

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 管理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74

8.6	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	75
8.7	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	75
8.8	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	75
8.9	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	75
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.12	投资组合报告附注	76
§9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	78
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	78
§10	开放式基金份额变动	78
§11	重大事件揭示	78
11.1	基金份额持有人大会决议	78
11.2	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	78
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
11.4	基金投资策略的改变	79
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	79
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8	其他重大事件	81
12	影响投资者决策的其他重要信息	84
§13	备查文件目录	84
13.1	备查文件目录	84
13.2	存放地点	84
13.3	查阅方式	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中国 A 股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,641,864,151.26 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。
投资策略	<p>(1) 资产配置: 本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资: 本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资: 本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p>
业绩比较基准	95%×MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场

	的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。
--	-------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		朱学华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31

		层、32 层
--	--	--------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	346,496,610.63	729,536,002.58	166,040,146.56
本期利润	144,569,832.33	807,779,950.49	659,150,370.18
加权平均基金份额本期利润	0.0749	0.2918	0.1958
本期加权平均净值利润率	7.26%	31.50%	25.62%
本期基金份额净值增长率	5.58%	33.77%	39.04%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	1,240,482,757.83	1,608,705,501.03	1,384,476,782.91
期末可供分配基金份额利润	0.7555	0.5892	0.4363
期末基金资产净值	1,740,840,564.87	2,741,468,362.85	2,677,176,392.52
期末基金份额净值	1.060	1.004	0.844
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	627.69%	589.25%	415.25%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	5.79%	0.87%	1.85%	0.71%	3.94%	0.16%
过去六个月	-1.76%	1.04%	-2.66%	0.92%	0.90%	0.12%
过去一年	5.58%	1.21%	0.00%	1.07%	5.58%	0.14%
过去三年	96.37%	1.29%	73.41%	1.23%	22.96%	0.06%
过去五年	76.59%	1.22%	34.92%	1.15%	41.67%	0.07%
自基金合同生 效起至今	627.69%	1.55%	310.46%	1.52%	317.23%	0.03%

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

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

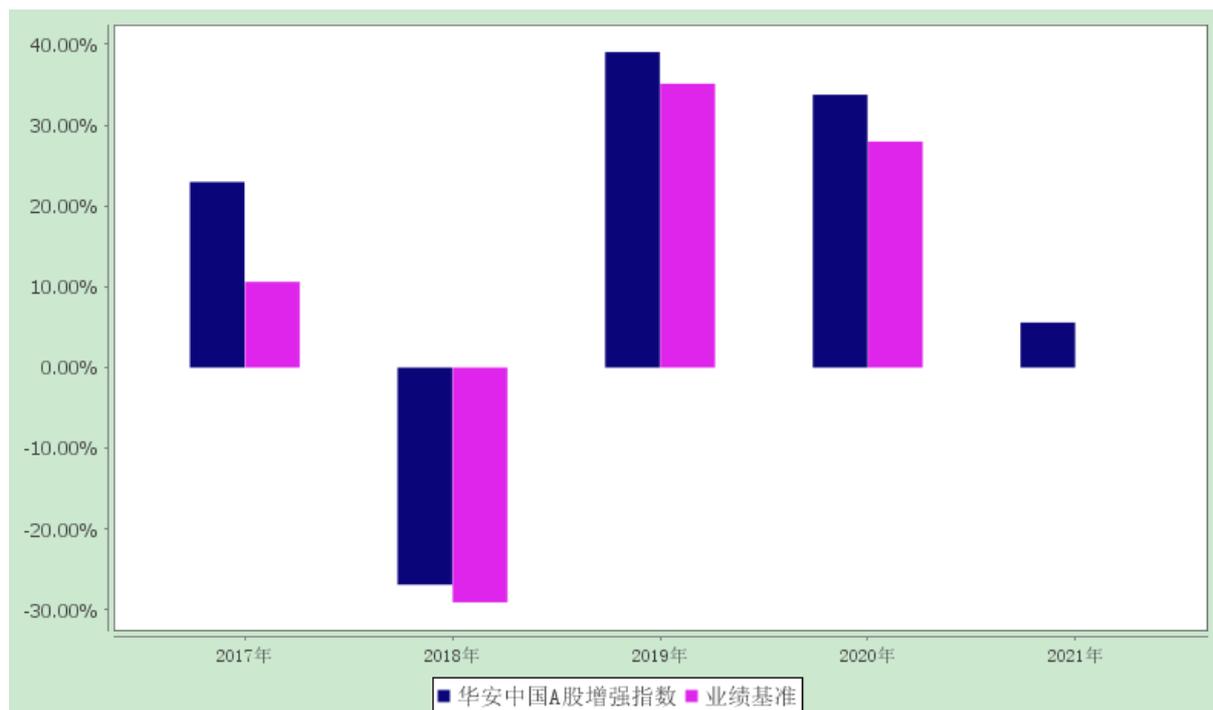
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2002 年 11 月 8 日至 2021 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	-	-	-	-	-
2020年	1.208	195,205,700.39	120,523,005.11	315,728,705.50	-
2019年	-	-	-	-	-
合计	1.208	195,205,700.39	120,523,005.11	315,728,705.50	-

§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12月31

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 188 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,968.62 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	本基金的基金经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2017-12-25	-	18 年	理学博士，18 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，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、华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018年11月起,同时担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年12月起,同时担任华安沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年8月起,同时担任华安沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020年11月起,同时担任华安中证电子50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年10月起,同时担任华安上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
马韬	本基金的基金经理	2018-01-15	-	7年	硕士研究生,7年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017年2月加入华安基金,历任指数与量化投资部数量分析师。2018年1月起担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021年1月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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	12.00	58,592,249,044.88	2008-04-25
	私募资产管理计划	3.00	689,962,322.77	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	15.00	59,282,211,367.65	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理许之彦先生兼任私募资产管理计划投资经理，其薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

在严格执行《基金管理公司公平交易制度指导意见》的基础上，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》，制定了《华安基金管理有限责任公司基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，进一步完善公司的防范利益冲突机制，健全公平交易控制体系和防范利益冲突的管理措施。

投资研究部负责宏观、策略、行业以及上市公司的研究，研究员在为公司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、投资研究会议讨论、研究报告登录在研究报告管理系统中等方式，确保公募基金基金经理与私募资产管理计划投资经理可以公平享有信息获取机会。

公司实行强制公平交易机制，确保公募基金与私募资产管理计划等各投资组合享有公平的交易执行机会，避免在交易环节出现利益冲突的情况。

同一基金经理同时管理公募基金与私募资产管理计划的情况下，兼任的基金经理保持同一个券（股）投资逻辑与决策、交易过程的一致性与同步性，避免出现风格相似的公募基金与私募资产管理计划在同一个期间内业绩偏差较大的情况。

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，并定期对各类投资组合间的同日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合间的隔日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合不同时间窗口下（1日、3日、5日、10日）的同向交易价差进行检查与分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。

本报告期内，同一基金经理管理的各投资组合公平交易执行情况良好，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 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 4 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

2021 年上半年欧美经济持续快速复苏，国内出口持续超预期增长，下半年海外通胀压力上升较快，输入型通胀压力使得国内的工业品价格大幅上涨，国内结构性通胀压力显现。国内经济上半年保持了稳定的增长，但下半年以来随着民营地产违约加剧行业快速下滑，经济增长压力进一步加大。政策调控重心从防风险开始转为稳增长，货币政策从上半年的不急转弯转为下半年的适度宽松。

从全年权益市场的表现来看，市场风格更加偏向于小盘因子，以国证 2000、中证 1000 为代表的小盘股明显跑赢以沪深 300、创业板指为代表的大盘股。权益市场在经历了 2019—2020 连续两年核心资产占优、龙头股效应显著之后开始向中小盘风格蔓延。在这样的背景下，适当扩大策略的选股空间就会显得更加重要。从因子模型的角度来看，除了小市值因子取得较好的收益之外，分析师因子也成为了全年最赚钱的大类因子之一。运用分析师预期变化的指标来进行景气度投资在全年依然取得了不错的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.060 元，本报告期份额净值增长率为 5.58%，同期业绩比较基准增长率为 0.00%。

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 2022 年，海外由于通胀高企，紧缩预期不断增强。国内稳定经济增长的预期依然较强，以经济建设为中心成为重要目标，通胀压力总体可控，货币政策有望继续保持稳健宽松。预计随着各项刺激政策效果的逐步显现，经济有望逐步回升。

权益市场方面主要看好两大投资方向：“稳增长+困境反转”。从大的宏观背景来看，中央经济工作会议重提“以经济建设为中心”、“着力稳定宏观经济”，国内稳定经济增长的预期基本达成共识。以银行、地产、基建为代表的稳增长板块将会具备明显的配置机会。另一方面，虽然当前全球新增新冠确诊数不断攀升，但死亡人数上升缓慢，欧美等发达国家相继实施全面开放政策。在后疫情时代，以酒店、航空、旅游等为代表的出行链条在经历了几年低迷期后将有望迎来困境反转的投资机会。

作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

合规和稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实各项法律法规和监管要求，督促公司各项业务平稳、有序开展。

(3) 强化内控建设，推动落实公司各项业务操作流程标准化，进一步细化各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权

益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公

司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 26944 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交

易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
魏佳亮 楼茜蓉
上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
2022 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	15,462,785.89	98,191,224.13
结算备付金		3,920,491.38	8,508,396.57
存出保证金		366,064.85	645,178.99
交易性金融资产	7.4.7.2	1,721,298,891.18	2,646,839,805.63
其中：股票投资		1,640,147,891.18	2,566,265,890.43
基金投资		-	-
债券投资		81,151,000.00	80,573,915.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,836,033.68	16,167,417.92

应收利息	7.4.7.5	1,829,506.32	2,863,531.20
应收股利		-	-
应收申购款		995,638.12	376,965.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,750,709,411.42	2,773,592,520.41
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2021 年 12 月 31 日	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	12,483,495.12
应付赎回款		1,887,170.27	7,426,277.62
应付管理人报酬		1,476,738.76	2,373,578.14
应付托管费		295,347.75	474,715.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,491,588.98	8,648,989.14
应交税费		0.79	49.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	718,000.00	717,052.11
负债合计		9,868,846.55	32,124,157.56
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	500,357,807.04	832,068,832.68
未分配利润	7.4.7.10	1,240,482,757.83	1,909,399,530.17
所有者权益合计		1,740,840,564.87	2,741,468,362.85

负债和所有者权益总计		1,750,709,411.42	2,773,592,520.41
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.060 元，基金份额总额 1,641,864,151.26 份。

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		188,216,564.44	863,547,546.48
1.利息收入		2,489,651.87	3,478,863.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	251,659.51	490,384.24
债券利息收入		2,237,992.36	2,988,479.24
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）		387,615,857.64	781,653,690.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	367,015,373.30	743,952,631.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,103,215.16	-1,451,462.15
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	18,497,269.18	39,152,520.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-201,926,778.30	78,243,947.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	37,833.23	171,044.60
减：二、费用		43,646,732.11	55,767,595.99
1. 管理人报酬		19,924,759.75	25,572,453.87
2. 托管费		3,984,951.94	5,114,490.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	19,500,159.48	24,844,828.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		12.71	36.28
7. 其他费用	7.4.7.19	236,848.23	235,786.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		144,569,832.33	807,779,950.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		144,569,832.33	807,779,950.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	832,068,832.68	1,909,399,530.17	2,741,468,362.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	144,569,832.33	144,569,832.33
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	-331,711,025.64	-813,486,604.67	-1,145,197,630.31

列)			
其中：1.基金申购款	105,817,333.32	251,334,195.87	357,151,529.19
2.基金赎回款	-437,528,358.96	-1,064,820,800.54	-1,502,349,159.50
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）	500,357,807.04	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	967,114,844.88	1,710,061,547.64	2,677,176,392.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	807,779,950.49	807,779,950.49
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）	-135,046,012.20	-292,713,262.46	-427,759,274.66
其中：1.基金申购款	424,416,954.87	921,949,604.35	1,346,366,559.22
2.基金赎回款	-559,462,967.07	-1,214,662,866.81	-1,774,125,833.88
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）	-	-315,728,705.50	-315,728,705.50
五、期末所有者权益（基金净值）	832,068,832.68	1,909,399,530.17	2,741,468,362.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 3.281806547，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)。本基金投资于股票(含存托凭证)的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票(含存托凭证)一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票(含存托凭证)投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金

不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按

直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	15,462,785.89	98,191,224.13
定期存款	-	-

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	-	-
合计	15,462,785.89	98,191,224.13

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,538,954,052.46	1,640,147,891.18	101,193,838.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,127,000.00	1,127,000.00	-
	银行间市场	79,857,600.00	80,024,000.00	166,400.00
	合计	80,984,600.00	81,151,000.00	166,400.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,619,938,652.46	1,721,298,891.18	101,360,238.72
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,260,939,668.61	2,566,265,890.43	305,326,221.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	196,000.00	197,915.20	1,915.20
	银行间市场	82,417,120.00	80,376,000.00	-2,041,120.00

	合计	82,613,120.00	80,573,915.20	-2,039,204.80
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,343,552,788.61	2,646,839,805.63	303,287,017.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,779.73	11,403.01
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	1,764.20	3,828.70
应收债券利息	1,825,797.69	2,848,009.09
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	-	-
其他	164.70	290.40
合计	1,829,506.32	2,863,531.20

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,489,157.79	8,646,557.95
银行间市场应付交易费用	2,431.19	2,431.19
合计	5,491,588.98	8,648,989.14

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	52.11
预提信息披露费	-	-
预提审计费	-	-
其他	-	-
预提费用	218,000.00	217,000.00
合计	718,000.00	717,052.11

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,730,307,040.56	832,068,832.68
本期申购	347,235,925.93	105,817,333.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,435,678,815.23	-437,528,358.96
本期末	1,641,864,151.26	500,357,807.04

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	1,608,705,501.03	300,694,029.14	1,909,399,530.17
本期利润	346,496,610.63	-201,926,778.30	144,569,832.33
本期基金份额交易产生的变动数	-713,323,691.28	-100,162,913.39	-813,486,604.67
其中：基金申购款	239,611,285.41	11,722,910.46	251,334,195.87
基金赎回款	-952,934,976.69	-111,885,823.85	-1,064,820,800.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,241,878,420.38	-1,395,662.55	1,240,482,757.83

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	169,581.62	389,441.69
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	72,917.54	93,275.52
其他	9,160.35	7,667.03
合计	251,659.51	490,384.24

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,805,930,634.49	8,466,811,729.80
减：卖出股票成本总额	6,438,915,261.19	7,722,859,098.15
买卖股票差价收入	367,015,373.30	743,952,631.65

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,103,215.16	-1,451,462.15
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	2,103,215.16	-1,451,462.15

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	95,636,835.21	223,274,556.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	89,897,420.00	222,220,166.31
减：应收利息总额	3,636,200.05	2,505,852.33
买卖债券差价收入	2,103,215.16	-1,451,462.15

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	18,497,269.18	39,152,520.99

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	18,497,269.18	39,152,520.99

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-201,926,778.30	78,243,947.91
——股票投资	-204,132,383.10	80,631,906.71
——债券投资	2,205,604.80	-2,387,958.80
——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	-201,926,778.30	78,243,947.91

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	33,808.13	127,223.29
转换费收入	4,025.10	43,380.99
其他	-	440.32
合计	37,833.23	171,044.60

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	19,499,809.48	24,844,053.90
银行间市场交易费用	350.00	775.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	19,500,159.48	24,844,828.90

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	98,000.00	97,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	848.23	786.05
合计	236,848.23	235,786.05

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据华安基金管理有限公司于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2022]469 号文核准，华安基金管理有限公司股东上海上国投资管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：（1）下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经华安基金管理有限公司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，华安基金管理有限公司股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,668,887,109.55	29.37%	2,635,906,440.54	16.38%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	2,319,808.30	11.36%	35,376,719.80	15.40%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,416,833.61	29.72%	821,528.27	14.97%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	2,454,817.60	16.58%	1,602,396.60	18.53%

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,924,759.75	25,572,453.87
其中：支付销售机构的客户维护费	5,166,413.72	1,140,927.14

注：支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 1.00% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,984,951.94	5,114,490.89

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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

无。

7.4.10.5 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12月31日		2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	15,462,785.89	169,581.62	98,191,224.13	389,441.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安证券股份有限公司	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安证券股份有限公司	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安证券股份有限公司	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安证券股份有限公司	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安证券股份有限公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安证券股份有限公司	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安证券股份有限公司	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安证券股份有限公司	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68

公司					
国泰君安证 券股份有限 公司	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安证 券股份有限 公司	113042	上银转债	老股东配 售	310.00	31,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688718	唯赛勃	网下申购	3,145.00	18,490.24
国泰君安证 券股份有限 公司	301037	保立佳	网下申购	1,923.00	28,498.86
国泰君安证 券股份有限 公司	605507	国邦医药	网下申购	1,202.00	39,149.14
国泰君安证 券股份有限 公司	605589	圣泉集团	网下申购	1,750.00	42,017.50
国泰君安证 券股份有限 公司	601825	沪农商行	网下申购	15,480.00	137,772.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688187	时代电气	网下申购	21,843.00	688,860.51
国泰君安证 券股份有限 公司	688767	博拓生物	网下申购	2,220.00	77,084.51
国泰君安证 券股份有限 公司	688232	新点软件	网下申购	18,893.00	920,702.18
国泰君安证 券股份有限 公司	688190	云路股份	网下申购	3,026.00	141,807.89
国泰君安证 券股份有限 公司	688235	百济神州	网下申购	15,854.00	3,068,747.80
国泰君安证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	老股东配 售	9,830.00	983,000.00
上年度可比期间					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单 位：股/张）	总金额
国泰君安证 券股份有限 公司	688286	敏芯股份	网下申购	1,681.00	105,875.01
国泰君安证 券股份有限 公司	605066	天正电气	网下申购	1,278.00	12,805.56
国泰君安证 券股份有限 公司	688339	亿华通	网下申购	2,761.00	212,688.80
国泰君安证 券股份有限 公司	688229	博睿数据	网下申购	1,643.00	108,682.97
国泰君安证 券股份有限 公司	605388	均瑶健康	网下申购	1,230.00	16,518.90
国泰君安证 券股份有限 公司	688017	绿的谐波	网下申购	4,138.00	145,803.67
国泰君安证 券股份有限 公司	688095	福昕软件	网下申购	1,981.00	474,890.57
国泰君安证 券股份有限 公司	603112	华翔股份	网下申购	920.00	7,194.40
国泰君安证 券股份有限 公司	688698	伟创电气	网下申购	4,751.00	51,328.62
国泰君安证 券股份有限 公司	003003	天元股份	网下申购	756.00	7,930.44
国泰君安证 券股份有限 公司	113044	大秦转债	老股东配 售	390.00	39,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

(1)于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 1,600 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 28,565.47 元，估值总额为人民币 28,624.00 元，占基金资产净值的比例为 0.002%(2020 年 12 月 31

日：本基金持有 343,800 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 6,138,005.80 元，估值总额为人民币 6,026,814.00 元，占基金资产净值的比例为 0.22%)。

(2) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 36,900.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 184,500.00 元，估值总额为人民币 170,847.00 元，占基金资产净值的比例为 0.01% (2020 年 12 月 31 日：本基金持有 40,300.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 201,500.00 元，估值总额为人民币 201,097.00 元，占基金资产净值的比例为 0.01%)。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股限售	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688206	概伦电子	2021-12-20	2022-06-28	新股限售	28.28	33.01	6,000	169,680.00	198,060.00	-
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股限售	116.88	116.08	674	78,777.12	78,237.92	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
30106	凯盛	2021-	2022-	新股	5.17	44.21	539	2,786.	23,829	-

9	新材	09-16	03-28	限售				63	.19	
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股限售	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	新股限售	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股限售	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股限售	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股限售	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股限售	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股限售	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股限售	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股限售	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新股限售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
30119	家联	2021-	2022-	新股	30.73	29.14	297	9,126.	8,654.	-

3	科技	12-02	06-09	限售				81	58	
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股限售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

7.4.12.1.2 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-28	2022-01-14	配债未上市	100.00	100.00	9,830	983,000.00	983,000.00	-
113634	珀莱转债	2021-12-09	2022-01-04	配债未上市	100.00	100.00	1,440	144,000.00	144,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	宏大爆破	2021-12-20	重大事项	30.12	2022-01-04	31.00	1,900	106,510.38	57,228.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.06%(2020 年 12 月 31 日:0.01%)。

7.4.13.3 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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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期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%(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 7.4.12。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%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.24%。

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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 1,740,441,606.88 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	15,462,785.89	-	-	-	15,462,785.89
结算备付金	3,920,491.38	-	-	-	3,920,491.38
存出保证金	366,064.85	-	-	-	366,064.85
交易性金融资产	81,151,000.00	-	-	1,640,147,891.18	1,721,298,891.18
应收证券清算款	-	-	-	6,836,033.68	6,836,033.68
应收利息	-	-	-	1,829,506.32	1,829,506.32
应收申购款	-	-	-	995,638.12	995,638.12
资产总计	100,900,342.12	-	-	1,649,809,069.30	1,750,709,411.42
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	-	-	-	1,887,170.27	1,887,170.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,476,738.76	1,476,738.76
应付托管费	-	-	-	295,347.75	295,347.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,491,588.98	5,491,588.98
应交税费	-	-	-	0.79	0.79
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	718,000.00	718,000.00
负债总计	-	-	-	9,868,846.55	9,868,846.55

利率敏感度缺口	100,900,342.12	-	-	1,639,940,222.75	1,740,840,564.87
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	98,191,224.13	-	-	-	98,191,224.13
结算备付金	8,508,396.57	-	-	-	8,508,396.57
存出保证金	645,178.99	-	-	-	645,178.99
交易性金融资产	80,573,915.20	-	-	2,566,265,890.43	2,646,839,805.63
应收证券清算款	-	-	-	16,167,417.92	16,167,417.92
应收利息	-	-	-	2,863,531.20	2,863,531.20
应收申购款	-	-	-	376,965.97	376,965.97
资产总计	187,918,714.89	-	-	2,585,673,805.52	2,773,592,520.41
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	-	-	-	12,483,495.12	12,483,495.12
应付赎回款	-	-	-	7,426,277.62	7,426,277.62
应付管理人报酬	-	-	-	2,373,578.14	2,373,578.14
应付托管费	-	-	-	474,715.63	474,715.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,648,989.14	8,648,989.14
应交税费	-	-	-	49.80	49.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	717,052.11	717,052.11
负债总计	-	-	-	32,124,157.56	32,124,157.56
利率敏感度缺口	187,918,714.89	-	-	2,553,549,647.96	2,741,468,362.85

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 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 4.66%(2020 年 12 月 31 日：2.94%)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)，投资组合中股票(含存托凭证)投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,640,147,891.18	94.22	2,566,265,890.43	93.61
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	-	-	-	-
合计	1,640,147,891.18	94.22	2,566,265,890.43	93.61

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	94,200,000.00	142,040,000.00
	2.业绩比较基准下降 5%	-94,200,000.00	-142,040,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 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中属于第一层次的余额为 1,637,123,149.19 元, 属于第二层次的余额为 81,213,732.49 元, 属于第三层次的余额为 2,962,009.50 元(2020 年 12 月 31 日: 第一层次 2,559,333,070.58 元, 第二层次 87,506,735.05 元, 无第三层次)。

(ii) 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。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 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股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于 2021 年 1 月 1 日, 本基金未持有第三层次资产。2021 年度购买第三层次资产金额为 5,704,678.81 元。于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的第三层次资产的账面价值为 2,962,009.50 元(2020 年 12 月 31 日: 无)。2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额为 527,882.73 元 (2020 年度: 无)。

于 2021 年 12 月 31 日, 上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值, 不可观察输入值为预期波动率, 与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定, 以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日, 本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质, 新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,640,147,891.18	93.68
	其中：股票	1,640,147,891.18	93.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,151,000.00	4.64
	其中：债券	81,151,000.00	4.64
	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	19,383,277.27	1.11
8	其他各项资产	10,027,242.97	0.57
9	合计	1,750,709,411.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,579,134.20	0.67
B	采矿业	48,969,392.10	2.81
C	制造业	940,525,742.25	54.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,853,942.00	0.11
E	建筑业	7,053.40	0.00
F	批发和零售业	93,625.50	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	42,376,751.16	2.43
H	住宿和餐饮业	3,554,237.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,217,033.17	4.90
J	金融业	185,821,552.32	10.67
K	房地产业	20,740,693.28	1.19
L	租赁和商务服务业	49,220,617.13	2.83
M	科学研究和技术服务业	70,890,462.10	4.07
N	水利、环境和公共设施管理业	9,999.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	409,585.53	0.02
R	文化、体育和娱乐业	31,167,905.08	1.79
S	综合	888.00	0.00
	合计	1,492,438,613.22	85.73

8.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

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	901.60	0.00
B	采矿业	685.00	0.00

C	制造业	117,727,063.21	6.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,173,742.30	0.30
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	349,680.42	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	446,458.38	0.03
J	金融业	765.00	0.00
K	房地产业	16,752,320.00	0.96
L	租赁和商务服务业	1,364.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	142,783.91	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,034,295.84	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,008.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,082.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	147,709,277.96	8.48

8.3 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

8.3.1 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	64,333	131,882,650.00	7.58
2	300750	宁德时代	126,251	74,235,588.00	4.26
3	600036	招商银行	1,380,700	67,253,897.00	3.86
4	603259	药明康德	446,657	52,964,587.06	3.04
5	000333	美的集团	587,785	43,384,410.85	2.49
6	601888	中国中免	182,070	39,947,978.70	2.29
7	601012	隆基股份	414,651	35,742,916.20	2.05
8	601111	中国国航	3,730,332	34,057,931.16	1.96

9	002311	海大集团	415,200	30,434,160.00	1.75
10	300274	阳光电源	208,500	30,399,300.00	1.75
11	601899	紫金矿业	2,972,183	28,830,175.10	1.66
12	600703	三安光电	762,300	28,631,988.00	1.64
13	600030	中信证券	1,068,742	28,225,476.22	1.62
14	002475	立讯精密	551,032	27,110,774.40	1.56
15	300760	迈瑞医疗	70,788	26,956,070.40	1.55
16	600570	恒生电子	410,540	25,515,061.00	1.47
17	300144	宋城演艺	1,663,000	23,814,160.00	1.37
18	002371	北方华创	67,300	23,354,446.00	1.34
19	300661	圣邦股份	73,300	22,649,700.00	1.30
20	002415	海康威视	430,621	22,530,090.72	1.29
21	300014	亿纬锂能	187,800	22,194,204.00	1.27
22	603613	国联股份	204,255	21,957,412.50	1.26
23	600893	航发动力	333,252	21,148,171.92	1.21
24	000002	万 科 A	1,048,313	20,714,664.88	1.19
25	000858	五粮液	87,244	19,425,749.04	1.12
26	002466	天齐锂业	178,500	19,099,500.00	1.10
27	300122	智飞生物	150,800	18,789,680.00	1.08
28	603501	韦尔股份	59,741	18,565,710.57	1.07
29	300012	华测检测	666,532	17,909,714.84	1.03
30	300124	汇川技术	253,500	17,390,100.00	1.00
31	600690	海尔智家	561,720	16,789,810.80	0.96
32	600845	宝信软件	271,110	16,491,621.30	0.95
33	601688	华泰证券	926,824	16,460,394.24	0.95
34	002594	比亚迪	60,200	16,140,824.00	0.93
35	300037	新宙邦	135,700	15,334,100.00	0.88
36	002049	紫光国微	67,118	15,101,550.00	0.87
37	600188	兖矿能源	623,100	14,661,543.00	0.84
38	000938	紫光股份	634,400	14,496,040.00	0.83
39	002821	凯莱英	33,300	14,485,500.00	0.83
40	000001	平安银行	835,121	13,762,794.08	0.79
41	600741	华域汽车	476,854	13,494,968.20	0.78
42	600176	中国巨石	732,700	13,335,140.00	0.77
43	000776	广发证券	538,445	13,240,362.55	0.76
44	300033	同花顺	89,400	12,925,452.00	0.74
45	300769	德方纳米	25,200	12,377,232.00	0.71
46	002138	顺络电子	323,000	12,332,140.00	0.71
47	603338	浙江鼎力	152,657	12,252,250.82	0.70
48	300408	三环集团	271,516	12,109,613.60	0.70
49	688050	爱博医疗	56,161	11,806,727.03	0.68
50	002714	牧原股份	216,820	11,569,515.20	0.66
51	002056	横店东磁	596,400	11,254,068.00	0.65
52	300059	东方财富	302,595	11,229,300.45	0.65

53	300896	爱美客	19,800	10,614,978.00	0.61
54	603707	健友股份	241,000	10,122,000.00	0.58
55	002027	分众传媒	1,128,237	9,240,261.03	0.53
56	688111	金山办公	33,234	8,807,010.00	0.51
57	002747	埃斯顿	329,500	8,550,525.00	0.49
58	002142	宁波银行	222,410	8,513,854.80	0.49
59	688200	华峰测控	16,157	8,270,768.30	0.48
60	601166	兴业银行	408,400	7,775,936.00	0.45
61	002384	东山精密	286,400	7,761,440.00	0.45
62	002409	雅克科技	93,000	7,548,810.00	0.43
63	600346	恒力石化	322,480	7,407,365.60	0.43
64	300413	芒果超媒	126,790	7,254,923.80	0.42
65	688099	晶晨股份	54,602	7,109,180.40	0.41
66	600029	南方航空	1,034,200	7,042,902.00	0.40
67	002460	赣锋锂业	48,300	6,899,655.00	0.40
68	000063	中兴通讯	185,700	6,220,950.00	0.36
69	600111	北方稀土	132,100	6,050,180.00	0.35
70	603605	珀莱雅	28,900	6,020,159.00	0.35
71	002493	荣盛石化	316,450	5,746,732.00	0.33
72	002705	新宝股份	210,700	5,204,290.00	0.30
73	601699	潞安环能	457,500	5,174,325.00	0.30
74	601377	兴业证券	523,400	5,171,192.00	0.30
75	002841	视源股份	58,861	4,791,285.40	0.28
76	002850	科达利	23,300	3,735,922.00	0.21
77	600258	首旅酒店	134,900	3,524,937.00	0.20
78	300496	中科创达	25,300	3,502,026.00	0.20
79	601058	赛轮轮胎	224,600	3,321,834.00	0.19
80	002050	三花智控	128,000	3,238,400.00	0.19
81	600011	华能国际	190,200	1,843,038.00	0.11
82	601633	长城汽车	35,894	1,742,294.76	0.10
83	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.10
84	002352	顺丰控股	17,000	1,171,640.00	0.07
85	601318	中国平安	4,834	243,681.94	0.01
86	300015	爱尔眼科	5,575	235,711.00	0.01
87	300285	国瓷材料	4,200	178,794.00	0.01
88	601939	建设银行	30,000	175,800.00	0.01
89	601398	工商银行	36,900	170,847.00	0.01
90	601288	农业银行	56,700	166,698.00	0.01
91	300244	迪安诊断	4,829	162,109.53	0.01
92	601229	上海银行	22,300	158,999.00	0.01
93	600000	浦发银行	17,800	151,834.00	0.01
94	000975	银泰黄金	15,100	132,578.00	0.01
95	600016	民生银行	32,900	128,310.00	0.01
96	603288	海天味业	1,201	126,237.11	0.01

97	000977	浪潮信息	3,162	113,294.46	0.01
98	601857	中国石油	21,000	103,110.00	0.01
99	300450	先导智能	1,357	100,920.09	0.01
100	601766	中国中车	16,200	98,658.00	0.01
101	601006	大秦铁路	14,600	93,440.00	0.01
102	002739	万达电影	5,886	91,115.28	0.01
103	603444	吉比特	200	84,370.00	0.00
104	000538	云南白药	800	83,720.00	0.00
105	600352	浙江龙盛	5,700	71,991.00	0.00
106	603019	中科曙光	2,500	68,925.00	0.00
107	000401	冀东水泥	5,500	65,780.00	0.00
108	002080	中材科技	1,844	62,732.88	0.00
109	002683	宏大爆破	1,900	57,228.00	0.00
110	000895	双汇发展	1,800	56,790.00	0.00
111	002727	一心堂	1,400	53,914.00	0.00
112	688981	中芯国际	1,000	52,990.00	0.00
113	000876	新希望	2,900	44,109.00	0.00
114	002001	新和成	1,039	32,333.68	0.00
115	002127	南极电商	4,496	31,022.40	0.00
116	600754	锦江酒店	500	29,300.00	0.00
117	601211	国泰君安	1,600	28,624.00	0.00
118	000800	一汽解放	2,600	26,754.00	0.00
119	000568	泸州老窖	100	25,387.00	0.00
120	002812	恩捷股份	100	25,040.00	0.00
121	603659	璞泰来	140	22,485.40	0.00
122	603160	汇顶科技	200	21,554.00	0.00
123	603799	华友钴业	191	21,069.21	0.00
124	601360	三六零	1,500	19,080.00	0.00
125	603267	鸿远电子	100	17,944.00	0.00
126	603127	昭衍新药	140	16,160.20	0.00
127	300595	欧普康视	280	16,063.60	0.00
128	300474	景嘉微	100	15,220.00	0.00
129	600132	重庆啤酒	100	15,132.00	0.00
130	603486	科沃斯	100	15,095.00	0.00
131	002920	德赛西威	100	14,151.00	0.00
132	300223	北京君正	100	13,400.00	0.00
133	001979	招商蛇口	1,000	13,340.00	0.00
134	600745	闻泰科技	100	12,930.00	0.00
135	603899	晨光文具	200	12,902.00	0.00
136	002916	深南电路	100	12,182.00	0.00
137	600779	水井坊	100	11,999.00	0.00
138	603882	金城医学	100	11,137.00	0.00
139	601877	正泰电器	200	10,778.00	0.00
140	002179	中航光电	100	10,056.00	0.00

141	300726	宏达电子	100	10,006.00	0.00
142	600600	青岛啤酒	100	9,900.00	0.00
143	600760	中航沈飞	140	9,525.60	0.00
144	002459	晶澳科技	100	9,270.00	0.00
145	300363	博腾股份	100	8,945.00	0.00
146	300747	锐科激光	150	8,866.50	0.00
147	600529	山东药玻	200	8,780.00	0.00
148	300073	当升科技	100	8,687.00	0.00
149	300699	光威复材	100	8,448.00	0.00
150	002568	百润股份	140	8,376.20	0.00
151	300628	亿联网络	100	8,145.00	0.00
152	300618	寒锐钴业	100	8,018.00	0.00
153	300558	贝达药业	100	7,983.00	0.00
154	603816	顾家家居	100	7,716.00	0.00
155	603678	火炬电子	100	7,565.00	0.00
156	300567	精测电子	100	7,243.00	0.00
157	603939	益丰药房	130	7,164.30	0.00
158	603658	安图生物	130	7,157.80	0.00
159	603589	口子窖	100	7,087.00	0.00
160	300316	晶盛机电	100	6,950.00	0.00
161	603517	绝味食品	100	6,833.00	0.00
162	300251	光线传媒	500	6,425.00	0.00
163	300999	金龙鱼	100	6,293.00	0.00
164	600584	长电科技	200	6,204.00	0.00
165	002557	洽洽食品	100	6,136.00	0.00
166	002925	盈趣科技	170	5,785.10	0.00
167	300357	我武生物	100	5,730.00	0.00
168	300142	沃森生物	100	5,620.00	0.00
169	002648	卫星化学	140	5,604.20	0.00
170	002268	卫士通	100	5,594.00	0.00
171	300502	新易盛	140	5,485.20	0.00
172	603369	今世缘	100	5,440.00	0.00
173	600460	士兰微	100	5,420.00	0.00
174	000400	许继电气	200	5,220.00	0.00
175	002146	荣盛发展	1,200	5,220.00	0.00
176	002074	国轩高科	100	5,125.00	0.00
177	603233	大参林	120	5,053.20	0.00
178	300253	卫宁健康	300	5,028.00	0.00
179	600536	中国软件	100	4,993.00	0.00
180	603883	老百姓	100	4,938.00	0.00
181	000423	东阿阿胶	100	4,875.00	0.00
182	002180	纳思达	100	4,776.00	0.00
183	600660	福耀玻璃	100	4,714.00	0.00
184	002236	大华股份	200	4,696.00	0.00

185	300433	蓝思科技	200	4,596.00	0.00
186	600085	同仁堂	100	4,498.00	0.00
187	603638	艾迪精密	140	4,468.80	0.00
188	603712	七一二	100	4,330.00	0.00
189	300308	中际旭创	100	4,250.00	0.00
190	002938	鹏鼎控股	100	4,243.00	0.00
191	600089	特变电工	200	4,234.00	0.00
192	600323	瀚蓝环境	200	4,196.00	0.00
193	002129	中环股份	100	4,175.00	0.00
194	600315	上海家化	100	4,041.00	0.00
195	002153	石基信息	140	4,023.60	0.00
196	000963	华东医药	100	4,020.00	0.00
197	002353	杰瑞股份	100	4,000.00	0.00
198	603866	桃李面包	140	3,976.00	0.00
199	002151	北斗星通	100	3,925.00	0.00
200	600316	洪都航空	100	3,906.00	0.00
201	000831	五矿稀土	100	3,902.00	0.00
202	603927	中科软	140	3,830.40	0.00
203	000860	顺鑫农业	100	3,818.00	0.00
204	002223	鱼跃医疗	100	3,780.00	0.00
205	002507	涪陵榨菜	100	3,780.00	0.00
206	002690	美亚光电	100	3,746.00	0.00
207	601966	玲珑轮胎	100	3,655.00	0.00
208	603568	伟明环保	100	3,653.00	0.00
209	000768	中航西飞	100	3,650.00	0.00
210	002508	老板电器	100	3,602.00	0.00
211	600862	中航高科	100	3,576.00	0.00
212	300212	易华录	100	3,535.00	0.00
213	600999	招商证券	200	3,530.00	0.00
214	000999	华润三九	100	3,424.00	0.00
215	600332	白云山	100	3,420.00	0.00
216	002414	高德红外	140	3,389.40	0.00
217	002831	裕同科技	100	3,369.00	0.00
218	603218	日月股份	100	3,295.00	0.00
219	600884	杉杉股份	100	3,277.00	0.00
220	002030	达安基因	160	3,209.60	0.00
221	600511	国药股份	100	3,153.00	0.00
222	002626	金达威	100	3,133.00	0.00
223	000738	航发控制	100	3,028.00	0.00
224	002430	杭氧股份	100	3,001.00	0.00
225	300298	三诺生物	100	2,991.00	0.00
226	600998	九州通	200	2,944.00	0.00
227	601066	中信建投	100	2,925.00	0.00
228	300463	迈克生物	100	2,919.00	0.00

229	300773	拉卡拉	100	2,902.00	0.00
230	600161	天坛生物	100	2,896.00	0.00
231	603027	千禾味业	120	2,889.60	0.00
232	002497	雅化集团	100	2,866.00	0.00
233	002439	启明星辰	100	2,853.00	0.00
234	603156	养元饮品	100	2,841.00	0.00
235	600559	老白干酒	100	2,794.00	0.00
236	000988	华工科技	100	2,786.00	0.00
237	002389	航天彩虹	100	2,780.00	0.00
238	002595	豪迈科技	100	2,776.00	0.00
239	002603	以岭药业	140	2,744.00	0.00
240	002294	信立泰	100	2,732.00	0.00
241	600118	中国卫星	100	2,715.00	0.00
242	600859	王府井	100	2,700.00	0.00
243	300146	汤臣倍健	100	2,696.00	0.00
244	601615	明阳智能	100	2,610.00	0.00
245	600150	中国船舶	100	2,479.00	0.00
246	002299	圣农发展	100	2,417.00	0.00
247	002625	光启技术	100	2,401.00	0.00
248	000951	中国重汽	140	2,364.60	0.00
249	600183	生益科技	100	2,355.00	0.00
250	600685	中船防务	100	2,333.00	0.00
251	002281	光迅科技	100	2,329.00	0.00
252	000998	隆平高科	100	2,326.00	0.00
253	300418	昆仑万维	100	2,315.00	0.00
254	600549	厦门钨业	100	2,263.00	0.00
255	600079	人福医药	100	2,252.00	0.00
256	601088	中国神华	100	2,252.00	0.00
257	600372	中航电子	100	2,239.00	0.00
258	600362	江西铜业	100	2,233.00	0.00
259	601231	环旭电子	139	2,232.34	0.00
260	002216	三全食品	110	2,223.10	0.00
261	002572	索菲亚	100	2,220.00	0.00
262	600699	均胜电子	100	2,197.00	0.00
263	600521	华海药业	100	2,166.00	0.00
264	000581	威孚高科	100	2,154.00	0.00
265	600875	东方电气	100	2,142.00	0.00
266	603858	步长制药	100	2,109.00	0.00
267	002120	韵达股份	100	2,046.00	0.00
268	000672	上峰水泥	100	2,007.00	0.00
269	601607	上海医药	100	1,987.00	0.00
270	600482	中国动力	100	1,970.00	0.00
271	600392	盛和资源	100	1,962.00	0.00
272	000960	锡业股份	100	1,953.00	0.00

273	600739	辽宁成大	100	1,952.00	0.00
274	002156	通富微电	100	1,943.00	0.00
275	600801	华新水泥	100	1,930.00	0.00
276	300498	温氏股份	100	1,926.00	0.00
277	002212	天融信	100	1,917.00	0.00
278	002422	科伦药业	100	1,893.00	0.00
279	600637	东方明珠	200	1,890.00	0.00
280	000623	吉林敖东	100	1,847.00	0.00
281	600803	新奥股份	100	1,836.00	0.00
282	002463	沪电股份	110	1,823.80	0.00
283	002013	中航机电	100	1,818.00	0.00
284	000997	新大陆	100	1,812.00	0.00
285	600498	烽火通信	100	1,798.00	0.00
286	002250	联化科技	100	1,797.00	0.00
287	000338	潍柴动力	100	1,789.00	0.00
288	600848	上海临港	120	1,784.40	0.00
289	603885	吉祥航空	100	1,775.00	0.00
290	002019	亿帆医药	100	1,762.00	0.00
291	600418	江淮汽车	100	1,740.00	0.00
292	000039	中集集团	100	1,716.00	0.00
293	002511	中顺洁柔	100	1,671.00	0.00
294	000547	航天发展	100	1,670.00	0.00
295	600233	圆通速递	100	1,668.00	0.00
296	601985	中国核电	200	1,660.00	0.00
297	600201	生物股份	100	1,635.00	0.00
298	002382	蓝帆医疗	100	1,629.00	0.00
299	000723	美锦能源	100	1,623.00	0.00
300	600305	恒顺醋业	100	1,595.00	0.00
301	600535	天士力	100	1,585.00	0.00
302	000021	深科技	100	1,584.00	0.00
303	300009	安科生物	120	1,570.80	0.00
304	002262	恩华药业	100	1,565.00	0.00
305	000830	鲁西化工	100	1,526.00	0.00
306	002191	劲嘉股份	100	1,513.00	0.00
307	600487	亨通光电	100	1,512.00	0.00
308	600895	张江高科	100	1,506.00	0.00
309	002373	千方科技	100	1,495.00	0.00
310	002128	电投能源	100	1,485.00	0.00
311	300383	光环新网	100	1,484.00	0.00
312	600958	东方证券	100	1,474.00	0.00
313	600598	北大荒	100	1,456.00	0.00
314	600597	光明乳业	100	1,452.00	0.00
315	603000	人民网	100	1,442.00	0.00
316	300070	碧水源	200	1,438.00	0.00

317	600019	宝钢股份	200	1,432.00	0.00
318	000066	中国长城	100	1,416.00	0.00
319	000069	华侨城 A	200	1,408.00	0.00
320	002436	兴森科技	100	1,400.00	0.00
321	601168	西部矿业	100	1,361.00	0.00
322	600060	海信视像	100	1,345.00	0.00
323	000878	云南铜业	100	1,337.00	0.00
324	600827	百联股份	100	1,333.00	0.00
325	300088	长信科技	100	1,328.00	0.00
326	601878	浙商证券	100	1,318.00	0.00
327	000050	深天马 A	100	1,302.00	0.00
328	002939	长城证券	100	1,295.00	0.00
329	600160	巨化股份	100	1,291.00	0.00
330	600380	健康元	100	1,284.00	0.00
331	600977	中国电影	100	1,281.00	0.00
332	002185	华天科技	100	1,271.00	0.00
333	002221	东华能源	100	1,259.00	0.00
334	600143	金发科技	100	1,258.00	0.00
335	600674	川投能源	100	1,250.00	0.00
336	600061	国投资本	152	1,249.44	0.00
337	002203	海亮股份	100	1,243.00	0.00
338	601225	陕西煤业	100	1,220.00	0.00
339	600004	白云机场	100	1,206.00	0.00
340	601117	中国化学	100	1,200.00	0.00
341	601838	成都银行	100	1,200.00	0.00
342	002558	巨人网络	100	1,197.00	0.00
343	600967	内蒙一机	100	1,195.00	0.00
344	002152	广电运通	100	1,190.00	0.00
345	000987	越秀金控	135	1,174.50	0.00
346	601198	东兴证券	100	1,163.00	0.00
347	601555	东吴证券	130	1,151.80	0.00
348	002078	太阳纸业	100	1,149.00	0.00
349	002736	国信证券	100	1,148.00	0.00
350	600886	国投电力	100	1,147.00	0.00
351	601881	中国银河	100	1,119.00	0.00
352	000807	云铝股份	100	1,117.00	0.00
353	300024	机器人	100	1,117.00	0.00
354	601108	财通证券	100	1,112.00	0.00
355	600066	宇通客车	100	1,102.00	0.00
356	600867	通化东宝	100	1,096.00	0.00
357	002465	海格通信	100	1,092.00	0.00
358	000930	中粮科技	100	1,087.00	0.00
359	600516	方大炭素	100	1,082.00	0.00
360	002385	大北农	100	1,049.00	0.00

361	002340	格林美	100	1,035.00	0.00
362	600655	豫园股份	100	1,030.00	0.00
363	300296	利亚德	100	1,025.00	0.00
364	300376	易事特	100	1,005.00	0.00
365	600155	华创阳安	100	996.00	0.00
366	601990	南京证券	100	991.00	0.00
367	002926	华西证券	100	985.00	0.00
368	601727	上海电气	200	972.00	0.00
369	002456	欧菲光	100	970.00	0.00
370	002157	正邦科技	100	966.00	0.00
371	002092	中泰化学	100	954.00	0.00
372	600737	中粮糖业	100	940.00	0.00
373	600606	绿地控股	210	911.40	0.00
374	600153	建发股份	100	907.00	0.00
375	600673	东阳光	100	888.00	0.00
376	000686	东北证券	100	878.00	0.00
377	002010	传化智联	100	870.00	0.00
378	601800	中国交建	100	858.00	0.00
379	600500	中化国际	100	856.00	0.00
380	000729	燕京啤酒	100	847.00	0.00
381	601989	中国重工	200	844.00	0.00
382	002602	世纪华通	100	839.00	0.00
383	000983	山西焦煤	100	827.00	0.00
384	600879	航天电子	100	824.00	0.00
385	600489	中金黄金	100	823.00	0.00
386	600528	中铁工业	100	821.00	0.00
387	000027	深圳能源	100	810.00	0.00
388	600667	太极实业	100	808.00	0.00
389	601669	中国电建	100	808.00	0.00
390	002673	西部证券	100	807.00	0.00
391	601901	方正证券	100	784.00	0.00
392	002065	东华软件	100	780.00	0.00
393	600507	方大特钢	100	780.00	0.00
394	002563	森马服饰	100	773.00	0.00
395	000728	国元证券	100	770.00	0.00
396	600873	梅花生物	100	767.00	0.00
397	000783	长江证券	100	754.00	0.00
398	600642	申能股份	100	737.00	0.00
399	601519	大智慧	100	737.00	0.00
400	002600	领益智造	100	736.00	0.00
401	000089	深圳机场	100	732.00	0.00
402	002797	第一创业	100	732.00	0.00
403	000488	晨鸣纸业	100	724.00	0.00
404	002266	浙富控股	100	712.00	0.00

405	000825	太钢不锈	100	704.00	0.00
406	600909	华安证券	130	703.30	0.00
407	600177	雅戈尔	100	689.00	0.00
408	002252	上海莱士	100	682.00	0.00
409	002110	三钢闽光	100	680.00	0.00
410	002966	苏州银行	100	677.00	0.00
411	300017	网宿科技	100	669.00	0.00
412	002500	山西证券	100	660.00	0.00
413	600256	广汇能源	100	654.00	0.00
414	601997	贵阳银行	100	651.00	0.00
415	000559	万向钱潮	100	637.00	0.00
416	600795	国电电力	200	634.00	0.00
417	000598	兴蓉环境	100	632.00	0.00
418	002044	美年健康	80	628.00	0.00
419	601600	中国铝业	100	609.00	0.00
420	002081	金螳螂	100	608.00	0.00
421	600100	同方股份	100	603.00	0.00
422	600026	中远海能	100	592.00	0.00
423	600704	物产中大	100	592.00	0.00
424	002075	沙钢股份	100	583.00	0.00
425	600919	江苏银行	100	583.00	0.00
426	601390	中国中铁	100	579.00	0.00
427	000402	金融街	100	566.00	0.00
428	600376	首开股份	100	566.00	0.00
429	600015	华夏银行	100	560.00	0.00
430	603993	洛阳钼业	100	558.00	0.00
431	601179	中国西电	100	555.00	0.00
432	600018	上港集团	100	548.00	0.00
433	600820	隧道股份	100	538.00	0.00
434	600027	华电国际	100	535.00	0.00
435	600390	五矿资本	100	532.00	0.00
436	600369	西南证券	100	529.00	0.00
437	600782	新钢股份	100	528.00	0.00
438	601118	海南橡胶	100	528.00	0.00
439	000883	湖北能源	100	524.00	0.00
440	601216	君正集团	100	523.00	0.00
441	600115	中国东航	100	516.00	0.00
442	000166	申万宏源	100	512.00	0.00
443	000932	华菱钢铁	100	511.00	0.00
444	600497	驰宏锌锗	100	499.00	0.00
445	000060	中金岭南	100	491.00	0.00
446	601375	中原证券	100	491.00	0.00
447	002429	兆驰股份	100	486.00	0.00
448	600415	小商品城	100	485.00	0.00

449	601816	京沪高铁	100	483.00	0.00
450	600219	南山铝业	100	471.00	0.00
451	601319	中国人保	100	470.00	0.00
452	600583	海油工程	100	461.00	0.00
453	601598	中国外运	100	448.00	0.00
454	601608	中信重工	100	446.00	0.00
455	601169	北京银行	100	444.00	0.00
456	000778	新兴铸管	100	433.00	0.00
457	600688	上海石化	100	417.00	0.00
458	000961	中南建设	100	414.00	0.00
459	002024	苏宁易购	100	412.00	0.00
460	000750	国海证券	100	411.00	0.00
461	601162	天风证券	100	405.00	0.00
462	600023	浙能电力	100	404.00	0.00
463	600705	中航产融	100	397.00	0.00
464	600863	内蒙华电	100	394.00	0.00
465	000629	攀钢钒钛	100	389.00	0.00
466	002958	青农商行	100	386.00	0.00
467	601077	渝农商行	100	385.00	0.00
468	601618	中国中冶	100	383.00	0.00
469	002506	协鑫集成	100	380.00	0.00
470	600320	振华重工	100	377.00	0.00
471	600282	南钢股份	100	370.00	0.00
472	600808	马钢股份	100	369.00	0.00
473	600170	上海建工	100	360.00	0.00
474	600340	华夏幸福	100	360.00	0.00
475	601916	浙商银行	100	350.00	0.00
476	000630	铜陵有色	100	348.00	0.00
477	601106	中国一重	100	348.00	0.00
478	600008	首创环保	100	341.00	0.00
479	603077	和邦生物	100	341.00	0.00
480	000627	天茂集团	100	331.00	0.00
481	600567	山鹰国际	100	329.00	0.00
482	601099	太平洋	100	328.00	0.00
483	601866	中远海发	100	325.00	0.00
484	000671	阳光城	100	302.00	0.00
485	600208	新湖中宝	100	298.00	0.00
486	600968	海油发展	100	293.00	0.00
487	601992	金隅集团	100	284.00	0.00
488	600010	包钢股份	100	279.00	0.00
489	601000	唐山港	100	275.00	0.00
490	600297	广汇汽车	100	267.00	0.00
491	000540	中天金融	100	264.00	0.00
492	000709	河钢股份	100	246.00	0.00

493	002131	利欧股份	100	246.00	0.00
494	601333	广深铁路	100	224.00	0.00
495	601005	重庆钢铁	100	209.00	0.00
496	600022	山东钢铁	100	179.00	0.00
497	688002	睿创微纳	1	78.57	0.00

8.3.2 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	002245	蔚蓝锂芯	635,400.00	17,479,854.00	1.00
2	000537	广宇发展	695,000.00	16,749,500.00	0.96
3	603520	司太立	172,096.00	11,186,240.00	0.64
4	300767	震安科技	106,580.00	11,121,623.00	0.64
5	603606	东方电缆	194,100.00	9,930,156.00	0.57
6	002402	和而泰	344,600.00	9,452,378.00	0.54
7	000420	吉林化纤	1,736,600.00	9,151,882.00	0.53
8	601208	东材科技	486,220.00	8,435,917.00	0.48
9	688187	时代电气	96,305.00	7,897,010.00	0.45
10	601567	三星医疗	442,800.00	7,222,068.00	0.41
11	002549	凯美特气	411,400.00	7,018,484.00	0.40
12	300696	爱乐达	115,760.00	6,012,574.40	0.35
13	002876	三利谱	93,940.00	5,869,371.20	0.34
14	300007	汉威科技	187,900.00	5,678,338.00	0.33
15	600098	广州发展	635,300.00	5,133,224.00	0.29
16	300680	隆盛科技	152,800.00	4,767,360.00	0.27
17	688728	格科微	23,033.00	694,905.61	0.04
18	688385	复旦微电	8,986.00	452,355.24	0.03
19	688789	宏华数科	1,400.00	362,404.00	0.02
20	688800	瑞可达	1,967.00	273,963.76	0.02
21	301189	奥尼电子	4,345.00	259,307.90	0.01
22	301166	优宁维	2,528.00	258,233.50	0.01
23	688206	概伦电子	6,000.00	198,060.00	0.01
24	688670	金迪克	2,310.00	174,820.80	0.01
25	301108	洁雅股份	2,800.00	166,667.20	0.01
26	688305	科德数控	1,496.00	160,072.00	0.01
27	688613	奥精医疗	2,617.00	144,615.42	0.01
28	688296	和达科技	2,173.00	110,388.40	0.01
29	688768	容知日新	907.00	101,130.50	0.01
30	688509	正元地信	15,433.00	97,073.57	0.01
31	688718	唯赛勃	3,145.00	89,506.70	0.01
32	688511	天微电子	1,490.00	81,234.80	0.00

33	301177	迪阿股份	674.00	78,237.92	0.00
34	688787	海天瑞声	817.00	75,515.31	0.00
35	688071	华依科技	1,101.00	72,434.79	0.00
36	301041	金百泽	2,150.00	63,670.10	0.00
37	688038	中科通达	2,132.00	40,742.52	0.00
38	605090	九丰能源	1,090.00	38,335.30	0.00
39	301035	润丰股份	644.00	36,244.32	0.00
40	603230	内蒙新华	1,141.00	29,517.67	0.00
41	301039	中集车辆	2,064.00	25,820.64	0.00
42	301069	凯盛新材	539.00	23,829.19	0.00
43	002607	中公教育	2,800.00	22,008.00	0.00
44	301096	百诚医药	272.00	21,360.16	0.00
45	301018	申菱环境	782.00	20,378.92	0.00
46	301149	隆华新材	1,214.00	20,346.64	0.00
47	301082	久盛电气	915.00	19,699.95	0.00
48	001296	长江材料	310.00	18,376.80	0.00
49	301190	善水科技	575.00	15,789.50	0.00
50	301118	恒光股份	315.00	15,441.30	0.00
51	301179	泽宇智能	295.00	14,977.15	0.00
52	301046	能辉科技	290.00	14,207.10	0.00
53	301017	漱玉平民	555.00	13,209.00	0.00
54	301199	迈赫股份	402.00	12,864.00	0.00
55	301020	密封科技	421.00	12,815.24	0.00
56	301138	华研精机	285.00	12,785.10	0.00
57	301026	浩通科技	203.00	12,734.19	0.00
58	301021	英诺激光	290.00	12,014.70	0.00
59	301092	争光股份	323.00	11,472.96	0.00
60	301048	金鹰重工	843.00	10,925.28	0.00
61	301028	东亚机械	733.00	9,895.50	0.00
62	301045	天禄科技	335.00	9,503.95	0.00
63	300774	倍杰特	444.00	9,359.52	0.00
64	301040	中环海陆	241.00	9,280.91	0.00
65	301193	家联科技	297.00	8,654.58	0.00
66	301025	读客文化	403.00	8,414.64	0.00
67	300814	中富电路	328.00	7,832.64	0.00
68	301055	张小泉	355.00	7,731.90	0.00
69	301198	喜悦智行	262.00	7,650.40	0.00
70	301030	仕净科技	242.00	7,627.84	0.00
71	301098	金埔园林	307.00	6,806.19	0.00
72	301033	迈普医学	108.00	6,476.76	0.00
73	301049	超越科技	196.00	6,452.32	0.00
74	301032	新柴股份	513.00	6,417.63	0.00
75	301056	森赫股份	572.00	6,343.48	0.00
76	301036	双乐股份	205.00	6,135.65	0.00

77	301063	海锅股份	153.00	5,524.83	0.00
78	001234	泰慕士	333.00	5,504.49	0.00
79	301038	深水规院	266.00	5,381.18	0.00
80	301059	金三江	259.00	4,998.70	0.00
81	301027	华蓝集团	286.00	4,761.90	0.00
82	603176	汇通集团	1,924.00	4,713.80	0.00
83	301037	保立佳	193.00	4,682.18	0.00
84	301073	君亭酒店	144.00	4,608.00	0.00
85	301053	远信工业	155.00	4,460.90	0.00
86	301068	大地海洋	144.00	4,086.72	0.00
87	603228	景旺电子	100.00	3,453.00	0.00
88	600566	济川药业	100.00	2,834.00	0.00
89	002242	九阳股份	100.00	2,320.00	0.00
90	600131	国网信通	100.00	2,185.00	0.00
91	002773	康弘药业	100.00	2,035.00	0.00
92	001914	招商积余	100.00	2,026.00	0.00
93	601098	中南传媒	200.00	1,914.00	0.00
94	600562	国睿科技	100.00	1,838.00	0.00
95	300188	美亚柏科	100.00	1,719.00	0.00
96	002399	海普瑞	100.00	1,710.00	0.00
97	600835	上海机电	100.00	1,592.00	0.00
98	600267	海正药业	100.00	1,399.00	0.00
99	600021	上海电力	100.00	1,282.00	0.00
100	000555	神州信息	100.00	1,272.00	0.00
101	300271	华宇软件	100.00	1,270.00	0.00
102	600373	中文传媒	100.00	1,236.00	0.00
103	600776	东方通信	100.00	1,151.00	0.00
104	300058	蓝色光标	100.00	1,073.00	0.00
105	002233	塔牌集团	100.00	1,058.00	0.00
106	002124	天邦股份	140.00	901.60	0.00
107	600167	联美控股	100.00	901.00	0.00
108	002099	海翔药业	100.00	824.00	0.00
109	601958	金钼股份	100.00	685.00	0.00
110	600398	海澜之家	100.00	641.00	0.00
111	002244	滨江集团	100.00	466.00	0.00
112	600928	西安银行	100.00	430.00	0.00
113	601860	紫金银行	100.00	335.00	0.00
114	600959	江苏有线	100.00	329.00	0.00
115	600823	世茂股份	100.00	328.00	0.00
116	000415	渤海租赁	100.00	291.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	94,176,784.92	3.44
2	002027	分众传媒	89,108,922.14	3.25
3	002876	三利谱	85,657,769.88	3.12
4	603259	药明康德	83,400,044.12	3.04
5	300119	瑞普生物	79,025,473.96	2.88
6	601636	旗滨集团	78,009,576.65	2.85
7	000739	普洛药业	76,467,247.39	2.79
8	600703	三安光电	71,867,552.88	2.62
9	600570	恒生电子	70,495,481.65	2.57
10	688099	晶晨股份	69,956,407.85	2.55
11	002050	三花智控	69,267,603.38	2.53
12	002475	立讯精密	65,835,368.24	2.40
13	603501	韦尔股份	61,361,415.89	2.24
14	300274	阳光电源	59,437,526.00	2.17
15	300413	芒果超媒	58,109,846.14	2.12
16	601111	中国国航	57,699,168.00	2.10
17	601689	拓普集团	57,495,898.00	2.10
18	002049	紫光国微	54,044,601.95	1.97
19	601899	紫金矿业	53,783,720.00	1.96
20	601888	中国中免	53,580,610.08	1.95

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。

8.4.2 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	601636	旗滨集团	117,885,927.46	4.30
2	002027	分众传媒	102,241,939.74	3.73
3	000739	普洛药业	99,289,849.49	3.62
4	000725	京东方 A	94,284,014.97	3.44
5	002876	三利谱	90,645,380.47	3.31
6	601208	东材科技	87,824,416.76	3.20

7	601888	中国中免	86,142,182.03	3.14
8	300119	瑞普生物	86,133,294.67	3.14
9	601318	中国平安	84,899,387.84	3.10
10	002049	紫光国微	80,787,137.31	2.95
11	300059	东方财富	75,575,684.25	2.76
12	600409	三友化工	74,760,947.19	2.73
13	600887	伊利股份	74,377,227.26	2.71
14	601717	郑煤机	73,554,171.09	2.68
15	002739	万达电影	70,974,974.72	2.59
16	688099	晶晨股份	70,075,095.83	2.56
17	603520	司太立	66,973,089.14	2.44
18	002050	三花智控	64,374,354.97	2.35
19	601012	隆基股份	63,969,281.85	2.33
20	002475	立讯精密	63,684,394.47	2.32
21	300593	新雷能	63,148,789.54	2.30
22	601233	桐昆股份	60,856,612.95	2.22
23	688208	道通科技	59,268,717.63	2.16
24	603501	韦尔股份	58,440,199.60	2.13
25	002025	航天电器	58,311,929.78	2.13
26	600570	恒生电子	55,922,137.85	2.04
27	000516	ST 国医	55,840,985.55	2.04
28	300083	创世纪	55,430,895.81	2.02
29	600690	海尔智家	55,327,853.00	2.02
30	688200	华峰测控	54,982,990.90	2.01

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,716,929,645.04
卖出股票的收入（成交）总额	6,805,930,634.49

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。

8.5 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	80,024,000.00	4.60
	其中：政策性金融债	80,024,000.00	4.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,127,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,151,000.00	4.66

8.6 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	210201	21 国开 01	800,000	80,024,000.00	4.60
2	113052	兴业转债	9,830	983,000.00	0.06
3	113634	珀莱转债	1,440	144,000.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行因违规办理内保外贷业务等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局（闽汇罚（2021）5 号）责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币的行政处罚。2021 年 8 月 13 日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行（银罚字（2021）26 号）给予罚款 5 万元的行政处罚。

本基金投资招商银行、兴业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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	366,064.85
2	应收证券清算款	6,836,033.68
3	应收股利	-
4	应收利息	1,829,506.32

5	应收申购款	995,638.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,027,242.97

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

8.12.5.2 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
93,190	17,618.46	279,677,094.14	17.03%	1,362,187,057.12	82.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	309,172.67	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
许之彦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	-
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2002 年 11 月 8 日)基金份额总额	1,762,466,123.89
本报告期期初基金份额总额	2,730,307,040.56
本报告期基金总申购份额	347,235,925.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,435,678,815.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,641,864,151.26

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在

中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 98,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
浙商证券	1	5,827,608,587.78	46.65%	5,310,712.84	46.19%	-
国泰君安证券	1	3,668,887,109.55	29.37%	3,416,833.61	29.72%	-
申万宏源	2	2,014,084,437.43	16.12%	1,875,707.29	16.31%	-
广发证券	1	542,701,951.42	4.34%	494,567.32	4.30%	-
招商证券	1	183,387,021.86	1.47%	166,753.55	1.45%	-
银河证券	2	173,717,418.02	1.39%	158,688.25	1.38%	-
中信建投	1	80,911,816.02	0.65%	75,351.26	0.66%	-

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12月完成租用托管在工商银行的申万宏源北交所720123交易单元。

11.7.2 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
浙商证券	8,082,749.31	39.59%	-	-	-	-
国泰君安证券	2,319,808.30	11.36%	-	-	-	-
申万宏源	4,723,639.60	23.14%	-	-	-	-
广发证券	15,638.00	0.08%	-	-	-	-
招商证券	5,274,300.00	25.83%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

11.8 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 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定媒介	2021-01-21
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
8	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 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 MSCI 中国 A 股指数增强型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
11	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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
12	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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
13	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	2021-03-31

		定媒介	
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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 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
16	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
17	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（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
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	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-07
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（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
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（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
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（英科再生）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-01
23	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 年第 2 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	2021-07-20
24	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（唯赛勃）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-21
25	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（国邦医药）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-27
26	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（圣泉集团）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-03
27	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（沪农商行）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-07
28	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基	中国证监会基金电子披	2021-08-30

	金 2021 年中期报告	露网站和公司网站等指定媒介	
29	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（时代电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-31
30	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（博拓生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-09-02
31	华安基金管理有限公司关于新增基金直销申购资金专户的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-09-11
32	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 年第 3 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	2021-10-27
33	华安基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-02
34	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（新点软件）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-11
35	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（云路股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-19
36	华安基金管理有限公司关于调整投资者开户证件类型类型的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-11-20
37	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(百济神州)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-07
38	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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	2021-12-20
39	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-20
40	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-27
41	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-12-27

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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- 20210817	566,601,686.71	0.00	300,000,000.00	266,601,686.71	16.24%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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>。

13.3 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

二〇二二年三月三十日