目标基金基本情况（转型后）

基金名称	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512940
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 2 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2026 年 2 月 26 日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金
基金简称	华安中证有色金属矿业主题指数发起式
基金主代码	022083
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 9 月 26 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,380,449,374.43 份

基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	022083	022084
报告期末下属分级基金的份额总额	541,642,588.05 份	838,806,786.38 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、资产配置策略 2、目标 ETF 投资策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、股指期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 8、存托凭证投资策略 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证有色金属矿业主题指数收益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、完全复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证有色金属矿业主题指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、完全复制策略

	2、替代性策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、股指期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 8、存托凭证投资策略 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证有色金属矿业主题指数收益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66596688
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		徐勇	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告置备地点	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

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

§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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日	
	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C
本期已实现收益	-75,816,385.88	-111,391,804.60
本期利润	-90,251,371.69	-129,355,959.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1989	-0.1967
本期加权平均净值利润率	-10.10%	-10.03%
本期基金份额净值增长率	-10.57%	-10.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-28,336,186.43	-41,814,194.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0747	-0.0805
期末基金资产净值	688,303,298.47	938,005,651.63
期末基金份额净值	1.8133	1.8056
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.57%	-10.63%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 3 月 17 日)	
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C
本期已实现收益	2,736,672.70	3,413,328.68
本期利润	-56,282,346.55	-88,552,891.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1264	-0.1250
本期加权平均净值利润率	-5.76%	-5.71%
本期基金份额净值增长率	7.12%	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 3 月 17 日)	
期末可供分配利润	47,697,177.06	69,638,010.05
期末可供分配基金份额利润	0.0881	0.0830
期末基金资产净值	1,098,271,014.45	1,694,754,262.69
期末基金份额净值	2.0277	2.0204
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 3 月 17 日)	
基金份额累计净值增长率	102.77%	102.04%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2024 年 9 月 26 日成立，2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 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
过去三个月	-5.71%	2.72%	-5.74%	2.73%	0.03%	-0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-10.57%	2.77%	-10.45%	2.78%	-0.12%	-0.01%

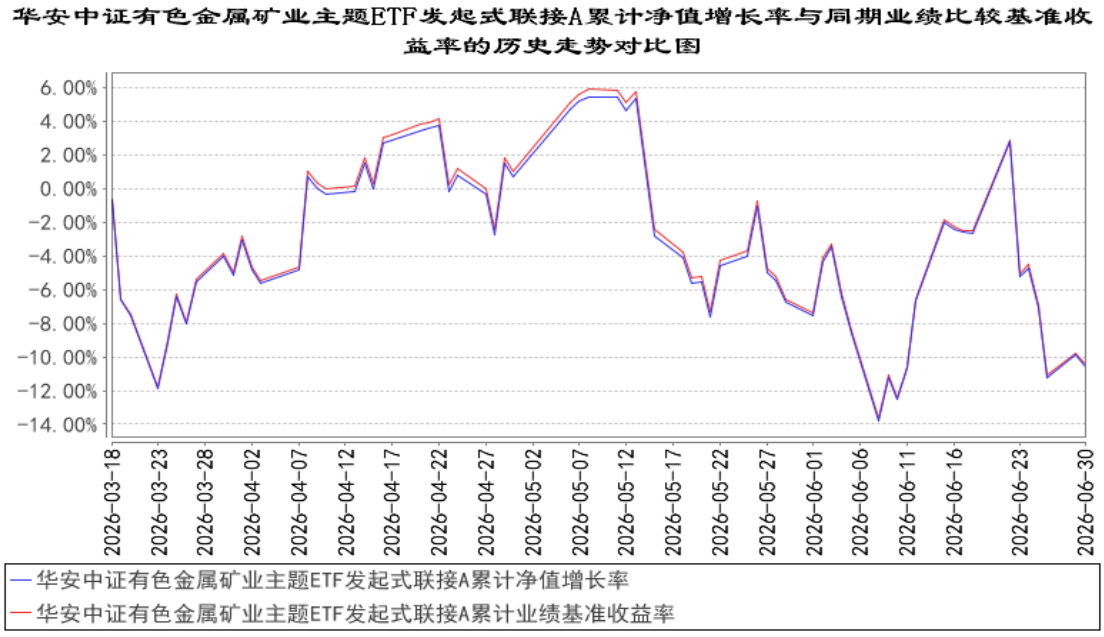
华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C

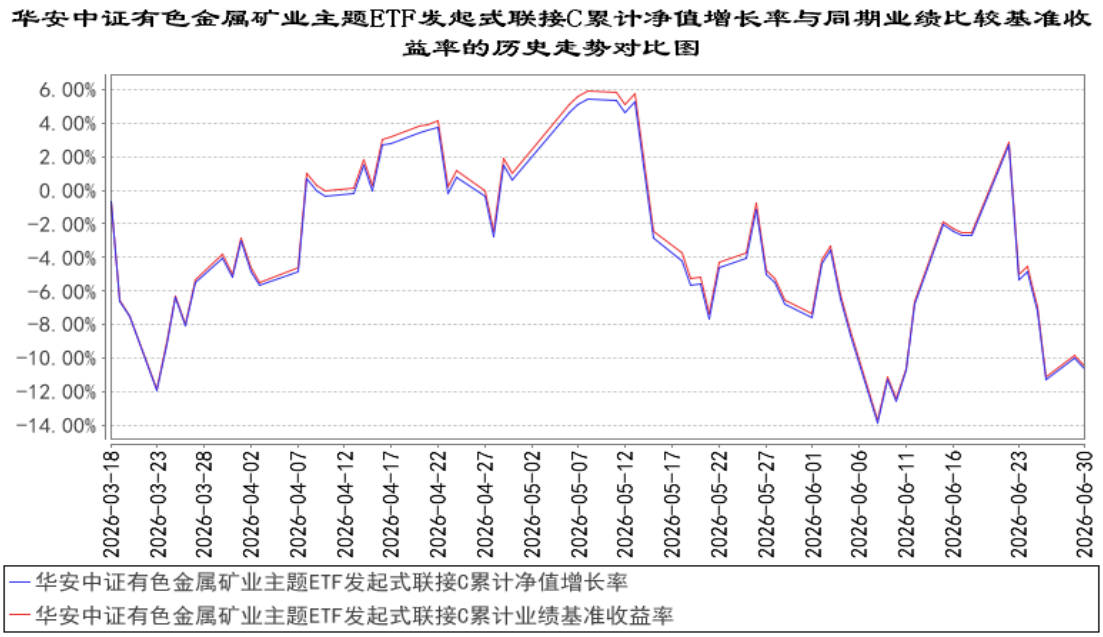
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.76%	2.72%	-5.74%	2.73%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-

过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-10.63%	2.77%	-10.45%	2.78%	-0.18%	-0.01%

注：原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

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





注：原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

华安中证有色金属矿业主题指数发起式 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
过去三个月（2025 年 12 月 18 日-2026 年 3 月 17 日）	15.03%	2.67%	19.03%	2.86%	-4.00%	-0.19%
过去六个月（2025 年 9 月 18 日-2026 年 3 月 17 日）	35.54%	2.49%	39.29%	2.65%	-3.75%	-0.16%
过去一年（2025 年 3 月 18 日-2026 年 3 月 17	90.48%	2.05%	93.37%	2.16%	-2.89%	-0.11%

日）						
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今（2024 年 9 月 26 日-2026 年 3 月 17 日）	102.77%	1.91%	123.15%	2.03%	-20.38%	-0.12%

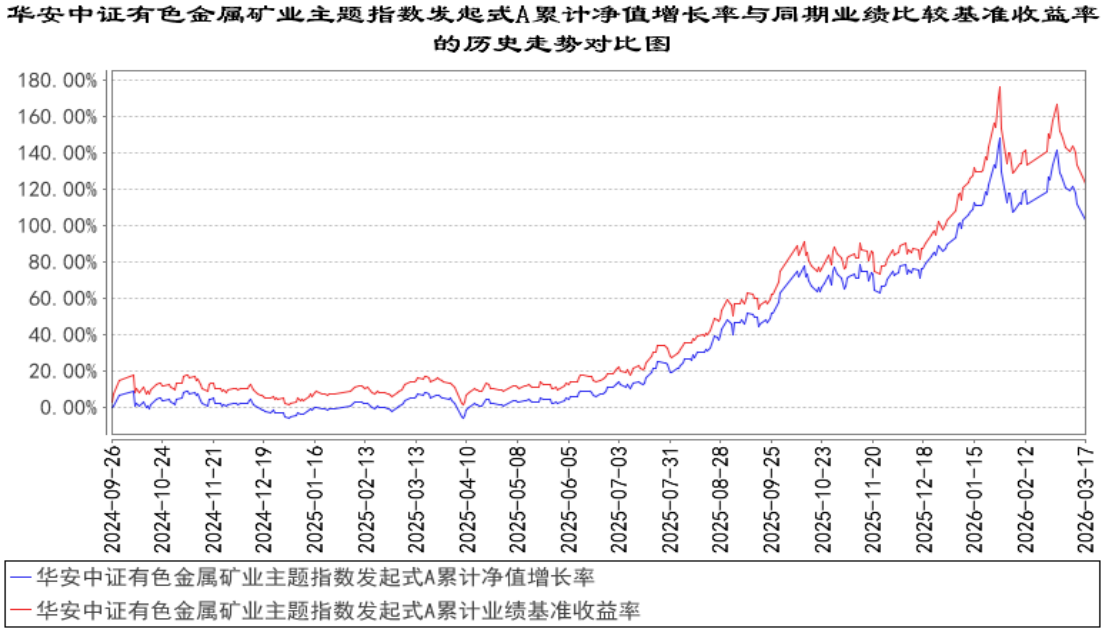
华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C

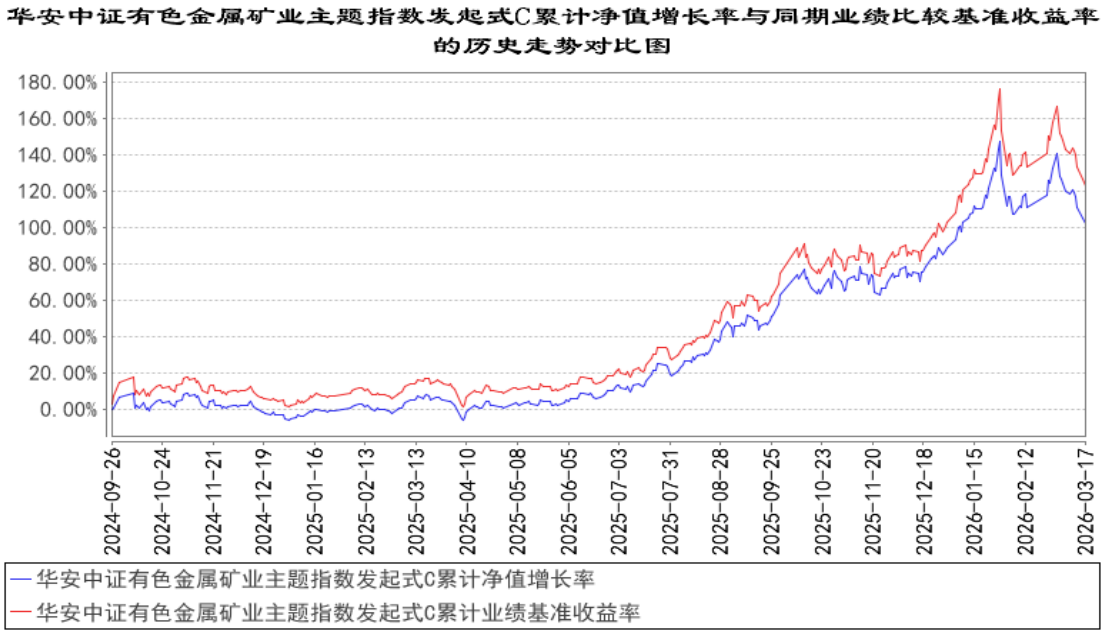
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月（2025 年 12 月 18 日-2026 年 3 月 17 日）	14.96%	2.68%	19.03%	2.86%	-4.07%	-0.18%
过去六个月（2025 年 9 月 18 日-2026 年 3 月 17 日）	35.37%	2.49%	39.29%	2.65%	-3.92%	-0.16%
过去一年（2025 年 3 月 18 日-2026 年 3 月 17 日）	90.01%	2.05%	93.37%	2.16%	-3.36%	-0.11%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效	102.04%	1.91%	123.15%	2.03%	-	-0.12%

起至今（2024 年 9 月 26 日-2026 年 3 月 17 日）					21.11%	

注：原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2024 年 9 月 26 日成立，2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

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





注：原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2024 年 9 月 26 日成立，2026 年

3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，截止本报告期末，本基金转型不满一年。

§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。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金 ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等 303 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,198.27 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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	首席指数投资官、公司总经理助理、指数与量化投资部高级总监、本基金的基金经理	2026 年 3 月 18 日	-	22 年	理学博士，22 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华

					安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）、华安中证银行指数型证券投资基金（由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金（由华安创业板 50 指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）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 月至 2025 年 1 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来）的基金经理。2019 年 12 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2023 年 11 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2025 年 6 月，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。2024 年 7 月至 2025 年 3 月，同时担任华安深证主板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月至 2026 年 3 月，同时担任华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金

					的基金经理。2026 年 3 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理（由华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金转型而来）。2024 年 11 月至 2024 年 12 月，同时担任华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。2024 年 11 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起，同时担任华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 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发起式联接基金的基金经理。2026 年 2 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
王超	本基金的基金经理	2026 年 4 月 7 日	-	12 年	硕士研究生，12 年基金行业从业经验，2014 年应届毕业加入华安基金，历任基金运营部基金会计，指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2025 年 3 月起，同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）及其联接基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、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。2025 年 8 月起，同时担任华安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起，同时担任华安国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月至 2025 年 12 月，同时担任华安恒生港股通科技主题指

					数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理（由华安恒生港股通科技主题指数型发起式证券投资基金转型而来）。2026 年 4 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安中证港股通信息技术综合交易型开放式指数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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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	首席指数投资官、公司总经理助理、指数与量化投资部高级总监、本基金的基金经理	2024 年 9 月 26 日	2026 年 3 月 17 日	22 年	理学博士，22 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于

					2021 年 1 月转型而来）、华安中证银行指数型证券投资基金（由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金（由华安创业板 50 指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）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 月至 2025 年 1 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来）的基金经理。2019 年 12 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2023 年 11 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2025 年 6 月，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。2024 年 7 月至 2025 年 3 月，同时担任华安深证主板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月至 2026 年 3 月，同时担任华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理（由华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金转型而来）。2024 年 11 月至 2024 年 12 月，同时担任华安中证 A500 指数型发起式证券投资基

					金的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。2024 年 11 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起，同时担任华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 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发起式联接基金的基金经理。2026 年 2 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，

由集中交易部对外进行申报。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比例分配原则进行分配。（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。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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 0 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

上半年，国内经济总体保持稳健，在外部冲击下展现出较强韧性，内需修复节奏放缓，外需出口保持高增长。股票市场来看，前期在地缘扰动、风险偏好下降等因素作用下，行业分化较为明显，能源、海运、通信设备等顺周期主线表现亮眼，成长板块压力较大，大盘整体呈现下行趋势。进入 4 月后，在地缘相对缓和，海外资本开支高增带动 AI 硬件板块表现强势，大盘在科技的带动下逐步走出趋势性行情。具体到有色板块来看，1 月在金价的带动下有色板块强势上扬，但后期美联储政策路径反复，地缘政治冲突原油价格高使得市场担忧加息风险，以及各类金属供需之间结构性分化等因素作用，贵金属价格波动变大，工业金属也阶段性承压，板块波动显著放大，进入震荡下行阶段，整体上半年表现弱于大市。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金于 2026 年 03 月 18 日转型。转型后截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.8133 元，C 类份额净值为 1.8056 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-10.57%，同期业绩比较基准增长率为-10.45%，C 类份额净值增长率为-10.63%，同期业绩比较基准增长率为-10.45%。

转型前截至 2026 年 03 月 17 日，本基金 A 类份额净值为 2.0277 元，C 类份额净值为 2.0204 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 7.12%，同期业绩比较基准增长率为 9.85%，C 类份额净值增长率为 7.06%，同期业绩比较基准增长率为 9.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济具备韧性，高层重提“加大逆周期调节”叠加十五五开局的背景下，下半年增量政策或可期，流动性保持合理宽松。海外来看，随着地缘冲突缓和，美国通胀或逐步回落，就业前瞻性数据显示存在走弱空间，后续市场存在加息预期回摆可能。全球 PMI 仍处在扩张区间。金价经过大幅调整后进入震荡区间，全球铜供需仍然维持紧平衡，AI 需求带动部分小金属，有色板块或进入配置区间，但地缘不稳定性，美联储加息预期扰动或增加板块的波动。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人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、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、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

本基金为发起式证券投资基金。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	115,910,471.61
结算备付金		2,439,641.54

存出保证金		2,217,784.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,538,230,645.80
其中：股票投资		-
基金投资		1,538,119,644.10
债券投资		111,001.70
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	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		15,123,801.64
应收股利		-
应收申购款		5,961,718.47
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,679,884,063.15
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		51,948,955.71
应付管理人报酬		114,643.00
应付托管费		22,928.59
应付销售服务费		216,651.90
应付投资顾问费		-
应交税费		0.05
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	1,271,933.80
负债合计		53,575,113.05
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	899,092,599.48
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	727,216,350.62

净资产合计		1,626,308,950.10
负债和净资产总计		1,679,884,063.15

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 899,092,599.48 份，其中 A 类基金份额净值 1.8133 元，基金份额总额 379,580,360.82 份；C 类基金份额净值 1.8056 元，基金份额总额 519,512,238.66 份。

（2）原华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金于 2026 年 3 月 18 日转型为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

6.2 利润表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-216,917,212.26
1.利息收入		158,342.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	158,342.67
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-185,512,323.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-187,386,093.97
基金投资收益	6.4.7.11	-68,321.44
债券投资收益	6.4.7.12	1.65
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,942,089.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-32,399,140.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	835,909.33
减：二、营业总支出		2,690,118.49

1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,418,822.02
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	283,764.40
3．销售服务费	6.4.10.2.3	926,451.34
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	6.4.7.19	-
7．税金及附加		-
8．其他费用	6.4.7.20	61,080.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-219,607,330.75
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-219,607,330.75
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-219,607,330.75

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,380,449,374.43	-	1,412,575,902.71	2,793,025,277.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-481,356,774.95	-	-685,359,552.09	-1,166,716,327.04
（一）、综合收益总额	-	-	-219,607,330.75	-219,607,330.75

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-481,356,774.95	-	-465,752,221.34	-947,108,996.29
其中：1.基金申购款	673,691,117.84	-	644,822,461.71	1,318,513,579.55
2.基金赎回款	-1,155,047,892.79	-	-1,110,574,683.05	-2,265,622,575.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	899,092,599.48	-	727,216,350.62	1,626,308,950.10

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：

徐勇	任志浩	童欣
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金（以下简称“原基金”），系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[2024]785 号《关于准予华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。原基金基金合同于 2024 年 9 月 26 日生效，首次设立募集规模为 10,000,000.00 份基金份额。

根据基金管理人华安基金管理有限公司于 2026 年 3 月 18 日发布的《华安基金管理有限公司关于华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金变更为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，原基金变更为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”），《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及其他法律文件自 2026 年 3 月 18 日起生效，原《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新的招募说明书》，本基金根据是否收取申购费和销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标 ETF”）的联接基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》和《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证），把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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，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、存出保证金和应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，履行适当程序后本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证有色金属矿业主题指数收益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，

只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类

别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对 A 类和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式；

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可调整基金收益的分配原则。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假

设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，本基金对于目标 ETF 投资，按目标 ETF 估值日的份额净值估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司

（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	115,910,471.61
等于：本金	115,899,678.61
加：应计利息	10,793.00
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	115,910,471.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	111,000.00	1.70	111,001.70	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	111,000.00	1.70	111,001.70	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,664,887,489.21	-	1,538,119,644.10	- 126,767,845.11
其他		-	-	-	-
合计		1,664,998,489.21	1.70	1,538,230,645.80	- 126,767,845.11

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,438.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,182,160.75
其中：交易所市场	1,182,160.75

银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	20,827.67
预提信息披露费	59,507.37
合计	1,271,933.80

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	541,642,588.05	541,642,588.05
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	189,347,157.30	189,347,157.30
本期赎回（以“-”号填列）	-351,409,384.53	-351,409,384.53
本期末	379,580,360.82	379,580,360.82

华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	838,806,786.38	838,806,786.38
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 3 月 18 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-

本期申购	484,343,960.54	484,343,960.54
本期赎回（以“-”号填列）	-803,638,508.26	-803,638,508.26
本期末	519,512,238.66	519,512,238.66

注： 申购含红利再投、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

华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	47,697,177.06	508,931,249.34	556,628,426.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	47,697,177.06	508,931,249.34	556,628,426.40
本期利润	-75,816,385.88	-14,434,985.81	-90,251,371.69
本期基金份额交易产生的变动数	-216,977.61	-157,437,139.45	-157,654,117.06
其中：基金申购款	-1,992,232.49	184,476,380.59	182,484,148.10
基金赎回款	1,775,254.88	-341,913,520.04	-340,138,265.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,336,186.43	337,059,124.08	308,722,937.65

华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	69,638,010.05	786,309,466.26	855,947,476.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	69,638,010.05	786,309,466.26	855,947,476.31
本期利润	-111,391,804.60	-17,964,154.46	-129,355,959.06
本期基金份额交易产生的变动数	-60,400.34	-308,037,703.94	-308,098,104.28
其中：基金申购款	-7,730,707.72	470,069,021.33	462,338,313.61
基金赎回款	7,670,307.38	-778,106,725.27	-770,436,417.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,814,194.89	460,307,607.86	418,493,412.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	152,267.82
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	3,968.85

其他	2,106.00
合计	158,342.67

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 2026年3月18日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-187,386,093.97
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	-187,386,093.97

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 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,551,361,912.86
减：卖出股票成本总额	2,736,808,860.50
减：交易费用	1,939,146.33
买卖股票差价收入	-187,386,093.97

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	26,914.40
减：卖出/赎回基金成本总额	28,635.29
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	66,600.55
基金投资收益	-68,321.44

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年3月18日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1.65

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,942,089.77
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	1,942,089.77

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-32,399,140.27
股票投资	94,368,704.84
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-126,767,845.11
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	-32,399,140.27

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	721,535.15
基金转换费收入	114,374.18
合计	835,909.33

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,082.35
信息披露费	34,520.85
证券出借违约金	-
银行汇划费	14,477.53
合计	61,080.73

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、关联关系

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”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金是该基金的联接基金

注：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）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 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通证券股份有限公司	124,687,196.82	4.89

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）

国泰海通证券股份有限公司	84,544,468.20	5.08

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年3月18日（基金合同生效日）至2026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（%）
国泰海通证券股份有限公司	24,426.91	4.89	311,128.41	26.32

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,418,822.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,626,038.26
应支付基金管理人的净管理费	-207,216.24

注：（1）本基金投资目标 ETF 部分不收取管理费。在通常情况下，本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若

为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

（2）由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，故出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	283,764.40

注：本基金投资目标 ETF 部分不收取托管费。在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 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 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	-	1,088.79	1,088.79
华安基金管理有限公司	-	9,213.98	9,213.98
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	10,302.77	10,302.77

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×C 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（ 2026 年 3 月 18 日）持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.00%	0.11%

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 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 2026 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	115,910,471.61	152,267.82

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有 1,863,258,200.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 85.17%。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 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：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
110101	宝钛转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	1,110	111,000.00	111,001.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。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。本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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、审计委员会、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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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未来现金流量因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的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对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	115,910,471.61	-	-	-	115,910,471.61
结算备付金	2,439,641.54	-	-	-	2,439,641.54
存出保证金	2,217,784.09	-	-	-	2,217,784.09
交易性金融资产	111,001.70	-	-	1,538,119,644.10	1,538,230,645.80
应收申购款	-	-	-	5,961,718.47	5,961,718.47
应收清算款	-	-	-	15,123,801.64	15,123,801.64
资产总计	120,678,898.94	-	-	1,559,205,164.	1,679,884,063.15

				21	
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,948,955.71	51,948,955.71
应付管理人报酬	-	-	-	114,643.00	114,643.00
应付托管费	-	-	-	22,928.59	22,928.59
应付销售服务费	-	-	-	216,651.90	216,651.90
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	1,271,933.80	1,271,933.80
负债总计	-	-	-	53,575,113.05	53,575,113.05
利率敏感度缺口	120,678,898.94	-	-	1,505,630,051.16	1,626,308,950.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的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 2026 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 0.01%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，追求对业绩比较基准的紧密跟踪。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金,存出保证金,应收申购款等。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	-	-
交易性金融资产－基金投资	1,538,119,644.10	94.58
交易性金融资产－债券投资	111,001.70	0.01
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	1,538,230,645.80	94.58

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

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 （2026 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	80,913,635.51
	业绩比较基准下降 5%	-80,913,635.51

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	1,538,119,644.10
第二层次	111,001.70
第三层次	-
合计	1,538,230,645.80

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若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 08 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 3 月 17 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 3 月 17 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	221,617,660.99	197,768,438.88
结算备付金		1,116,537.53	230,657.22
存出保证金		1,655,941.81	125,011.23
交易性金融资产	6.4.7.2	2,642,440,155.66	709,095,015.77
其中：股票投资		2,642,440,155.66	709,095,015.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		71,488,132.75	-
应收股利		-	-
应收申购款		41,851,142.20	58,497,837.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,980,169,570.94	965,716,960.13
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 3 月 17 日**	**上年度末 2025 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		-	158,213,360.95
应付赎回款		185,294,985.57	21,925,018.84

应付管理人报酬		724,619.02	166,349.21
应付托管费		144,923.81	33,269.84
应付销售服务费		220,839.10	50,071.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	758,926.30	201,387.19
负债合计		187,144,293.80	180,589,457.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,380,449,374.43	415,557,101.13
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,412,575,902.71	369,570,401.36
净资产合计		2,793,025,277.14	785,127,502.49
负债和净资产总计		2,980,169,570.94	965,716,960.13

注：（1）报告截止日 2026 年 3 月 17 日，基金份额总额 1,380,449,374.43 份，其中 A 类基金份额净值 2.0277 元，基金份额总额 541,642,588.05 份；C 类基金份额净值 2.0204 元，基金份额总额 838,806,786.38 份。

（2）本基金基金合同于 2024 年 9 月 26 日生效。

6.2 利润表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-140,892,209.90	2,052,590.60
1.利息收入		183,353.77	2,196.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	183,353.77	2,196.82
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,716,766.48	325,849.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,239,710.45	137,633.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-

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	-	-
股利收益	6.4.7.15	477,056.03	188,215.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-150,985,238.93	1,711,884.96
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	6,192,908.78	12,659.72
减：二、营业总支出		3,943,027.65	55,199.16
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,589,940.56	35,574.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	517,988.10	7,114.94
3．销售服务费	6.4.10.2.3	793,310.89	5,373.05
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	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.19	41,788.10	7,136.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-144,835,237.55	1,997,391.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-144,835,237.55	1,997,391.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-144,835,237.55	1,997,391.44

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	415,557,101.13	-	369,570,401.36	785,127,502.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	415,557,101.13	-	369,570,401.36	785,127,502.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	964,892,273.30	-	1,043,005,501.35	2,007,897,774.65
（一）、综合收益总额	-	-	-144,835,237.55	-144,835,237.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	964,892,273.30	-	1,187,840,738.90	2,152,733,012.20
其中：1.基金申购款	2,493,138,771.21	-	2,999,217,766.26	5,492,356,537.47
2.基金赎回款	-1,528,246,497.91	-	-1,811,377,027.36	-3,339,623,525.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,380,449,374.43	-	1,412,575,902.71	2,793,025,277.14

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,061,306.63	-	-497,663.71	9,563,642.92
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,061,306.63	-	-497,663.71	9,563,642.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,929,615.25	-	2,347,780.33	9,277,395.58
（一）、综合收益总额	-	-	1,997,391.44	1,997,391.44
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,929,615.25	-	350,388.89	7,280,004.14
其中：1.基金申购款	23,468,152.11	-	991,829.15	24,459,981.26
2.基金赎回款	-16,538,536.86	-	-641,440.26	-17,179,977.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	16,990,921.88	-	1,850,116.62	18,841,038.50

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：

徐勇	任志浩	童欣
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证

券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]785 号《关于准予华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2024 年 9 月 26 日生效，首次设立募集规模为 10,000,000.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书》，本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》和《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 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，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、存出保证金和应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，履行适当程序后本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证有色金属矿业主题指数收

益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 3 月 17 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 3 月 17 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 3 月 17 日
活期存款	221,617,660.99
等于：本金	221,435,477.84
加：应计利息	182,183.15
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	221,617,660.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 3 月 17 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,736,808,860.50	-	2,642,440,155.66	-94,368,704.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,736,808,860.50	-	2,642,440,155.66	-94,368,704.84

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 2026 年 3 月 17 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	807.10
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	682,387.36
其中：交易所市场	682,387.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	50,745.32
预提信息披露费	24,986.52
合计	758,926.30

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,919,631.74	150,919,631.74
本期申购	849,931,088.89	849,931,088.89
本期赎回（以“-”号填列）	-459,208,132.58	-459,208,132.58
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	541,642,588.05	541,642,588.05

华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	264,637,469.39	264,637,469.39
本期申购	1,643,207,682.32	1,643,207,682.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,069,038,365.33	-1,069,038,365.33
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	838,806,786.38	838,806,786.38

注：申购含红利再投、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

华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,500,182.48	122,276,026.59	134,776,209.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,500,182.48	122,276,026.59	134,776,209.07
本期利润	2,736,672.70	-59,019,019.25	-56,282,346.55
本期基金份额交易产生的变动数	32,460,321.88	445,674,242.00	478,134,563.88
其中：基金申购款	71,659,638.24	953,550,025.85	1,025,209,664.09
基金赎回款	-39,199,316.36	-507,875,783.85	-547,075,100.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,697,177.06	508,931,249.34	556,628,426.40

华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,876,907.16	213,917,285.13	234,794,192.29
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	20,876,907.16	213,917,285.13	234,794,192.29
本期利润	3,413,328.68	-91,966,219.68	-88,552,891.00
本期基金份额交易产生的变动数	45,347,774.21	664,358,400.81	709,706,175.02
其中：基金申购款	131,893,486.91	1,842,114,615.26	1,974,008,102.17
基金赎回款	-86,545,712.70	-1,177,756,214.45	-1,264,301,927.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,638,010.05	786,309,466.26	855,947,476.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
活期存款利息收入	176,938.07
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	5,654.48
其他	761.22
合计	183,353.77

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 2026年1月1日至2026年3月17日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,239,710.45
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	3,239,710.45

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
卖出股票成交总额	701,754,511.24
减：卖出股票成本总额	697,258,232.04
减：交易费用	1,256,568.75
买卖股票差价收入	3,239,710.45

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
股票投资产生的股利收益	477,056.03
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	477,056.03

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
1.交易性金融资产	-150,985,238.93
股票投资	-150,985,238.93
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2.衍生工具	-
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	-150,985,238.93

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
基金赎回费收入	6,091,112.29
基金转换费收入	101,796.49
合计	6,192,908.78

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日
审计费用	8,745.32
信息披露费	24,986.52
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,056.26
合计	41,788.10

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

根据《华安基金管理有限公司关于华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金变更为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2026 年 3 月 18 日起，本基金变更为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及其他法律文件自 2026 年 3 月 18 日起生效，原《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

6.4.9 关联方、关联关系

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”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司(“国泰海通”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人

注:(1)关联方国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通”)是由原国泰君安证券股份有限公司与原海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

(2)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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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(%)
国泰海通证券股份有限公司	1,463,475,779.55	42.01	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 2026年1月1日至2026年3月17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（%）
国泰海通证券股份有限公司	286,701.50	42.01	286,701.50	42.01
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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（%）
-	-	-	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,589,940.56	35,574.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,150,067.61	4,176.75
应支付基金管理人的净管理费	1,439,872.95	31,398.14

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025

	月 17 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	517,988.10	7,114.94

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	-	723.62	723.62
华安基金管理有限公司	-	8,882.36	8,882.36
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	9,605.98	9,605.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	合计
华安基金管理有限公司	-	1,347.69	1,347.69
中国银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	1,347.69	1,347.69

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×C 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日	
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C
报告期初持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.65%	0.07%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C
报告期初持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆	-	-

分变动份额		
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,000,000.00	1,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	52.97%	5.89%

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 17 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国银行	221,617,660.99	176,938.07	1,481,806.04	2,061.44

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 3 月 17 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险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。本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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、审计委员会、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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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未来现金流量因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的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对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 3 月 17 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	221,617,660.99	-	-	-	221,617,660.99
结算备付金	1,116,537.53	-	-	-	1,116,537.53
存出保证金	1,655,941.81	-	-	-	1,655,941.81
交易性金融资产	-	-	-	2,642,440,155.66	2,642,440,155.66
应收申购款	-	-	-	41,851,142.20	41,851,142.20
应收清算款	-	-	-	71,488,132.75	71,488,132.75
资产总计	224,390,140.33	-	-	2,755,779,430.61	2,980,169,570.94

负债					
应付赎回款	-	-	-	185,294,985.57	185,294,985.57
应付管理人报酬	-	-	-	724,619.02	724,619.02
应付托管费	-	-	-	144,923.81	144,923.81
应付销售服务费	-	-	-	220,839.10	220,839.10
其他负债	-	-	-	758,926.30	758,926.30
负债总计	-	-	-	187,144,293.80	187,144,293.80
利率敏感度缺口	224,390,140.33	-	-	2,568,635,136.81	2,793,025,277.14
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	197,768,438.88	-	-	-	197,768,438.88
结算备付金	230,657.22	-	-	-	230,657.22
存出保证金	125,011.23	-	-	-	125,011.23
交易性金融资产	-	-	-	709,095,015.77	709,095,015.77
应收申购款	-	-	-	58,497,837.03	58,497,837.03
资产总计	198,124,107.33	-	-	767,592,852.80	965,716,960.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,925,018.84	21,925,018.84
应付管理人报酬	-	-	-	166,349.21	166,349.21
应付托管费	-	-	-	33,269.84	33,269.84
应付清算款	-	-	-	158,213,360.95	158,213,360.95
应付销售服务费	-	-	-	50,071.61	50,071.61
其他负债	-	-	-	201,387.19	201,387.19
负债总计	-	-	-	180,589,457.64	180,589,457.64
利率敏感度缺口	198,124,107.33	-	-	587,003,395.16	785,127,502.49

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的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 2026 年 03 月 17 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 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。

本基金主要采取完全复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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 2026 年 3 月 17 日		上年度末 2025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	2,642,440,155.66	94.61	709,095,015.77	90.32
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	2,642,440,155.66	94.61	709,095,015.77	90.32

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（2026 年 3 月 17 日）	上年度末 （2025 年 12 月

			31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	76,147,051.31	37,452,729.98
	业绩比较基准下降 5%	-76,147,051.31	-37,452,729.98

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 2026 年 3 月 17 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2,642,440,155.66	709,095,015.77
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	2,642,440,155.66	709,095,015.77

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若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 08 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,538,119,644.10	91.56
3	固定收益投资	111,001.70	0.01
	其中：债券	111,001.70	0.01
	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	118,350,113.15	7.05
8	其他各项资产	23,303,304.20	1.39
9	合计	1,679,884,063.15	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	华安基金管理有限公司	1,538,119,644.10	94.58

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.4 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	231,288,021.68	14.22
2	603993	洛阳钼业	213,962,677.43	13.16
3	600111	北方稀土	164,281,791.63	10.10
4	601600	中国铝业	119,887,284.56	7.37
5	603799	华友钴业	117,990,166.48	7.26
6	002460	赣锋锂业	112,591,375.33	6.92
7	600489	中金黄金	97,503,223.78	6.00
8	600549	厦门钨业	86,474,124.00	5.32
9	600547	山东黄金	86,466,627.15	5.32
10	600988	赤峰黄金	83,697,462.31	5.15
11	000807	云铝股份	83,404,152.03	5.13
12	002466	天齐锂业	83,008,003.91	5.10
13	000426	兴业银锡	77,843,486.59	4.79
14	002738	中矿资源	69,097,442.20	4.25
15	000657	中钨高新	69,057,947.56	4.25
16	000630	铜陵有色	66,337,764.00	4.08
17	600362	江西铜业	62,106,762.00	3.82
18	601168	西部矿业	61,993,652.00	3.81

19	002532	天山铝业	59,836,190.62	3.68
20	000975	山金国际	59,692,362.65	3.67
21	000831	中国稀土	49,941,007.66	3.07
22	000960	锡业股份	46,201,158.20	2.84
23	002428	云南锗业	45,508,954.12	2.80
24	600392	盛和资源	45,087,310.43	2.77
25	002155	湖南黄金	41,249,255.80	2.54
26	600497	驰宏锌锗	35,497,995.00	2.18
27	002756	永兴材料	34,950,605.04	2.15
28	000878	云南铜业	33,266,507.59	2.05

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。

7.5.3 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

买入股票成本（成交）总额	-
卖出股票收入（成交）总额	2,551,361,912.86

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。

7.6 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）	111,001.70	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,001.70	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	110101	宝钛转债	1,110	111,001.70	0.01

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12.2 本期国债期货投资评价

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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

7.13.3 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	2,217,784.09
2	应收清算款	15,123,801.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,961,718.47
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,303,304.20

7.13.4 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。

7.13.5 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。

§7 投资组合报告（转型前）

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	2,642,440,155.66	88.67
	其中：股票	2,642,440,155.66	88.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	222,734,198.52	7.47
8	其他各项资产	114,995,216.76	3.86
9	合计	2,980,169,570.94	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,126,399,556.86	40.33
C	制造业	1,516,040,598.80	54.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储	-	-

	和邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,642,440,155.66	94.61

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	7,116,700	248,372,830.00	8.89
2	603993	洛阳钼业	11,501,800	223,364,956.00	8.00
3	600111	北方稀土	3,333,900	163,361,100.00	5.85
4	601600	中国铝业	10,443,312	135,971,922.24	4.87
5	603799	华友钴业	1,998,600	123,633,396.00	4.43
6	600489	中金黄金	3,831,518	112,378,422.94	4.02
7	600547	山东黄金	2,380,688	105,940,616.00	3.79
8	002460	赣锋锂业	1,487,849	101,902,778.01	3.65
9	600988	赤峰黄金	2,191,900	87,697,919.00	3.14
10	000807	云铝股份	2,741,000	87,465,310.00	3.13
11	600549	厦门钨业	1,464,200	86,534,220.00	3.10

12	000426	兴业银锡	1,871,208	83,661,709.68	3.00
13	002466	天齐锂业	1,362,116	70,979,864.76	2.54
14	000630	铜陵有色	10,599,500	69,850,705.00	2.50
15	002738	中矿资源	950,560	69,523,958.40	2.49
16	000975	山金国际	2,195,300	67,132,274.00	2.40
17	600362	江西铜业	1,366,900	66,321,988.00	2.37
18	002532	天山铝业	3,677,839	64,435,739.28	2.31
19	000657	中钨高新	1,200,800	64,302,840.00	2.30
20	601168	西部矿业	2,197,900	61,563,179.00	2.20
21	000831	中国稀土	978,725	49,317,952.75	1.77
22	000960	锡业股份	1,301,164	45,735,914.60	1.64
23	002155	湖南黄金	1,441,040	45,464,812.00	1.63
24	600392	盛和资源	1,847,380	44,244,751.00	1.58
25	000878	云南铜业	1,786,211	37,188,913.02	1.33
26	600497	驰宏锌锗	3,984,700	36,101,382.00	1.29
27	002716	湖南白银	2,604,200	34,505,650.00	1.24
28	601212	白银有色	3,901,900	34,258,682.00	1.23
29	002756	永兴材料	497,020	32,723,796.80	1.17
30	002428	云南锗业	688,400	27,632,376.00	0.99
31	000060	中金岭南	4,096,600	27,488,186.00	0.98
32	601958	金钼股份	1,275,102	26,930,154.24	0.96
33	601020	华钰矿业	863,900	26,608,120.00	0.95
34	600301	华锡有色	333,200	18,326,000.00	0.66
35	000737	北方铜业	1,255,100	18,186,399.00	0.65
36	600456	宝钛股份	377,437	13,399,013.50	0.48
37	601069	西部黄金	360,400	12,289,640.00	0.44
38	002167	东方锆业	817,108	10,973,760.44	0.39
39	002978	安宁股份	186,700	6,668,924.00	0.24

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601899	紫金矿业	267,311,014.50	34.05
2	603993	洛阳钼业	264,228,951.16	33.65
3	600111	北方稀土	167,098,457.04	21.28
4	603799	华友钴业	146,347,784.92	18.64
5	601600	中国铝业	140,426,214.64	17.89
6	600547	山东黄金	114,868,341.48	14.63
7	600489	中金黄金	114,640,682.76	14.60

8	002460	赣锋锂业	100,313,932.20	12.78
9	000426	兴业银锡	99,168,254.17	12.63
10	000807	云铝股份	89,741,486.99	11.43
11	600549	厦门钨业	81,810,222.34	10.42
12	600988	赤峰黄金	80,933,539.71	10.31
13	002738	中矿资源	79,982,027.80	10.19
14	600362	江西铜业	79,024,837.22	10.07
15	002466	天齐锂业	77,132,743.47	9.82
16	000630	铜陵有色	72,066,635.00	9.18
17	601168	西部矿业	68,705,223.71	8.75
18	000975	山金国际	67,509,939.32	8.60
19	002532	天山铝业	66,705,560.99	8.50
20	000657	中钨高新	51,803,894.64	6.60
21	000831	中国稀土	51,630,550.97	6.58
22	000960	锡业股份	49,963,571.46	6.36
23	002155	湖南黄金	48,326,728.71	6.16
24	600392	盛和资源	45,375,584.40	5.78
25	000878	云南铜业	40,405,598.06	5.15
26	600497	驰宏锌锗	36,706,866.00	4.68
27	601212	白银有色	31,488,654.00	4.01
28	002716	湖南白银	30,215,669.40	3.85
29	000060	中金岭南	28,995,335.00	3.69
30	601020	华钰矿业	28,335,262.76	3.61
31	002756	永兴材料	26,438,017.70	3.37
32	002428	云南锗业	25,544,181.36	3.25
33	601958	金钼股份	25,261,973.02	3.22
34	000737	北方铜业	20,492,767.00	2.61
35	600301	华锡有色	17,403,141.00	2.22

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	601899	紫金矿业	69,052,959.35	8.80
2	603993	洛阳钼业	66,011,189.70	8.41
3	600111	北方稀土	42,275,501.30	5.38
4	603799	华友钴业	35,424,579.80	4.51
5	601600	中国铝业	35,350,851.00	4.50
6	600489	中金黄金	30,415,781.50	3.87
7	600547	山东黄金	28,413,011.57	3.62
8	002460	赣锋锂业	26,023,318.80	3.31

9	000426	兴业银锡	24,807,376.00	3.16
10	000807	云铝股份	23,107,071.44	2.94
11	600549	厦门钨业	21,310,024.01	2.71
12	600988	赤峰黄金	21,286,325.00	2.71
13	002738	中矿资源	19,839,924.00	2.53
14	600362	江西铜业	19,594,522.38	2.50
15	000630	铜陵有色	19,349,569.00	2.46
16	002466	天齐锂业	18,703,224.00	2.38
17	601168	西部矿业	17,868,200.00	2.28
18	002532	天山铝业	17,255,342.52	2.20
19	000975	山金国际	17,173,894.00	2.19
20	000657	中钨高新	15,152,988.00	1.93

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,781,588,610.86
卖出股票收入（成交）总额	701,754,511.24

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	1,655,941.81
2	应收清算款	71,488,132.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,851,142.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,995,216.76

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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（转型后）

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（%）
华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	72,383	5,244.05	9,676,594.09	2.55	369,903,766.73	97.45
华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C	115,344	4,504.02	3,484,003.45	0.67	516,028,235.21	99.33
合计	187,727	4,789.36	13,160,597.54	1.46	885,932,001.94	98.54

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	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	378,530.48	0.10
	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C	79,948.49	0.02
	合计	458,478.97	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情况

项目	份额级别	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	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	0~10
	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	0~10
	华安中证有色金属矿业主	-

	题 ETF 发起式联接 C	
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.11	10,000,000.00	1.11	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.11	10,000,000.00	1.11	-

§8 基金份额持有人信息（转型前）

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（%）
华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	115,043	4,708.18	9,613,702.17	1.77	532,028,885.88	98.23
华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	209,018	4,013.08	3,249,716.05	0.39	835,557,070.33	99.61
合计	324,061	4,259.84	12,863,418.22	0.93	1,367,585,956.21	99.07

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	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	453,445.56	0.08
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	130,566.63	0.02
	合计	584,012.19	0.04

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情况

项目	份额级别	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	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	0~10
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	0~10
	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C	-
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.72	10,000,000.00	0.72	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.72	10,000,000.00	0.72	-

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A	华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2026 年 3 月 18 日）基金份额总额	541,642,588.05	838,806,786.38
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	189,347,157.30	484,343,960.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	351,409,384.53	803,638,508.26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	379,580,360.82	519,512,238.66

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 A	华安中证有色金属矿业主题指数发起式 C
基金合同生效日（2024 年 9 月 26 日）基金份额总额	9,000,000.00	1,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	150,919,631.74	264,637,469.39
本报告期基金总申购份额	849,931,088.89	1,643,207,682.32
减：本报告期基金总赎回份额	459,208,132.58	1,069,038,365.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	541,642,588.05	838,806,786.38

§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：

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生离任本基金管理人的总经理，方一天先生新任本基金管理人的总经理。

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，严涛先生新任本基金管理人的首席市场官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型后)

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
国信证券	1	1,204,609,867	47.21	235,959.82	47.21	-

		.96				
平安证券	1	743,692,445.59	29.15	145,681.65	29.15	-
申万宏源	1	272,090,553.72	10.66	53,300.19	10.66	-
招商证券	5	196,206,302.47	7.69	38,432.25	7.69	-
国泰海通	4	124,687,196.82	4.89	24,426.91	4.89	-
华泰证券	1	10,075,546.30	0.39	1,972.57	0.39	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

（1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；

（2）提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持；

（3）交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

（1）证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

（2）证券公司的准入评估

对证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

（3）证券公司的审批程序

公司领导对证券公司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

基金管理人与证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：招商证券（64684）。

撤销交易单元的证券公司：无。

10.7.2 基金租用或者通过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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-	1,162,935,410.40	69.85
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	111,000.00	100.00	-	-	-	-	415,563,169.60	24.96
国泰海通	-	-	-	-	-	-	84,544,468.20	5.08
华泰	-	-	-	-	-	-	1,899,990.70	0.11

证券								
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况(转型前)

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	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(%)	
国泰海通	4	1,463,475,779.55	42.01	286,701.50	42.01	-
平安证券	1	877,513,178.11	25.19	171,907.88	25.19	-
华泰证券	1	830,555,850.54	23.84	162,699.46	23.84	-
招商证券	5	311,798,313.90	8.95	61,078.52	8.95	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券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(%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

华源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金 2025 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规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	关于华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金更为华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
4	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
5	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 A）基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
6	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
7	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
8	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 C）基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 18 日
9	华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
10	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日

11	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
12	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 4 日
13	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 9 日
14	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 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规定媒介	2026 年 4 月 9 日
15	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（华安中证有色金属矿业主题 ETF 发起式联接 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规定媒介	2026 年 4 月 9 日
16	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 22 日
17	华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2026 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规定媒介	2026 年 4 月 22 日
18	华安基金管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 23 日
19	华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
20	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
21	2025 年度华安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§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（转型后）

无。

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（转型前）

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》

2、《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》

3、《华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》

4、中国证监会批准华安中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金设立的文件；

5、《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》

6、《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金招募说明书》

7、《华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金托管协议》

8、中国证监会批准华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金设立的文件；

9、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；

10、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

11、基金托管人业务资格批件和营业执照；

12、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住所，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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日