

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十日

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 2021 年 8 月 25 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
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	13
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	13
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 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
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	42
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54

8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 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	57
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
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	59
10.8 其他重大事件	59
11 影响投资者决策的其他重要信息	61
12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安沪深 300ETF
场内简称	HS300
基金主代码	515390
交易代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 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	398,683,016.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 10 日

2.2 基金产品说明

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	<p>本基金主要采用组合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。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	沪深 300 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。

2.3 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	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	yan_zhang@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 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
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、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	51,768,444.48
本期利润	33,004,251.49
加权平均基金份额本期利润	0.1028
本期加权平均净值利润率	7.76%
本期基金份额净值增长率	4.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	136,322,058.44
期末可供分配基金份额利润	0.3419
期末基金资产净值	537,505,793.10
期末基金份额净值	1.3482
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	34.82%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购

赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.74%	0.80%	-2.02%	0.80%	1.28%	0.00%
过去三个月	6.48%	0.97%	3.48%	0.98%	3.00%	-0.01%
过去六个月	4.10%	1.31%	0.24%	1.31%	3.86%	0.00%
过去一年	31.97%	1.32%	25.46%	1.33%	6.51%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	34.82%	1.35%	34.26%	1.38%	0.56%	-0.03%

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

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2019 年 12 月 13 日至 2021 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 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 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金	2019-12-1	-	17 年	理学博士，17 年证券、基金从业

	<p>经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理</p>	<p>3</p>		<p>经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师。2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金(2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金)、华安中证银行指数分级证券投资基金(2021 年 1 月起转型为华安中证银行指数型证券投资基金)的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月，担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金(2021 年 1 月起转型为华安创业板 50 指数型证券投资基金)的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安</p>
--	------------------------------	----------	--	---

					<p>沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
许之彦	公募基金	11.00	59,074,195,142.53	2008-04-25
	私募资产管理计划	3.00	292,810,199.40	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	14.00	59,367,005,341.93	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行

投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合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 1 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

从疫情后全球经济的复苏结构来看，疫情率先得到控制以及疫苗接种率领先的经济体，上半年经济修复进程较快，生产经营活动逐渐步入正轨。中国作为率先复苏的经济体，上半年经济数据表现亮眼。2021 年上半年国内 GDP 同比增长 12.7%，二季度增长 7.9%，投资持续稳定恢复、外贸保持高速增势、进出口规模创新高，消费需求稳步增长。

上半年权益市场呈现结构性行情，春节后市场有一定调整，二季度整体上涨但风格分化明显，以创业板为代表的成长风格表现优于以沪深 300 为代表的大盘风格。沪深 300 上涨 0.24%，中证 500 上涨 6.93%，创业板指上涨 17.22%。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3482 元，本报告期份额净值增长率为 4.10%，同期业绩比较基准增长率为 0.24%。

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，疫情仍是影响全球经济走向的不确定性因素，上半年驱动国内经济的增长点主要来自于出口、固定资产投资等，下半年制造业投资、消费等有望接力向上。由于低基数效应消失，下半年的单季度 GDP 同比增速进一步回落，全年在完成既定目标基数上仍有一定上行空间。货币政策仍将保持灵活适度，进一步为缓解中小企业经营压力提供政策支持。

市场将回归盈利主线，业绩高增长和超预期的行业与个股将称为市场资金流入的主要方向。流动性环境趋于宽松，市场在一定调整后估值风险得到一定释放，盈利高增长的传统周期与新兴成长均有投资机会。沪深 300 中的核心资产依然是各个行业的优质资产，配置价值依然突出。

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、内部稽核监控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。

本年度中期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

本年度中期报告中财务指标、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：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	15,046,089.42	10,571,850.28
结算备付金		6,560,018.31	6,433,143.85
存出保证金		2,715,951.94	2,168,711.24
交易性金融资产	6.4.7.2	512,036,594.77	543,586,956.76
其中：股票投资		511,777,045.69	543,296,956.76
基金投资		-	-
债券投资		259,549.08	290,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,522,687.50	1,066,830.84
应收利息	6.4.7.5	5,015.77	4,508.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		538,886,357.71	563,832,001.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		316,829.45	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		54,450.13	56,285.07
应付托管费		18,150.04	18,761.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	633,538.84	553,163.12
应交税费		25,043.69	37,198.75

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	332,552.46	219,000.00
负债合计		1,380,564.61	884,408.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	398,683,016.00	434,683,016.00
未分配利润	6.4.7.10	138,822,777.10	128,264,576.89
所有者权益合计		537,505,793.10	562,947,592.89
负债和所有者权益总计		538,886,357.71	563,832,001.51

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3482 元，基金份额总额 398,683,016.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		34,671,558.86	2,366,880.63
1.利息收入		89,338.96	99,785.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	89,157.69	99,759.68
债券利息收入		181.27	26.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		51,827,408.44	-1,259,802.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	47,665,852.21	-2,900,540.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	138,513.03	46,721.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	1,058,687.94	-
股利收益	6.4.7.15	2,964,355.26	1,594,015.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-18,764,192.99	3,264,885.62
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	1,519,004.45	262,012.18
减：二、费用		1,667,307.37	1,201,999.22
1. 管理人报酬		315,658.02	160,400.44

2. 托管费		105,219.36	53,466.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,078,192.59	821,696.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		3,811.52	0.09
7. 其他费用	6.4.7.19	164,425.88	166,435.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,004,251.49	1,164,881.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,004,251.49	1,164,881.41

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	434,683,016.00	128,264,576.89	562,947,592.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,004,251.49	33,004,251.49
三、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）	-36,000,000.00	-22,446,051.28	-58,446,051.28
其中：1.基金申购款	524,000,000.00	152,791,959.72	676,791,959.72
2.基金赎回款	-560,000,000.00	-175,238,011.00	-735,238,011.00
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	398,683,016.00	138,822,777.10	537,505,793.10
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	442,683,016.00	3,081,047.82	445,764,063.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	1,164,881.41	1,164,881.41

润)			
三、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)	-302,000,000.00	-1,204,629.71	-303,204,629.71
其中: 1.基金申购款	180,000,000.00	-9,949,921.88	170,050,078.12
2.基金赎回款	-482,000,000.00	8,745,292.17	-473,254,707.83
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	140,683,016.00	3,041,299.52	143,724,315.52

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: 陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]第 1823 号《关于准予华安沪深 300 交易型开放式指数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《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金, 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 442,683,016.00 元(含募集股票市值), 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(2019)第 0677 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 13 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 442,683,016.00 份基金份额, 无认购资金利息折合的基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]309 号文核准同意, 本基金 442,683,016.00 份基金份额于 2020 年 1 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的标的指数为沪深 300 指数, 投资目标是紧密跟踪标的指数, 追求跟

踪偏离度和跟踪误差最小化。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(包括中小板、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(含分离交易可转债的纯债部分、可交换债)、短期融资券)、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。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%，且不得低于非现金基金资产的 80%。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

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 2021 年 8 月 25 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	15,046,089.42
定期存款	-
其他存款	-
合计	15,046,089.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	496,669,839.83	511,777,045.69	15,107,205.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	259,549.08	9,049.08
	银行间市场	-	-
	合计	259,549.08	9,049.08
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	496,920,339.83	512,036,594.77	15,116,254.94
----	----------------	----------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	20,041,988.57	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,041,988.57	-	-	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,706.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,163.83
应收债券利息	19.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	125.10
合计	5,015.77

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	633,538.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	633,538.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
应付替代款	574.11
指数使用费	35,000.00
可退替代款	207,718.20
合计	332,552.46

注：应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	434,683,016.00	434,683,016.00
本期申购	524,000,000.00	524,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-560,000,000.00	-560,000,000.00
本期末	398,683,016.00	398,683,016.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,385,480.15	45,879,096.74	128,264,576.89
本期利润	51,768,444.48	-18,764,192.99	33,004,251.49
本期基金份额交易产生的变动数	2,168,133.81	-24,614,185.09	-22,446,051.28

其中：基金申购款	152,541,583.87	250,375.85	152,791,959.72
基金赎回款	-150,373,450.06	-24,864,560.94	-175,238,011.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,322,058.44	2,500,718.66	138,822,777.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,896.02
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	60,525.94
其他	1,735.73
合计	89,157.69

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	27,324,346.81
股票投资收益——赎回差价收入	20,341,505.40
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	47,665,852.21

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	357,334,395.02
减：卖出股票成本总额	330,010,048.21
买卖股票差价收入	27,324,346.81

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	735,238,011.00
减：现金支付赎回款总额	283,458,463.00
减：赎回股票成本总额	431,438,042.60

赎回差价收入	20,341,505.40
--------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,384,597.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,245,900.00
减：应收利息总额	184.05
买卖债券差价收入	138,513.03

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,058,687.94

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,964,355.26
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	2,964,355.26

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-17,987,004.42

——股票投资	-17,996,053.50
——债券投资	9,049.08
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-777,188.57
——权证投资	-
——股指期货	-777,188.57
4.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	-18,764,192.99

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,519,004.45
合计	1,519,004.45

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,078,192.59
银行间市场交易费用	-
合计	1,078,192.59

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021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	-
指数使用费	70,427.09
银行汇划费	4,738.64
合计	164,425.88

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

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、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 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	315,658.02	160,400.44
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	105,219.36	53,466.78

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 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	17,700,679.00	4.44%	32,000,679.00	7.36%
招商银行股份有限公司—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	44,987,500.00	11.28%	50,667,100.00	11.66%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	15,046,089.42	26,896.02	8,074,377.82	81,842.48

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10

国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	6,806.00	85,347.24
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	2,306.00	84,242.22
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	1,777.00	39,218.03
国泰君安	113042	上银转债	老股东配售	3,170.00	317,000.00
国泰君安	113045	环旭转债	老股东配售	220.00	22,000.00
国泰君安	113049	长汽转债	老股东配售	140.00	14,000.00
国泰君安	113050	南银转债	老股东配售	1,760.00	176,000.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
国泰君安	-	-	-	-	-

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	新股限售	9.88	27.34	3,412.00	33,710.56	93,284.08	-
68863	智明	2021-0	2021-1	新股	34.50	80.72	918.00	31,671	74,100	-

6	达	3-30	0-08	限售				.00	.96	
30095	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	268.00	12,684.44	67,525.28	-
68811	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	17.90	35.97	1,672.00	29,928.80	60,141.84	-
68868	莱尔科技	2021-04-01	2021-10-12	新股限售	9.51	14.73	3,296.00	31,344.96	48,550.08	-
68851	金冠电气	2021-06-10	2021-12-20	新股限售	7.71	11.88	2,892.00	22,297.32	34,356.96	-
30097	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	347.00	11,527.34	30,362.50	-
68868	科汇股份	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	9.56	14.54	1,899.00	18,154.44	27,611.46	-
30097	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	192.00	5,429.76	22,216.32	-
30100	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	681.00	8,539.74	18,993.09	-
30101	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
30098	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
30094	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
30061	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
30093	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
30094	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
30098	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	129.00	6,268.11	11,660.31	-
30100	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
30099	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	849.00	4,194.06	11,079.45	-
30095	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
30099	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
30096	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
30095	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
30101	雷尔	2021-0	2021-1	新股	13.75	32.98	275.00	3,781.	9,069.	-

6	伟	6-23	2-30	限售				25	50	
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	392.00	4,743.20	7,561.68	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312.00	2,436.72	6,845.28	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
30092	华骐	2021-0	2021-0	新股	13.87	29.55	183.00	2,538.	5,407.	-

9	环保	1-12	7-21	限售				21	65	
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	207.00	5,154.30	5,135.67	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	1,777.00	39,022.92	39,022.92	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-

605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	配债未上市	100.00	100.00	140.00	14,000.00	14,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	配债未上市	100.00	100.00	1,760.00	176,000.00	176,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	108.00	10,800.00	10,800.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	配债未上市	100.00	100.00	205.00	20,500.00	20,500.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项或临时停牌	5.59	2021-07-06	6.15	64,800.00	481,026.03	362,232.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。

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。

本公司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，并根据本公司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，有效保障基金份额持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	15,046,089.42	-	-	-	15,046,089.42
结算备付金	6,560,018.31	-	-	-	6,560,018.31
存出保证金	2,715,951.94	-	-	-	2,715,951.94
交易性金融资产	259,549.08	-	-	511,777,045.69	512,036,594.77
应收证券清算款	-	-	-	2,522,687.50	2,522,687.50
应收利息	-	-	-	5,015.77	5,015.77
资产总计	24,581,608.75	-	-	514,304,748.96	538,886,357.71

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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	316,829.45	316,829.45
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	54,450.13	54,450.13
应付托管费	-	-	-	18,150.04	18,150.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	633,538.84	633,538.84
应交税费	-	-	-	25,043.69	25,043.69
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	332,552.46	332,552.46
负债总计	-	-	-	1,380,564.61	1,380,564.61
利率敏感度缺口	24,581,608.75	-	-	512,924,184.35	537,505,793.10
上年度末 2020 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	10,571,850.28	-	-	-	10,571,850.28
结算备付金	6,433,143.85	-	-	-	6,433,143.85
存出保证金	2,168,711.24	-	-	-	2,168,711.24
交易性金融资产	290,000.00	-	-	543,296,956.76	543,586,956.76
应收证券清算款	-	-	-	1,066,830.84	1,066,830.84
应收利息	-	-	-	4,508.54	4,508.54
资产总计	19,463,705.37	-	-	544,368,296.14	563,832,001.51
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,285.07	56,285.07
应付托管费	-	-	-	18,761.68	18,761.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	553,163.12	553,163.12
应交税费	-	-	-	37,198.75	37,198.75
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,000.00	219,000.00
负债总计	-	-	-	884,408.62	884,408.62
利率敏感度缺口	19,463,705.37	-	-	543,483,887.52	562,947,592.89

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 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 0.05%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采用组合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。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发

现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	511,777,045.69	95.21	543,296,956.76	96.51
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	511,777,045.69	95.21	543,296,956.76	96.51

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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,669	增加约 2,752
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,669	减少约 2,752

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	511,777,045.69	94.97
	其中：股票	511,777,045.69	94.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	259,549.08	0.05
	其中：债券	259,549.08	0.05
	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	21,606,107.73	4.01
8	其他各项资产	5,243,655.21	0.97
9	合计	538,886,357.71	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

A	农、林、牧、渔业	5,320,777.92	0.99
B	采矿业	10,835,728.00	2.02
C	制造业	282,155,672.75	52.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,029,629.00	1.68
E	建筑业	6,206,324.00	1.15
F	批发和零售业	3,552,024.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	14,678,576.10	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,512,634.82	3.07
J	金融业	120,573,113.97	22.43
K	房地产业	10,489,867.77	1.95
L	租赁和商务服务业	9,254,596.00	1.72
M	科学研究和技术服务业	7,375,811.60	1.37
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	921,249.00	0.17
Q	卫生和社会工作	10,894,287.74	2.03
R	文化、体育和娱乐业	2,126,916.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	509,927,208.67	94.87

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,345,990.01	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00

F	批发和零售业	328,753.90	0.06
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	46,251.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
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	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,849,837.02	0.34

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	15,200	31,261,840.00	5.82
2	601318	中国平安	259,500	16,680,660.00	3.10
3	600036	招商银行	296,600	16,072,754.00	2.99
4	000858	五粮液	46,100	13,732,729.00	2.55
5	601012	隆基股份	103,861	9,227,011.24	1.72
6	000333	美的集团	114,577	8,177,360.49	1.52
7	600276	恒瑞医药	107,250	7,289,782.50	1.36
8	601166	兴业银行	348,700	7,165,785.00	1.33
9	002415	海康威视	110,900	7,153,050.00	1.33
10	601888	中国中免	23,200	6,962,320.00	1.30
11	603259	药明康德	43,240	6,770,951.60	1.26
12	300059	东方财富	196,159	6,432,053.61	1.20
13	000651	格力电器	114,100	5,944,610.00	1.11
14	600900	长江电力	272,600	5,626,464.00	1.05
15	600887	伊利股份	145,700	5,366,131.00	1.00

16	002475	立讯精密	115,859	5,329,514.00	0.99
17	002594	比亚迪	20,600	5,170,600.00	0.96
18	000001	平安银行	226,400	5,121,168.00	0.95
19	600030	中信证券	204,100	5,090,254.00	0.95
20	000725	京东方 A	803,500	5,013,840.00	0.93
21	300015	爱尔眼科	63,743	4,524,478.14	0.84
22	601398	工商银行	840,000	4,342,800.00	0.81
23	600031	三一重工	142,300	4,136,661.00	0.77
24	000568	泸州老窖	17,442	4,115,265.48	0.77
25	600309	万华化学	37,700	4,102,514.00	0.76
26	603501	韦尔股份	12,400	3,992,800.00	0.74
27	000002	万科 A	161,357	3,841,910.17	0.71
28	603288	海天味业	29,506	3,804,798.70	0.71
29	002714	牧原股份	62,496	3,801,006.72	0.71
30	600809	山西汾酒	8,414	3,769,472.00	0.70
31	300122	智飞生物	19,000	3,547,870.00	0.66
32	601919	中远海控	115,900	3,539,586.00	0.66
33	002142	宁波银行	85,500	3,331,935.00	0.62
34	600436	片仔癀	7,300	3,272,590.00	0.61
35	601328	交通银行	658,600	3,227,140.00	0.60
36	601899	紫金矿业	331,400	3,211,266.00	0.60
37	002304	洋河股份	14,400	2,983,680.00	0.56
38	002812	恩捷股份	12,700	2,973,070.00	0.55
39	002352	顺丰控股	43,300	2,931,410.00	0.55
40	600000	浦发银行	281,505	2,815,050.00	0.52
41	600438	通威股份	64,900	2,808,223.00	0.52
42	300274	阳光电源	24,300	2,795,958.00	0.52
43	300014	亿纬锂能	26,900	2,795,717.00	0.52
44	002230	科大讯飞	40,600	2,743,748.00	0.51
45	300124	汇川技术	36,800	2,732,768.00	0.51
46	600837	海通证券	231,200	2,658,800.00	0.49
47	000661	长春高新	6,800	2,631,600.00	0.49
48	000100	TCL 科技	332,700	2,545,155.00	0.47
49	601816	京沪高铁	470,400	2,488,416.00	0.46
50	000063	中兴通讯	73,300	2,435,759.00	0.45
51	002241	歌尔股份	56,700	2,423,358.00	0.45
52	300347	泰格医药	12,350	2,387,255.00	0.44
53	601601	中国太保	82,100	2,378,437.00	0.44
54	600585	海螺水泥	57,500	2,360,375.00	0.44
55	600690	海尔智家	90,900	2,355,219.00	0.44
56	601668	中国建筑	502,400	2,336,160.00	0.43
57	002460	赣锋锂业	19,100	2,312,819.00	0.43
58	002271	东方雨虹	41,800	2,312,376.00	0.43
59	600763	通策医疗	5,600	2,301,600.00	0.43

60	300142	沃森生物	37,200	2,295,240.00	0.43
61	002027	分众传媒	243,600	2,292,276.00	0.43
62	603799	华友钴业	19,800	2,261,160.00	0.42
63	600016	民生银行	510,100	2,249,541.00	0.42
64	603986	兆易创新	11,844	2,225,487.60	0.41
65	601288	农业银行	688,900	2,087,367.00	0.39
66	600196	复星医药	28,900	2,084,557.00	0.39
67	600048	保利地产	172,300	2,074,492.00	0.39
68	600703	三安光电	64,500	2,067,225.00	0.38
69	600919	江苏银行	283,440	2,012,424.00	0.37
70	000338	潍柴动力	112,600	2,012,162.00	0.37
71	601229	上海银行	238,600	1,956,520.00	0.36
72	601688	华泰证券	123,400	1,949,720.00	0.36
73	002129	中环股份	50,200	1,937,720.00	0.36
74	600050	中国联通	445,600	1,924,992.00	0.36
75	600660	福耀玻璃	33,800	1,887,730.00	0.35
76	600570	恒生电子	19,984	1,863,508.00	0.35
77	600104	上汽集团	84,200	1,849,874.00	0.34
78	601211	国泰君安	107,900	1,849,406.00	0.34
79	601766	中国中车	291,900	1,774,752.00	0.33
80	601169	北京银行	354,300	1,725,441.00	0.32
81	600999	招商证券	88,790	1,688,785.80	0.31
82	002371	北方华创	6,000	1,664,280.00	0.31
83	688111	金山办公	4,200	1,658,160.00	0.31
84	600019	宝钢股份	213,400	1,630,376.00	0.30
85	002311	海大集团	19,600	1,599,360.00	0.30
86	601988	中国银行	505,500	1,556,940.00	0.29
87	600406	国电南瑞	66,380	1,542,671.20	0.29
88	002049	紫光国微	10,000	1,541,900.00	0.29
89	601088	中国神华	78,980	1,541,689.60	0.29
90	002410	广联达	22,388	1,526,861.60	0.28
91	300498	温氏股份	105,760	1,519,771.20	0.28
92	601818	光大银行	396,400	1,498,392.00	0.28
93	600745	闻泰科技	15,100	1,463,190.00	0.27
94	300450	先导智能	24,160	1,452,982.40	0.27
95	300601	康泰生物	9,700	1,445,300.00	0.27
96	000625	长安汽车	53,900	1,416,492.00	0.26
97	600028	中国石化	321,000	1,399,560.00	0.26
98	000538	云南白药	12,000	1,388,640.00	0.26
99	600893	航发动力	25,700	1,366,983.00	0.25
100	601628	中国人寿	39,900	1,352,211.00	0.25
101	002821	凯莱英	3,600	1,341,360.00	0.25
102	600346	恒力石化	50,600	1,327,744.00	0.25
103	601658	邮储银行	261,000	1,310,220.00	0.24

104	600588	用友网络	39,180	1,303,126.80	0.24
105	601390	中国中铁	244,100	1,279,084.00	0.24
106	601633	长城汽车	29,201	1,272,871.59	0.24
107	601009	南京银行	120,300	1,265,556.00	0.24
108	002493	荣盛石化	72,100	1,245,167.00	0.23
109	300595	欧普康视	12,000	1,242,600.00	0.23
110	601377	兴业证券	128,400	1,240,344.00	0.23
111	601857	中国石油	232,400	1,229,396.00	0.23
112	600132	重庆啤酒	6,000	1,187,700.00	0.22
113	300413	芒果超媒	17,000	1,166,200.00	0.22
114	688036	传音控股	5,501	1,152,459.50	0.21
115	601225	陕西煤业	96,000	1,137,600.00	0.21
116	600584	长电科技	29,900	1,126,632.00	0.21
117	600009	上海机场	23,000	1,106,990.00	0.21
118	300408	三环集团	26,000	1,102,920.00	0.21
119	600426	华鲁恒升	35,500	1,098,725.00	0.20
120	002601	龙佰集团	31,700	1,096,186.00	0.20
121	603882	金域医学	6,800	1,086,436.00	0.20
122	600111	北方稀土	52,300	1,082,610.00	0.20
123	601939	建设银行	161,200	1,071,980.00	0.20
124	601100	恒立液压	12,404	1,065,751.68	0.20
125	000776	广发证券	70,100	1,061,314.00	0.20
126	002001	新 和 成	36,680	1,051,982.40	0.20
127	600926	杭州银行	70,800	1,044,300.00	0.19
128	300433	蓝思科技	35,500	1,044,055.00	0.19
129	000895	双汇发展	32,762	1,041,831.60	0.19
130	002050	三花智控	42,820	1,026,823.60	0.19
131	002179	中航光电	12,935	1,022,123.70	0.19
132	688012	中微公司	6,099	1,011,946.08	0.19
133	600958	东方证券	100,200	1,000,998.00	0.19
134	000166	申万宏源	213,700	1,000,116.00	0.19
135	600741	华域汽车	37,900	995,633.00	0.19
136	002841	视源股份	8,000	994,320.00	0.18
137	600600	青岛啤酒	8,500	983,025.00	0.18
138	300003	乐普医疗	30,000	963,600.00	0.18
139	000963	华东医药	20,700	952,407.00	0.18
140	002007	华兰生物	25,964	952,359.52	0.18
141	000786	北新建材	24,200	949,850.00	0.18
142	601006	大秦铁路	142,400	936,992.00	0.17
143	603806	福斯特	8,900	935,657.00	0.17
144	000157	中联重科	100,700	930,468.00	0.17
145	002607	中公教育	44,100	921,249.00	0.17
146	601336	新华保险	19,900	913,609.00	0.17
147	601901	方正证券	97,500	912,600.00	0.17

148	600015	华夏银行	147,100	910,549.00	0.17
149	600143	金发科技	43,300	903,238.00	0.17
150	002236	大华股份	42,800	903,080.00	0.17
151	601989	中国重工	218,800	901,456.00	0.17
152	601155	新城控股	21,600	898,560.00	0.17
153	600176	中国巨石	57,720	895,237.20	0.17
154	601138	工业富联	71,400	886,074.00	0.16
155	603993	洛阳钼业	169,800	876,168.00	0.16
156	601877	正泰电器	25,800	861,204.00	0.16
157	000768	中航西飞	32,700	859,356.00	0.16
158	600352	浙江龙盛	62,400	857,376.00	0.16
159	600010	包钢股份	546,900	847,695.00	0.16
160	601788	光大证券	46,800	837,252.00	0.16
161	600547	山东黄金	43,520	836,454.40	0.16
162	600760	中航沈飞	13,860	835,758.00	0.16
163	601600	中国铝业	156,300	828,390.00	0.15
164	001979	招商蛇口	75,300	824,535.00	0.15
165	603369	今世缘	15,200	823,232.00	0.15
166	300529	健帆生物	9,500	820,420.00	0.15
167	601186	中国铁建	110,400	820,272.00	0.15
168	002008	大族激光	20,200	815,878.00	0.15
169	601799	星宇股份	3,600	812,592.00	0.15
170	002202	金风科技	65,700	798,912.00	0.15
171	601916	浙商银行	200,900	797,573.00	0.15
172	688169	石头科技	622	784,342.00	0.15
173	000876	新希望	53,400	783,378.00	0.15
174	002555	三七互娱	31,500	756,630.00	0.14
175	603899	晨光文具	8,900	752,584.00	0.14
176	003816	中国广核	279,300	745,731.00	0.14
177	000938	紫光股份	34,040	744,795.20	0.14
178	603160	汇顶科技	5,700	738,891.00	0.14
179	600109	国金证券	57,800	733,482.00	0.14
180	002736	国信证券	68,100	732,075.00	0.14
181	601066	中信建投	23,200	729,176.00	0.14
182	000069	华侨城 A	97,200	723,168.00	0.13
183	600989	宝丰能源	52,800	722,304.00	0.13
184	000425	徐工机械	111,800	712,166.00	0.13
185	600150	中国船舶	43,100	711,581.00	0.13
186	601669	中国电建	183,600	710,532.00	0.13
187	603659	璞泰来	5,200	710,320.00	0.13
188	300136	信维通信	22,800	704,064.00	0.13
189	688008	澜起科技	11,201	698,718.38	0.13
190	000596	古井贡酒	2,900	694,550.00	0.13
191	600795	国电电力	281,800	684,774.00	0.13

192	000977	浪潮信息	24,300	683,559.00	0.13
193	002384	东山精密	32,600	679,384.00	0.13
194	600085	同仁堂	16,600	678,110.00	0.13
195	603019	中科曙光	24,480	675,892.80	0.13
196	601238	广汽集团	52,000	673,400.00	0.13
197	000783	长江证券	91,700	671,244.00	0.12
198	300677	英科医疗	5,300	661,440.00	0.12
199	002624	完美世界	27,550	658,720.50	0.12
200	600079	人福医药	23,300	658,691.00	0.12
201	601838	成都银行	51,900	656,016.00	0.12
202	300558	贝达药业	6,000	649,440.00	0.12
203	603833	欧派家居	4,540	644,498.40	0.12
204	600183	生益科技	27,500	643,775.00	0.12
205	600886	国投电力	66,900	642,909.00	0.12
206	600029	南方航空	106,600	641,732.00	0.12
207	601985	中国核电	125,700	636,042.00	0.12
208	603517	绝味食品	7,500	632,175.00	0.12
209	601108	财通证券	59,900	628,351.00	0.12
210	688396	华润微	6,902	628,220.04	0.12
211	000703	恒逸石化	52,550	627,972.50	0.12
212	300144	宋城演艺	37,260	625,968.00	0.12
213	601360	三六零	51,200	625,152.00	0.12
214	002600	领益智造	67,900	624,001.00	0.12
215	601555	东吴证券	74,640	622,497.60	0.12
216	002414	高德红外	22,180	611,724.40	0.11
217	000066	中国长城	41,674	608,440.40	0.11
218	300676	华大基因	5,100	604,860.00	0.11
219	002938	鹏鼎控股	16,700	599,196.00	0.11
220	002252	上海莱士	79,900	598,451.00	0.11
221	002044	美年健康	65,260	594,518.60	0.11
222	601077	渝农商行	148,700	593,313.00	0.11
223	600522	中天科技	58,800	588,000.00	0.11
224	601607	上海医药	27,800	587,414.00	0.11
225	300033	同花顺	5,200	586,456.00	0.11
226	600332	白云山	16,900	572,065.00	0.11
227	002602	世纪华通	88,596	568,786.32	0.11
228	600161	天坛生物	16,500	565,125.00	0.11
229	600362	江西铜业	25,000	559,500.00	0.10
230	000728	国元证券	70,130	558,936.10	0.10
231	601111	中国国航	71,800	558,604.00	0.10
232	600383	金地集团	54,400	557,056.00	0.10
233	600872	中炬高新	13,200	554,664.00	0.10
234	601800	中国交建	84,800	549,504.00	0.10
235	300628	亿联网络	6,500	544,700.00	0.10

236	600115	中国东航	107,200	544,576.00	0.10
237	600845	宝信软件	10,630	541,067.00	0.10
238	002916	深南电路	4,800	533,424.00	0.10
239	600061	国投资本	61,304	520,470.96	0.10
240	601727	上海电气	122,400	518,976.00	0.10
241	002508	老板电器	11,100	516,150.00	0.10
242	000860	顺鑫农业	12,200	514,596.00	0.10
243	601618	中国中冶	171,400	510,772.00	0.10
244	000708	中信特钢	24,200	504,328.00	0.09
245	601162	天风证券	103,440	502,718.40	0.09
246	601021	春秋航空	8,800	500,720.00	0.09
247	600705	中航产融	128,000	495,360.00	0.09
248	601878	浙商证券	37,300	487,884.00	0.09
249	603939	益丰药房	8,600	482,374.00	0.09
250	600606	绿地控股	87,300	475,785.00	0.09
251	688363	华熙生物	1,701	472,639.86	0.09
252	601990	南京证券	44,300	466,036.00	0.09
253	002456	欧菲光	51,100	453,768.00	0.08
254	002157	正邦科技	37,400	446,930.00	0.08
255	600011	华能国际	105,800	446,476.00	0.08
256	002463	沪电股份	28,700	443,989.00	0.08
257	000656	金科股份	76,000	440,040.00	0.08
258	600521	华海药业	20,800	434,304.00	0.08
259	601933	永辉超市	91,700	433,741.00	0.08
260	600655	豫园股份	37,300	432,307.00	0.08
261	601696	中银证券	20,000	411,800.00	0.08
262	601216	君正集团	80,500	409,745.00	0.08
263	600848	上海临港	22,740	407,046.00	0.08
264	600118	中国卫星	13,900	406,714.00	0.08
265	600489	中金黄金	46,700	402,554.00	0.07
266	603658	安图生物	5,300	401,581.00	0.07
267	600018	上港集团	83,600	398,772.00	0.07
268	601995	中金公司	6,400	393,600.00	0.07
269	002558	巨人网络	28,800	383,040.00	0.07
270	601998	中信银行	73,700	375,870.00	0.07
271	002120	韵达股份	27,410	370,857.30	0.07
272	603195	公牛集团	1,800	363,600.00	0.07
273	002024	苏宁易购	64,800	362,232.00	0.07
274	601872	招商轮船	77,840	359,620.80	0.07
275	688126	沪硅产业	12,201	356,025.18	0.07
276	603338	浙江鼎力	6,000	352,140.00	0.07
277	688009	中国通号	61,797	351,624.93	0.07
278	601319	中国人保	59,200	351,056.00	0.07
279	002673	西部证券	42,186	348,034.50	0.06

280	002739	万达电影	21,200	334,748.00	0.06
281	601881	中国银河	30,700	330,946.00	0.06
282	603392	万泰生物	1,220	316,199.60	0.06
283	603233	大参林	5,900	301,549.00	0.06
284	600233	圆通速递	30,000	300,300.00	0.06
285	601231	环旭电子	16,200	272,322.00	0.05
286	600482	中国动力	15,600	271,752.00	0.05
287	002032	苏泊尔	4,000	255,160.00	0.05
288	002153	石基信息	10,540	247,795.40	0.05
289	600340	华夏幸福	47,190	247,275.60	0.05
290	600025	华能水电	42,700	247,233.00	0.05
291	002939	长城证券	21,800	242,634.00	0.05
292	000800	一汽解放	22,000	238,040.00	0.04
293	601236	红塔证券	17,400	235,944.00	0.04
294	002773	康弘药业	8,806	203,682.78	0.04
295	601808	中海油服	14,000	201,040.00	0.04
296	600918	中泰证券	18,300	198,006.00	0.04
297	601698	中国卫通	10,400	168,376.00	0.03
298	603087	甘李药业	1,400	149,212.00	0.03
299	600299	安迪苏	9,400	112,424.00	0.02
300	002945	华林证券	6,600	91,212.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	301015	百洋医药	4,614.00	251,115.78	0.05
2	688161	威高骨科	2,229.00	236,385.45	0.04
3	301016	雷尔伟	2,747.00	115,711.58	0.02
4	688319	欧林生物	3,412.00	93,284.08	0.02
5	688636	智明达	918.00	74,100.96	0.01
6	300957	贝泰妮	268.00	67,525.28	0.01
7	301018	申菱环境	7,811.00	64,753.19	0.01
8	688117	圣诺生物	1,672.00	60,141.84	0.01
9	688239	航宇科技	4,926.00	56,550.48	0.01
10	301017	漱玉平民	5,550.00	49,173.00	0.01
11	688683	莱尔科技	3,296.00	48,550.08	0.01
12	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.01
13	688087	英科再生	1,777.00	39,022.92	0.01
14	300894	火星人	566.00	38,488.00	0.01
15	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.01
16	688517	金冠电气	2,892.00	34,356.96	0.01

17	300979	华利集团	347.00	30,362.50	0.01
18	688681	科汇股份	1,899.00	27,611.46	0.01
19	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.01
20	300973	立高食品	192.00	22,216.32	0.00
21	301009	可靠股份	681.00	18,993.09	0.00
22	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.00
23	300925	法本信息	600.00	15,774.00	0.00
24	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.00
25	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
26	300940	南极光	307.00	13,317.66	0.00
27	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.00
28	300937	药易购	244.00	13,105.24	0.00
29	300942	易瑞生物	443.00	12,634.36	0.00
30	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
31	300981	中红医疗	129.00	11,660.31	0.00
32	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
33	300997	欢乐家	849.00	11,079.45	0.00
34	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
35	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
36	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
37	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
38	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
39	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
40	300945	曼卡龙	474.00	8,949.12	0.00
41	300948	冠中生态	324.00	8,884.08	0.00
42	300931	通用电梯	672.00	8,809.92	0.00
43	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
44	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
45	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
46	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
47	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
48	300987	川网传媒	301.00	8,069.81	0.00
49	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
50	300926	博俊科技	359.00	7,969.80	0.00
51	300993	玉马遮阳	392.00	7,561.68	0.00
52	301004	嘉益股份	312.00	6,845.28	0.00
53	300927	江天化学	217.00	6,531.70	0.00
54	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
55	300963	中洲特材	283.00	6,364.67	0.00
56	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
57	300943	春晖智控	255.00	5,867.55	0.00
58	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
59	300972	万辰生物	430.00	5,439.50	0.00
60	300929	华骐环保	183.00	5,407.65	0.00

61	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00
62	300985	致远新能	207.00	5,135.67	0.00
63	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
64	300995	奇德新材	191.00	4,454.12	0.00
65	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
66	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
67	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
68	300992	泰福泵业	200.00	4,064.00	0.00
69	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	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	000858	五粮液	18,511,872.00	3.29
2	000333	美的集团	13,829,640.44	2.46
3	000651	格力电器	9,975,678.00	1.77
4	002415	海康威视	8,614,888.00	1.53
5	300059	东方财富	7,534,903.00	1.34
6	000001	平安银行	7,426,930.56	1.32
7	000725	京东方 A	6,834,698.00	1.21
8	000002	万科 A	6,761,851.00	1.20
9	002714	牧原股份	6,376,999.31	1.13
10	000568	泸州老窖	6,160,515.00	1.09
11	002475	立讯精密	6,130,518.00	1.09
12	000661	长春高新	5,996,809.08	1.07
13	300122	智飞生物	5,393,109.26	0.96
14	002352	顺丰控股	5,239,126.00	0.93
15	002594	比亚迪	5,072,779.00	0.90
16	002304	洋河股份	5,049,592.00	0.90
17	002821	凯莱英	4,884,950.00	0.87
18	600519	贵州茅台	4,640,799.00	0.82
19	002142	宁波银行	4,601,530.00	0.82
20	300015	爱尔眼科	4,447,958.62	0.79

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
----	------	------	----------	---------

				产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	20,682,200.00	3.67
2	000333	美的集团	16,654,174.00	2.96
3	000651	格力电器	11,476,052.00	2.04
4	300059	东方财富	8,390,478.37	1.49
5	000001	平安银行	8,242,084.00	1.46
6	002415	海康威视	8,200,935.30	1.46
7	000002	万 科 A	7,786,839.00	1.38
8	002714	牧原股份	7,265,272.00	1.29
9	000568	泸州老窖	6,906,983.00	1.23
10	000661	长春高新	6,739,807.00	1.20
11	002475	立讯精密	6,625,645.00	1.18
12	000725	京东方 A	6,541,019.00	1.16
13	002352	顺丰控股	6,324,982.00	1.12
14	002594	比亚迪	6,124,440.79	1.09
15	002304	洋河股份	5,517,740.00	0.98
16	000100	TCL 科技	4,995,868.00	0.89
17	002821	凯莱英	4,946,613.06	0.88
18	300122	智飞生物	4,869,144.00	0.86
19	300124	汇川技术	4,599,143.00	0.82
20	002142	宁波银行	4,422,530.24	0.79

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	346,002,164.08
卖出股票的收入（成交）总额	357,334,395.02

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	259,549.08	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	259,549.08	0.05

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	113050	南银转债	1,760	176,000.00	0.03
2	127036	三花转债	292	38,249.08	0.01
3	127038	国微转债	205	20,500.00	0.00
4	113049	长汽转债	140	14,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	108	10,800.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	13.00	20,148,960.00	106,971.43	-

公允价值变动总额合计	106,971.43
股指期货投资本期收益	1,058,687.94
股指期货投资本期公允价值变动	-777,188.57

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 9 月 29 日，招商银行因违反外汇市场交易管理行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检[2020]76 号）责令改正、并处罚款人民币 120 万元的行政处罚，并对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分。2020 年 11 月 27 日，招商银行因金融机构违反规定办理结汇、售汇的行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检（2020）92 号）责令改正、并处罚款人民币 55 万元、没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚。2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

2020 年 8 月 31 日，兴业银行因同业投资用途不合规、授信管理不尽职等违法违规行为，被中国银保监会福建监管局（闽银保监罚决字〔2020〕24 号）给予没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚。2020 年 9 月 4 日，兴业银行因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性等违法违规行为，被中国人民银行福州中心支行（福银罚字〔2020〕35 号）给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款的行政处罚。

2020 年 12 月 28 日，南京银行因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被人民银行南京分行（（南银）罚字（2020）第 30 号）给予警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 元的行政处罚。

本基金投资招商银行、兴业银行、南银转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,715,951.94
2	应收证券清算款	2,522,687.50
3	应收股利	-
4	应收利息	5,015.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,243,655.21

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688319	欧林生物	93,284.08	0.02	处于锁定期

2	688636	智明达	74,100.96	0.01	处于锁定期
3	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	处于锁定期
4	301016	雷尔伟	9,069.50	0.00	处于锁定期

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2,451	162,661.37	343,054,276.00	86.05%	55,628,740.00	13.95%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券股份有限公司融 券专用证券账户	96,698,900.00	24.25%
2	中信建投证券股份有限公 司	77,000,000.00	19.31%
3	华泰证券股份有限公司融 券专用证券账户	24,000,000.00	6.02%
4	国泰君安证券股份有限公 司	14,300,600.00	3.59%
5	北京和正投资管理有限责 任公司一和正启航一号私 募证券投资基金	12,000,000.00	3.01%
6	国泰君安证券股份有限公 司融券专用证券账户	11,729,500.00	2.94%
7	中国银河证券股份有限公 司融券专用证券账户	10,000,000.00	2.51%
8	黄美景	9,846,600.00	2.47%
9	方正证券股份有限公司	9,153,909.00	2.30%

10	中国中金财富证券有限公司转融通担保证券明细账户	8,134,400.00	2.04%
11	招商银行股份有限公司—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	44,987,500.00	11.28%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.4 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

基金合同生效日（2019 年 12 月 13 日）基金份额总额	442,683,016.00
本报告期期初基金份额总额	434,683,016.00
本报告期基金总申购份额	524,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	560,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	398,683,016.00

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：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	556,390,128.79	79.89%	507,040.54	79.65%	-
中信证券	2	100,113,753.24	14.38%	92,530.65	14.53%	-
东吴证券	1	30,918,679.87	4.44%	28,795.22	4.52%	-
浙商证券	1	5,675,920.90	0.82%	5,172.43	0.81%	-
信达证券	1	3,328,357.16	0.48%	3,033.19	0.48%	-

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：

2021 年 2 月完成租用托管在招商银行的信达证券深交所 011318 交易单元。

2021 年 5 月完成租用托管在招商银行的浙商证券深交所 012813 交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	258,038.48	18.64%	-	-	-	-
东吴证券	664,775.90	48.01%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	461,782.70	33.35%	-	-	-	-

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关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-01-21

		定媒介	
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(上银转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-27
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
5	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(环旭转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-06
8	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
9	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-03-30
10	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
11	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
12	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同(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	2021-03-31
13	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2021 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	2021-03-31
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(味知香)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(华生科技)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
16	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2021-04-21
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会基金电子披	2021-04-22

	关联方承销证券的公告（正弦电气）	露网站和公司网站等指定媒介	
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（长汽转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-15
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（南银转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-17
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18
23	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-25

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

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	20210101-20210110	100,000,000.00	48,000,000.00	147,707,400.00	292,600.00	0.07%
	2	20210101-20210112	92,000,000.00	48,000,000.00	140,000,000.00	0.00	0.00%
	3	20210111-20210630	0.00	204,676,500.00	107,977,600.00	96,698,900.00	24.25%
	4	20210329-20210623	35,300,000.00	125,400,000.00	83,700,000.00	77,000,000.00	19.31%
联接基金	1	20210101-20210630	50,667,100.00	11,270,400.00	16,950,000.00	44,987,500.00	11.28%

			0	0			
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

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、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 交易型开放式指数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

二〇二一年八月三十日