

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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、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	14
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	15
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的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	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	90
8.1 期末基金资产组合情况	90
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	91
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	93
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99

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	100
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	100
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	100
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	100
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	100
8.12	投资组合报告附注	100
§9	基金份额持有人信息	102
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
9.2	期末上市基金前十名持有人	102
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
9.4	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	103
9.5	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	103
§10	开放式基金份额变动	103
§11	重大事件揭示	104
11.1	基金份额持有人大会决议	104
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	104
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	104
11.4	基金投资策略的改变	104
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	104
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	104
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	105
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	105
11.9	其他重大事件	106
12	影响投资者决策的其他重要信息	110
§13	备查文件目录	110
13.1	备查文件目录	110
13.2	存放地点	111
13.3	查阅方式	111

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证 180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,538,057,679.00 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	2006 年 5 月 18 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	采取抽样复制的指数跟踪方法，即根据量化的选股指标，选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合，并通过优化模型确定投资组合中个股的权重，以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	上证 180 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险中等、收益中等的产品。

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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨牧云	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.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、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	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、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	1,146,535,692.92	1,054,990,861.06	450,856,509.86
本期利润	-777,950,018.92	4,461,600,166.36	5,108,194,291.77
加权平均基金份额本期利润	-0.1401	0.7936	0.9048
本期加权平均净值利润率	-3.34%	21.55%	26.72%
本期基金份额净值增长率	-3.35%	22.54%	32.57%
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	16,942,987,034.42	17,904,102,890.94	13,919,378,412.43
期末可供分配基金份额利润	3.0594	3.2026	2.4748
期末基金资产净值	22,886,973,650.41	23,904,437,655.61	19,956,205,311.50
期末基金份额净值	4.1327	4.2759	3.5480
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	372.85%	389.24%	299.25%

注：1、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。

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

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
过去三个月	1.42%	0.73%	1.29%	0.73%	0.13%	0.00%
过去六个月	-2.87%	0.97%	-3.95%	0.98%	1.08%	-0.01%

过去一年	-3.35%	1.08%	-5.19%	1.08%	1.84%	0.00%
过去三年	57.01%	1.22%	48.78%	1.23%	8.23%	-0.01%
过去五年	52.96%	1.14%	40.22%	1.14%	12.74%	0.00%
自基金合同生效起至今	372.85%	1.67%	296.98%	1.69%	75.87%	-0.02%

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

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

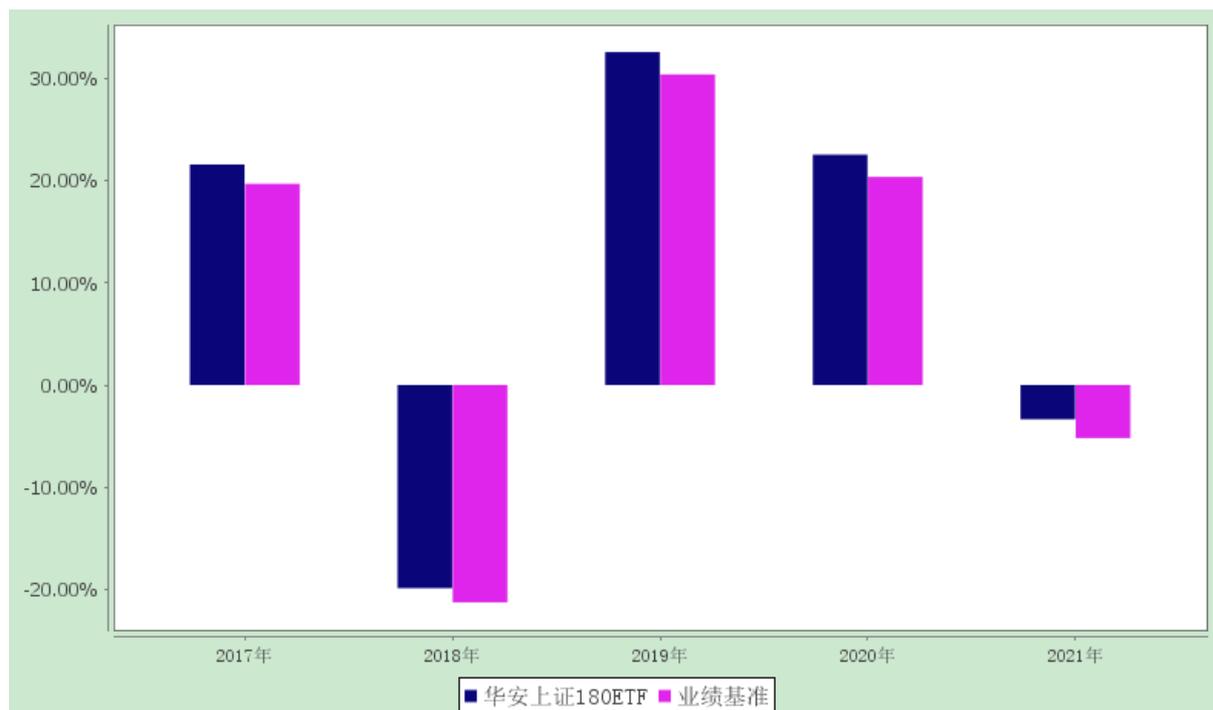
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006 年 4 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日)



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

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

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	0.670	376,007,878.48	-	376,007,878.48	-
2019年	1.200	673,566,921.48	-	673,566,921.48	-
合计	1.870	1,049,574,799.96	-	1,049,574,799.96	-

§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	2009-09-05	-	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

				<p>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。</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	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。

4.3.3 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。

4.3.4 异常交易行为的专项说明

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。

4.4 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，全球经济呈现“前高后低”的态势，新冠病毒变种仍对全球经济造成了一定扰动，供应链矛盾频现。发达经济体的强力经济刺激在快速修复经济的同时也引发了高通胀，随着经济增速放缓，CPI 持续高涨，呈现出“类滞胀”的特征。

2021 年国内 GDP 增长 8.1%，两年平均增长 5.1%。整体来看，2021 年国内经济全面复苏，与疫情前相比，传统经济动能有所下滑，高端制造与高新技术等新经济动能提升，由于局部疫情的反复，消费仍然偏弱，下半年来，国内经济增长面临的压力增大。

A 股市场 2021 年宽幅震荡，呈现结构性行情。中小盘风格相对占优。全年上证 50 下跌 10.06%，沪深 300 下跌 5.2%，中证 500 上涨 15.58%，创业板指上涨 12.02%。本基金跟踪的上证 180 指数全年下跌 5.19%。

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 4.1327 元，本报告期份额净值增长率为-3.35%，同期业绩比较基准增长率为-5.19%。

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，受发达经济体货币政策转向，海外流动性收紧预期、通胀上行等因素影响，全球经济仍面临较多不确定性。对于国内经济，出口对经济的拉动下行，房地产投资仍维持低位，基建投资的增速有望回升，消费回升仍有较大潜力。总体而言，“稳增长”将是政策主线，政策调控和逆周期调节为经济稳增长保驾护航。

在基数效应影响下，企业盈利增速全面回落，业绩保持韧性并且处于产业升级风口的行业与板块是值得关注的方向。市场风格将趋向均衡，蓝筹价值有估值修复的动力，而新兴成长在经过调整后估值下修，投资价值提升。上证 180 指数成分股囊括了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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 26968 号

上证 180 交易型开放式指数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

我们审计了上证 180 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华安上证 180ETF 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,公允反映了华安上证 180ETF 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,我们独立于华安上证 180ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华安上证 180ETF 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上证 180ETF 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上证 180ETF 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上证 180ETF 基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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，就可能导致对华安上证 180ETF 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上证 180ETF 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：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

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	48,892,471.71	56,401,060.37
结算备付金		185,716.61	205,251.86
存出保证金		100,023.32	177,301.87
交易性金融资产	7.4.7.2	22,855,694,874.57	23,855,254,126.65
其中：股票投资		22,824,978,874.57	23,827,099,126.65
基金投资		-	-
债券投资		30,716,000.00	28,155,000.00
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		413,566.40	7,313,904.20
应收利息	7.4.7.5	694,259.62	8,107.79
应收股利		28,150.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		22,906,009,062.23	23,919,359,752.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		9,743,403.25	9,780,050.26
应付托管费		1,948,680.64	1,956,010.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,044,000.75	2,898,005.44
应交税费		-	68.79
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	299,327.18	287,962.58
负债合计		19,035,411.82	14,922,097.13
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	5,943,986,615.99	6,000,334,764.67
未分配利润	7.4.7.10	16,942,987,034.42	17,904,102,890.94
所有者权益合计		22,886,973,650.41	23,904,437,655.61
负债和所有者权益总计		22,906,009,062.23	23,919,359,752.74

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.1327 元，基金份额总额 5,538,057,679.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证 180 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		-625,355,250.79	4,594,912,443.78
1.利息收入		8,404,781.25	331,785.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	249,794.22	322,355.33
债券利息收入		13,295.06	9,429.98
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		8,141,691.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,289,438,170.74	1,187,446,936.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	804,425,948.73	678,601,415.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,733,763.49	13,095,292.93
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	473,278,458.52	495,750,228.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,924,485,711.84	3,406,609,305.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,287,509.06	524,416.33
减：二、费用		152,594,768.13	133,312,277.42
1. 管理人报酬		116,689,434.16	103,170,551.35

2. 托管费		23,337,886.83	20,634,110.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	12,232,927.41	9,221,328.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		12.97	28.70
7. 其他费用	7.4.7.20	334,506.76	286,258.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-777,950,018.92	4,461,600,166.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-777,950,018.92	4,461,600,166.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 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 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）	6,000,334,764.67	17,904,102,890.94	23,904,437,655.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-777,950,018.92	-777,950,018.92
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）	-56,348,148.68	-183,165,837.60	-239,513,986.28
其中：1.基金申购款	228,075,839.45	659,038,444.10	887,114,283.55
2.基金赎回款	-284,423,988.13	-842,204,281.70	-1,126,628,269.83

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）	5,943,986,615.99	16,942,987,034.42	22,886,973,650.41
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）	6,036,826,899.07	13,919,378,412.43	19,956,205,311.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,461,600,166.36	4,461,600,166.36
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）	-36,492,134.40	-100,867,809.37	-137,359,943.77
其中：1.基金申购款	763,651,576.21	1,871,693,165.61	2,635,344,741.82
2.基金赎回款	-800,143,710.61	-1,972,560,974.98	-2,772,704,685.59
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）	-	-376,007,878.48	-376,007,878.48
五、期末所有者权益（基金净值）	6,000,334,764.67	17,904,102,890.94	23,904,437,655.61

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

上证 180 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”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 1,072,807,826.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,279.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为了与上证 180 指数进行对比,根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华安基金管理有限公司确定 2006 年 5 月 10 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2,919.214 点,本基金资产净值为 1,167,168,017.51 元,折算前基金份额总额为 1,072,822,105.00 份,折算前基金份额净值为 1.088 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.37268313,折算后基金份额总额为 399,822,674.00 份,折算后基金份额净值为 2.919 元。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 5 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2006]第 39 号文审核同意,本基金 399,822,674.00 份基金份额于 2006 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于华安上证 180ETF 实施份额拆分和修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于 2009 年 5 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 10:1,并于 2009 年 5 月 19 日进行了变更登记。

根据《关于上证 180ETF 基金份额合并结果及恢复交易和申购、赎回的公告》的有关规定,中国证券登记结算有限责任公司按合并比例 0.25 对 2013 年 12 月 19 日(权益登记日)登记在册的本基金的基金份额实施合并,减少基金份额持有人持有的基金份额数,并于 2013 年 12 月 20 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《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数上证 180 指数的成份股(含存托凭证)和备选成份股(含存托凭证)，该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股(含存托凭证)、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金可以按照国家的有关规定进行融资及参与转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2009 年 9 月 29 日募集成立了华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 180ETF 联接基金”)。上证 180ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《上证 180 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 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。由于基金份额合并引起的实收基金份额变动于基金份额合并日根据拆分前的基金份额数及确定的合并比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证

券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。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。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

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：

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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	48,892,471.71	56,401,060.37
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	48,892,471.71	56,401,060.37

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	18,112,727,644.06	22,824,978,874.57	4,712,251,230.51	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	30,716,000.00	30,716,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,716,000.00	30,716,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	18,143,443,644.06	22,855,694,874.57	4,712,251,230.51	
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	17,190,362,184.30	23,827,099,126.65	6,636,736,942.35	

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	28,155,000.00	28,155,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	28,155,000.00	28,155,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		17,218,517,184.30	23,855,254,126.65	6,636,736,942.35

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	7,445.92	5,863.36
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	83.60	92.40
应收债券利息	673.23	2,072.23
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	686,011.87	-

其他	45.00	79.80
合计	694,259.62	8,107.79

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,044,000.75	2,898,005.44
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,044,000.75	2,898,005.44

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付替代款	12,327.18	3,325.18
可退替代款	-	637.40
预提费用	287,000.00	284,000.00
合计	299,327.18	287,962.58

注：1. 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。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

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	5,590,557,679.00	6,000,334,764.67
本期申购	212,500,000.00	228,075,839.45
本期赎回（以“-”号填列）	-265,000,000.00	-284,423,988.13
本期末	5,538,057,679.00	5,943,986,615.99

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。

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	20,259,793,222.78	-2,355,690,331.84	17,904,102,890.94
本期利润	1,146,535,692.92	-1,924,485,711.84	-777,950,018.92
本期基金份额交易产生的变动数	-191,314,948.86	8,149,111.26	-183,165,837.60
其中：基金申购款	789,616,129.51	-130,577,685.41	659,038,444.10
基金赎回款	-980,931,078.37	138,726,796.67	-842,204,281.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,215,013,966.84	-4,272,026,932.42	16,942,987,034.42

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	200,579.11
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	47,126.20	36,334.75

其他	2,088.91	2,341.49
合计	249,794.22	322,355.33

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	482,178,588.73	118,065,330.02
股票投资收益——赎回差价收入	322,247,360.00	560,536,084.98
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	804,425,948.73	678,601,415.00

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,103,899,335.95	3,177,682,613.86
减：卖出股票成本总额	3,621,720,747.22	3,059,617,283.84
买卖股票差价收入	482,178,588.73	118,065,330.02

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,126,628,269.83	2,772,704,685.59
减：现金支付赎回款总额	-86,945,205.17	-146,589,721.41
减：赎回股票成本总额	891,326,115.00	2,358,758,322.02
赎回差价收入	322,247,360.00	560,536,084.98

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	11,733,763.49	13,095,292.93
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	11,733,763.49	13,095,292.93

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	111,906,565.50	69,107,994.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,158,000.00	56,005,000.00
减：应收利息总额	14,802.01	7,701.07
买卖债券差价收入	11,733,763.49	13,095,292.93

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 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	473,278,458.52	495,750,228.91
其中：证券出借权益补偿收入	2,079,080.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	473,278,458.52	495,750,228.91

7.4.7.17 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	-1,924,485,711.84	3,406,609,305.30
——股票投资	-1,924,485,711.84	3,406,609,305.30
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,924,485,711.84	3,406,609,305.30

7.4.7.18 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	-	-
其他	1,182,255.36	471.77
替代损益	105,253.70	523,944.56

合计	1,287,509.06	524,416.33
----	--------------	------------

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。

7.4.7.19 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	12,232,927.41	9,221,328.28
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	12,232,927.41	9,221,328.28

7.4.7.20 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	167,000.00	164,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
律师费	30,000.00	-
公证费	15,000.00	-
银行汇划费	2,506.76	2,258.78
合计	334,506.76	286,258.78

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上海上国投资资产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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“上证 180ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
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	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
国泰君安证券股份有限公司	5,063,031,146.89	59.01%	3,884,228,426.06	60.72%

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	183,909,565.50	85.69%	147,033,994.00	96.40%

7.4.10.1.4 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	4,708,022.58	64.73%	4,479,255.36	63.59%
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	3,593,800.65	66.41%	1,080,228.77	37.27%

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	116,689,434.16	103,170,551.35
其中：支付销售机构的客户维护费	-	0.00

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

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	23,337,886.83	20,634,110.31

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币

本期

2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	3,110,763,287.00	3,614,141.29	609,979,060.00	277,586.59

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

单位：人民币

本期 2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限(单位：天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2021082400001377	中微公司	2021-12-31	182,000.00	1,000.00	28	3.40	498.48	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 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	5,130,500.00	0.09%	-	-
中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	38,881,625.00	0.70%	48,628,725.00	0.87%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
中国建设银行	48,892,471.71	200,579.11	56,401,060.37	283,679.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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	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	278,560.00	27,856,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113049	长汽转债	老股东配 售	13,460.00	1,346,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113050	南银转债	老股东配 售	181,550.00	18,155,000.00
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	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	33,865.00	1,067,997.12
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	19,217.00	3,719,700.17
国泰君安证 券股份有限 公司	113052	兴业转债	老股东配 售	307,160.00	30,716,000.00
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	110073	国投转债	老股东配售	68,260.00	6,826,000.00
国泰君安证券股份有限公司	113044	大秦转债	老股东配售	257,220.00	25,722,000.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 7,952,580 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 149,586,081.02 元，估值总额为人民币 142,271,656.20 元，占基金资产净值的比例为 0.62%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有 9,010,080 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 170,516,848.76 元，估值总额为人民币 157,946,702.40 元，占基金资产净值的比例为 0.66%)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 10,000 股国泰君安的 A 股融出证券股，成本总额为人民币 188,138.75 元，估值总额为人民币 178,900.00 元，占基金资产净值的比例为 0.0008%(2020 年 12 月 31 日：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 11,614,172 股托管人建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 72,687,922.41 元，估值总额为人民币 68,059,047.92 元，占基金资产净值的比例为 0.30%(2020 年 12 月 31 日：本基金持有 13,419,685 股托管人建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 83,877,979.85 元，估值总额为人民币 84,275,621.80 元，占基金资产净值的比例为 0.35%)。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 240,000 股托管人建设银行的 A 股融出证券股，成本总额为人民币 1,530,467.14 元，估值总额为人民币 1,406,400.00 元，占基金资产净值的比例为 0.0061%(2020 年 12 月 31 日：无)。

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
688187	时代电气	2021-08-30	2022-03-07	新股限售	31.38	76.65	33,865	1,062,683.70	2,595,752.25	-
60172	中国	2021-	2022-	新股	4.53	4.27	151,54	686,48	647,08	-

8	电信	08-11	02-21	限售			3	9.79	8.61	
688800	瑞可达	2021-07-14	2022-01-24	新股限售	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	新股限售	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	新股限售	11.03	105.68	1,496	16,500.88	158,097.28	-
688210	统联精密	2021-12-20	2022-06-27	新股限售	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
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	2021-12-27	2022-01-14	配债未上市	100.00	100.00	307,160	30,716,000.00	30,716,000.00	-

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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、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，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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

无。

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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	600000	浦发银行	2022年1月5日-2022年1月27日	8.53	1,560,000.00	13,306,800.00
2	600009	上海机场	2022年1月4日-2022年1月20日	46.69	80,000.00	3,735,200.00
3	600010	宝钢股份	2022年1月4日-2022年1月28日	2.79	7,105,000.00	19,822,950.00
4	600011	华能国际	2022年1月4日-2022年1月28日	9.69	1,450,000.00	14,050,500.00
5	600016	民生银行	2022年1月4日-2022	3.90	2,280,000.00	8,892,000.00

			年 1 月 25 日			
6	600019	宝钢股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.16	950,000.00	6,802,000.00
7	600025	华能水电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 25 日	6.59	560,000.00	3,690,400.00
8	600028	中国石化	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.23	380,000.00	1,607,400.00
9	600029	南方航空	2022 年 1 月 13 日-2022 年 1 月 18 日	6.81	470,000.00	3,200,700.00
10	600030	中信证券	2022 年 1 月 5 日-	26.41	70,000.00	1,848,700.00

			2022 年 1 月 28 日			
11	600031	三一重工	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	22.80	1,770,000.00	40,356,000.00
12	600036	招商银行	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	48.71	220,000.00	10,716,200.00
13	600038	中直股份	2022 年 1 月 10 日- 2022 年 1 月 28 日	80.30	50,000.00	4,015,000.00
14	600048	保利发展	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	15.63	690,000.00	10,784,700.00
15	600050	中国联	2022 年 1 月 4	3.93	990,000.00	3,890,700.00

		通	日- 2022 年 1 月 14 日			
16	600061	国 投 资 本	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	8.22	820,000.00	6,740,400.00
17	600089	特 变 电 工	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	21.17	862,000.00	18,248,540.00
18	600104	上 汽 集 团	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 19 日	20.63	170,000.00	3,507,100.00
19	600109	国 金 证 券	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 27 日	11.33	750,000.00	8,497,500.00
20	600111	北 方 稀	2022 年 1 月 4	45.80	690,000.00	31,602,000.00

		土	日- 2022 年 1 月 28 日			
21	600118	中国 卫星	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	27.15	160,000.00	4,344,000.00
22	600132	重 庆 啤 酒	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 5 日	151.32	10,000.00	1,513,200.00
23	600143	金 发 科 技	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	12.58	616,000.00	7,749,280.00
24	600150	中 国 船 舶	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	24.79	520,000.00	12,890,800.00
25	600161	天 坛 生 物	2022 年 1 月 4 日-	28.96	210,000.00	6,081,600.00

			2022 年 1 月 28 日			
26	600176	中国 巨石	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	18.20	110,000.00	2,002,000.00
27	600183	生 益 科 技	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 27 日	23.55	120,000.00	2,826,000.00
28	600196	复 星 医 药	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	48.94	318,000.00	15,562,920.00
29	600276	恒 瑞 医 药	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 24 日	50.71	90,000.00	4,563,900.00
30	600298	安 琪 酵 母	2022 年 1 月 4 日-	60.36	70,000.00	4,225,200.00

			2022 年 1 月 28 日			
31	600309	万 华 化 学	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	101.00	140,000.00	14,140,000.00
32	600315	上 海 家 化	2022 年 1 月 14 日- 2022 年 1 月 20 日	40.41	80,000.00	3,232,800.00
33	600346	恒 力 石 化	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	22.97	350,000.00	8,039,500.00
34	600352	浙 江 龙 盛	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	12.63	660,000.00	8,335,800.00
35	600362	江 西 铜	2022 年 1 月	22.33	278,000.00	6,207,740.00

		业	12 日- 2022 年1 月 28 日			
36	600383	金地集团	2022 年1 月4 日- 2022 年1 月 28 日	12.97	718,000.00	9,312,460.00
37	600406	国电南瑞	2022 年1 月4 日- 2022 年1 月 28 日	40.03	380,000.00	15,211,400.00
38	600426	华鲁恒升	2022 年1 月 12 日- 2022 年1 月 28 日	31.30	260,000.00	8,138,000.00
39	600436	片仔癀	2022 年1 月5 日- 2022 年1 月 27 日	437.15	70,000.00	30,600,500.00
40	600438	通	2022	44.96	365,000.00	16,410,400.00

		威股份	年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日			
41	600460	士兰微	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 18 日	54.20	50,000.00	2,710,000.00
42	600511	国药股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	31.53	100,000.00	3,153,000.00
43	600516	方大炭素	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	10.82	815,000.00	8,818,300.00
44	600519	贵州茅台	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 26 日	2,050.00	30,000.00	61,500,000.00

45	600521	华海药业	2022年1月4日-2022年1月28日	21.66	183,000.00	3,963,780.00
46	600522	中天科技	2022年1月4日-2022年1月28日	16.96	820,000.00	13,907,200.00
47	600547	山东黄金	2022年1月4日-2022年1月28日	18.82	580,000.00	10,915,600.00
48	600570	恒生电子	2022年1月5日-2022年1月28日	62.15	110,000.00	6,836,500.00
49	600584	长电科技	2022年1月6日-2022年1月28日	31.02	375,000.00	11,632,500.00

50	600585	海螺水泥	2022年1月4日-2022年1月27日	40.30	220,000.00	8,866,000.00
51	600588	用友网络	2022年1月4日-2022年1月28日	35.88	460,000.00	16,504,800.00
52	600598	北大荒	2022年1月5日-2022年1月18日	14.56	170,000.00	2,475,200.00
53	600600	青岛啤酒	2022年1月4日-2022年1月28日	99.00	50,000.00	4,950,000.00
54	600606	绿地控股	2022年1月4日-2022年1月28日	4.34	1,330,000.00	5,772,200.00

55	600621	华鑫股份	2022年1月13日-2022年1月28日	13.84	100,000.00	1,384,000.00
56	600660	福耀玻璃	2022年1月4日-2022年1月27日	47.14	290,000.00	13,670,600.00
57	600690	海尔智家	2022年1月5日-2022年1月25日	29.89	140,000.00	4,184,600.00
58	600699	均胜电子	2022年1月5日-2022年1月28日	21.97	280,000.00	6,151,600.00
59	600741	华域汽车	2022年1月17日-2022年1月	28.30	178,000.00	5,037,400.00

			20 日			
60	600745	闻泰科技	2022 年 1 月 12 日- 2022 年 1 月 28 日	129.30	70,000.00	9,051,000.00
61	600760	中航沈飞	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 20 日	68.04	100,000.00	6,804,000.00
62	600763	通策医疗	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 14 日	199.00	50,000.00	9,950,000.00
63	600779	水井坊	2022 年 1 月 20 日- 2022 年 1 月 24 日	119.99	30,000.00	3,599,700.00
64	600809	山西汾酒	2022 年 1 月 5 日- 2022	315.78	50,000.00	15,789,000.00

			年 1 月 20 日			
65	600837	海 通 证 券	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	12.26	140,000.00	1,716,400.00
66	600862	中 航 高 科	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	35.76	160,000.00	5,721,600.00
67	600872	中 炬 高 新	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 25 日	37.97	138,000.00	5,239,860.00
68	600884	杉 杉 股 份	2022 年 1 月 20 日- 2022 年 1 月 21 日	32.77	20,000.00	655,400.00
69	600886	国 投 电 力	2022 年 1 月 4 日-	11.47	306,000.00	3,509,820.00

			2022 年 1 月 20 日			
70	600887	伊 利 股 份	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	41.46	1,120,000.00	46,435,200.00
71	600893	航 发 动 力	2022 年 1 月 6 日- 2022 年 1 月 28 日	63.46	356,000.00	22,591,760.00
72	600900	长 江 电 力	2022 年 1 月 14 日- 2022 年 1 月 24 日	22.70	490,000.00	11,123,000.00
73	600905	三 峡 能 源	2022 年 1 月 6 日- 2022 年 1 月 26 日	7.51	2,460,000.00	18,474,600.00
74	600918	中 泰 证	2022 年 1 月 5	9.97	210,000.00	2,093,700.00

		券	日- 2022 年 1 月 20 日			
75	600919	江苏 银行	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	5.83	350,000.00	2,040,500.00
76	600926	杭州 银行	2022 年 1 月 6 日- 2022 年 1 月 28 日	12.82	120,000.00	1,538,400.00
77	600958	东方 证券	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	14.74	1,147,000.00	16,906,780.00
78	600989	宝丰 能源	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 25 日	17.36	710,000.00	12,325,600.00
79	600999	招商 证	2022 年 1 月 4	17.65	123,000.00	2,170,950.00

		券	日- 2022 年 1 月 28 日			
80	601009	南京 银行	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	8.96	140,000.00	1,254,400.00
81	601012	隆基 股份	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	86.20	780,000.00	67,236,000.00
82	601066	中信 建投	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	29.25	240,000.00	7,020,000.00
83	601088	中国 神华	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 25 日	22.52	210,000.00	4,729,200.00
84	601100	恒立 液	2022 年 1 月 4	81.80	100,000.00	8,180,000.00

		压	日- 2022 年 1 月 28 日			
85	601108	财通 证券	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 26 日	11.12	623,000.00	6,927,760.00
86	601111	中国 国航	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 24 日	9.13	990,000.00	9,038,700.00
87	601138	工业 富联	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日	11.92	80,000.00	953,600.00
88	601155	新城 控股	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	29.13	201,000.00	5,855,130.00
89	601162	天风 证	2022 年 1 月 4	4.05	1,340,000.00	5,427,000.00

		券	日- 2022 年 1 月 28 日			
90	601166	兴 业 银 行	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	19.04	100,000.00	1,904,000.00
91	601169	北 京 银 行	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	4.44	360,000.00	1,598,400.00
92	601186	中 国 铁 建	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	7.80	849,000.00	6,622,200.00
93	601211	国 泰 君 安	2022 年 1 月 18 日- 2022 年 1 月 18 日	17.89	10,000.00	178,900.00
94	601216	君 正	2022 年 1	5.23	1,160,000.00	6,066,800.00

		集团	月 4 日-2022 年 1 月 28 日			
95	601225	陕西煤业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.20	380,000.00	4,636,000.00
96	601229	上海银行	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 28 日	7.13	1,877,000.00	13,383,010.00
97	601236	红塔证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	11.92	260,000.00	3,099,200.00
98	601238	广汽集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 26 日	15.19	700,000.00	10,633,000.00
99	601288	农	2022	2.94	820,000.00	2,410,800.00

		业 银 行	年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日			
100	601318	中 国 平 安	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 17 日	50.41	460,000.00	23,188,600.00
101	601319	中 国 人 保	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	4.70	420,000.00	1,974,000.00
102	601328	交 通 银 行	2022 年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 19 日	4.61	360,000.00	1,659,600.00
103	601336	新 华 保 险	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 20 日	38.88	120,000.00	4,665,600.00
104	601360	三	2022	12.72	440,000.00	5,596,800.00

		六零	年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日			
105	601377	兴业证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	9.88	1,089,000.00	10,759,320.00
106	601390	中国中铁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.79	1,030,000.00	5,963,700.00
107	601398	工商银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.63	660,000.00	3,055,800.00
108	601456	国联证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	13.97	200,000.00	2,794,000.00
109	601555	东	2022	8.86	772,000.00	6,839,920.00

		吴证券	年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日			
110	601600	中国铝业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 26 日	6.09	2,390,000.00	14,555,100.00
111	601601	中国太保	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	27.12	140,000.00	3,796,800.00
112	601607	上海医药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	19.87	349,000.00	6,934,630.00
113	601618	中国中冶	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.83	1,560,000.00	5,974,800.00
114	601628	中	2022	30.09	460,000.00	13,841,400.00

		国人寿	年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日			
115	601633	长城汽车	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	48.54	245,000.00	11,892,300.00
116	601658	邮储银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	5.10	140,000.00	714,000.00
117	601668	中国建筑	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.00	450,000.00	2,250,000.00
118	601669	中国电建	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	8.08	2,340,000.00	18,907,200.00
119	601688	华	2022	17.76	140,000.00	2,486,400.00

		泰证 券	年 1 月 5 日- 2022 年 1 月 28 日			
120	601689	拓普 集团	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	53.00	60,000.00	3,180,000.00
121	601696	中银 证券	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	13.45	305,000.00	4,102,250.00
122	601698	中国 卫通	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 25 日	14.39	149,000.00	2,144,110.00
123	601766	中国 中车	2022 年 1 月 12 日- 2022 年 1 月 28 日	6.09	840,000.00	5,115,600.00

124	601788	光大证券	2022年1月4日-2022年1月18日	14.93	349,000.00	5,210,570.00
125	601800	中国交建	2022年1月4日-2022年1月20日	8.58	1,120,000.00	9,609,600.00
126	601816	京沪高铁	2022年1月5日-2022年1月28日	4.83	580,000.00	2,801,400.00
127	601818	光大银行	2022年1月4日-2022年1月4日	3.32	10,000.00	33,200.00
128	601857	中国石油	2022年1月6日-2022年1月27日	4.91	560,000.00	2,749,600.00
129	601865	福	2022	57.94	120,000.00	6,952,800.00

		莱特	年 1 月 6 日-2022 年 1 月 21 日			
130	601877	正泰电器	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	53.89	150,000.00	8,083,500.00
131	601878	浙商证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	13.18	350,000.00	4,613,000.00
132	601881	中国银河	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 27 日	11.19	350,000.00	3,916,500.00
133	601888	中国中免	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 20 日	219.41	70,000.00	15,358,700.00

134	601899	紫金矿业	2022年1月5日-2022年1月28日	9.70	976,000.00	9,467,200.00
135	601901	方正证券	2022年1月4日-2022年1月28日	7.84	1,210,000.00	9,486,400.00
136	601919	中远海控	2022年1月4日-2022年1月28日	18.69	1,523,000.00	28,464,870.00
137	601933	永辉超市	2022年1月10日-2022年1月28日	4.05	1,269,000.00	5,139,450.00
138	601939	建设银行	2022年1月5日-2022年1月28日	5.86	240,000.00	1,406,400.00

			日			
139	601966	玲珑轮胎	2022年1月4日-2022年1月20日	36.55	110,000.00	4,020,500.00
140	601985	中国核电	2022年1月5日-2022年1月28日	8.30	2,120,000.00	17,596,000.00
141	601988	中国银行	2022年1月4日-2022年1月14日	3.05	580,000.00	1,769,000.00
142	601989	中国重工	2022年1月6日-2022年1月28日	4.22	950,000.00	4,009,000.00
143	601990	南京证券	2022年1月5日-2022年1月28日	9.91	250,000.00	2,477,500.00

			日			
144	601995	中金公司	2022年1月13日-2022年1月21日	49.03	70,000.00	3,432,100.00
145	603019	中科曙光	2022年1月4日-2022年1月28日	27.57	321,000.00	8,849,970.00
146	603160	汇顶科技	2022年1月6日-2022年1月28日	107.77	70,000.00	7,543,900.00
147	603185	上机数控	2022年1月20日-2022年1月20日	166.98	10,000.00	1,669,800.00
148	603195	公牛集团	2022年1月10日-2022	167.30	10,000.00	1,673,000.00

			年 1 月 10 日			
149	603259	药 明 康 德	2022 年 1 月 25 日- 2022 年 1 月 27 日	118.58	20,000.00	2,371,600.00
150	603260	合 盛 硅 业	2022 年 1 月 20 日- 2022 年 1 月 20 日	131.97	10,000.00	1,319,700.00
151	603288	海 天 味 业	2022 年 1 月 4 日- 2022 年 1 月 28 日	105.11	220,000.00	23,124,200.00
152	603345	安 井 食 品	2022 年 1 月 21 日- 2022 年 1 月 21 日	170.78	10,000.00	1,707,800.00
153	603369	今 世	2022 年 1	54.40	150,000.00	8,160,000.00

		缘	月 10 日- 2022 年1 月 25 日			
154	603501	韦 尔 股 份	2022 年1 月4 日- 2022 年1 月 21 日	310.77	40,000.00	12,430,800.00
155	603517	绝 味 食 品	2022 年1 月4 日- 2022 年1 月 28 日	68.33	50,000.00	3,416,500.00
156	603589	口 子 窖	2022 年1 月 14 日- 2022 年1 月 28 日	70.87	60,000.00	4,252,200.00
157	603658	安 图 生 物	2022 年1 月6 日- 2022 年1 月 25 日	55.06	71,000.00	3,909,260.00

158	603659	璞泰来	2022年1月14日-2022年1月28日	160.61	40,000.00	6,424,400.00
159	603799	华友钴业	2022年1月4日-2022年1月27日	110.31	180,000.00	19,855,800.00
160	603806	福斯特	2022年1月4日-2022年1月27日	130.55	40,000.00	5,222,000.00
161	603833	欧派家居	2022年1月4日-2022年1月5日	147.50	30,000.00	4,425,000.00
162	603882	金城医学	2022年1月5日-2022年1月28日	111.37	70,000.00	7,795,900.00

163	603986	兆易创新	2022年1月4日-2022年1月28日	175.85	100,000.00	17,585,000.00
164	603993	洛阳钼业	2022年1月4日-2022年1月26日	5.58	1,840,000.00	10,267,200.00
165	688012	中微公司	2022年1月6日-2022年1月6日	126.60	100,000.00	12,660,000.00
合计	-	-	-	-	84,611,000.00	1,427,680,190.00

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

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建设银行，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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 0.13%(2020 年 12 月 31 日：0.12%)。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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。

本基金所持大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 0.15%。

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。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 22,870,350,122.21 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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	48,892,471.71	-	-	-	48,892,471.71
结算备付金	185,716.61	-	-	-	185,716.61
存出保证金	100,023.32	-	-	-	100,023.32
交易性金融资产	30,716,000.00	-	-	22,824,978,874.57	22,855,694,874.57
应收证券清算款	-	-	-	413,566.40	413,566.40
应收股利	-	-	-	28,150.00	28,150.00
应收利息	-	-	-	694,259.62	694,259.62
资产总计	79,894,211.64	-	-	22,826,114,850.59	22,906,009,062.23
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	-	-	-	9,743,403.25	9,743,403.25
应付托管费	-	-	-	1,948,680.64	1,948,680.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,044,000.75	7,044,000.75
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	299,327.18	299,327.18
负债总计	-	-	-	19,035,411.82	19,035,411.82
利率敏感度缺口	79,894,211.64	-	-	22,807,079,438.77	22,886,973,650.41

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	56,401,060.37	-	-	-	56,401,060.37
结算备付金	205,251.86	-	-	-	205,251.86
存出保证金	177,301.87	-	-	-	177,301.87
交易性金融资产	28,155,000.00	-	-	23,827,099,126.65	23,855,254,126.65
应收证券清算款	-	-	-	7,313,904.20	7,313,904.20
应收利息	-	-	-	8,107.79	8,107.79
资产总计	84,938,614.10	-	-	23,834,421,138.64	23,919,359,752.74
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	-	-	-	9,780,050.26	9,780,050.26
应付托管费	-	-	-	1,956,010.06	1,956,010.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,898,005.44	2,898,005.44
应交税费	-	-	-	68.79	68.79
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	287,962.58	287,962.58
负债总计	-	-	-	14,922,097.13	14,922,097.13
利率敏感度缺口	84,938,614.10	-	-	23,819,499,041.51	23,904,437,652.61

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 0.13%(2020 年 12 月 31 日：0.12%)，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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证 180 指数成份股和备选成份股股票(含存托凭证)投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股(含存托凭证)、债券及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地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	22,824,978,874.57	99.73	23,827,099,126.65	99.68
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	22,824,978,874.57	99.73	23,827,099,126.65	99.68

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
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,141,170,000.00	增加约 1,191,240,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,141,170,000.00	减少约 1,191,240,000.00

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) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 887,114,283.55 元(2020 年度：2,635,344,741.82 元)，其中包括以股票支付的申购款 934,043,793.72 元和以现金支付的申购款-46,929,510.17 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 2,677,893,277.07 元和以现金支付的申购款-42,548,535.25 元)。

(2) 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 22,821,056,411.28 元,属于第二层次的余额为 30,716,000.00 元,属于第三层次的余额为 3,922,463.29 元(2020 年 12 月 31 日:第一层次 23,792,915,819.28 元,第二层次 62,338,307.37 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 5,188,050.46 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 3,922,463.29 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 1,904,937.10 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。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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。

(4) 除公允价值、基金申购款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	22,824,978,874.57	99.65
	其中:股票	22,824,978,874.57	99.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,716,000.00	0.13
	其中:债券	30,716,000.00	0.13
	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	49,078,188.32	0.21

	计		
8	其他各项资产	1,235,999.34	0.01
9	合计	22,906,009,062.23	100.00

注：本报告期末基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 1,427,680,190.00 元，占基金资产净值的比例为 6.24%。

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	18,272,800.00	0.08
B	采矿业	774,915,316.89	3.39
C	制造业	11,234,858,651.91	49.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	828,579,203.30	3.62
E	建筑业	654,735,544.69	2.86
F	批发和零售业	87,350,618.99	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	564,288,904.60	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	753,638,490.98	3.29
J	金融业	6,668,646,070.38	29.14
K	房地产业	296,192,717.34	1.29
L	租赁和商务服务业	377,641,470.88	1.65
M	科学研究和技术服务业	429,043,784.40	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	133,435,944.38	0.58

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,821,599,518.74	99.71

8.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,275,374.68	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	69,749.68	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,379,355.83	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	1,106,923	2,269,192,150.00	9.91
2	600036	招商银行	21,846,321	1,064,134,295.91	4.65
3	601318	中国平安	19,119,797	963,828,966.77	4.21
4	601012	隆基股份	7,641,104	658,663,164.80	2.88
5	601166	兴业银行	25,666,695	488,693,872.80	2.14
6	600900	长江电力	20,075,063	455,703,930.10	1.99
7	603259	药明康德	3,618,180	429,043,784.40	1.87
8	600276	恒瑞医药	7,899,736	400,595,612.56	1.75
9	600030	中信证券	15,031,990	396,994,855.90	1.73
10	601888	中国中免	1,721,168	377,641,470.88	1.65
11	600887	伊利股份	9,029,324	374,355,773.04	1.64
12	601398	工商银行	61,877,128	286,491,102.64	1.25
13	603501	韦尔股份	919,586	285,779,741.22	1.25
14	600309	万华化学	2,769,400	279,709,400.00	1.22
15	600809	山西汾酒	860,200	271,633,956.00	1.19
16	601899	紫金矿业	25,436,560	246,734,632.00	1.08
17	600031	三一重工	10,488,167	239,130,207.60	1.04
18	603288	海天味业	2,229,226	234,313,944.86	1.02
19	600436	片仔癀	531,475	232,334,296.25	1.02
20	601328	交通银行	48,483,349	223,508,238.89	0.98
21	600438	通威股份	4,765,050	214,236,648.00	0.94
22	600837	海通证券	17,046,572	208,990,972.72	0.91
23	601919	中远海控	11,166,824	208,707,940.56	0.91
24	600690	海尔智家	6,681,236	199,702,144.04	0.87
25	600048	保利发展	12,680,262	198,192,495.06	0.87
26	600406	国电南瑞	4,893,804	195,898,974.12	0.86
27	603799	华友钴业	1,722,008	189,954,702.48	0.83
28	601668	中国建筑	37,014,390	185,071,950.00	0.81
29	601288	农业银行	62,011,615	182,314,148.10	0.80
30	688981	中芯国际	3,423,460	181,409,145.40	0.79
31	600000	浦发银行	20,733,363	176,855,586.39	0.77
32	600111	北方稀土	3,845,657	176,131,090.60	0.77

33	600016	民生银行	43,790,437	170,782,704.30	0.75
34	600585	海螺水泥	4,234,098	170,634,149.40	0.75
35	600104	上汽集团	8,246,598	170,127,316.74	0.74
36	600745	闻泰科技	1,314,915	170,018,509.50	0.74
37	601816	京沪高铁	34,647,824	167,348,989.92	0.73
38	603986	兆易创新	941,564	165,574,029.40	0.72
39	601601	中国太保	6,043,519	163,900,235.28	0.72
40	601688	华泰证券	9,091,807	161,470,492.32	0.71
41	600893	航发动力	2,351,595	149,232,218.70	0.65
42	601211	国泰君安	7,962,580	142,450,556.20	0.62
43	600089	特变电工	6,683,846	141,497,019.82	0.62
44	601088	中国神华	5,817,664	131,013,793.28	0.57
45	601766	中国中车	21,451,712	130,640,926.08	0.57
46	600050	中国联通	32,819,437	128,980,387.41	0.56
47	600570	恒生电子	2,061,944	128,149,819.60	0.56
48	601229	上海银行	17,551,020	125,138,772.60	0.55
49	600919	江苏银行	20,846,734	121,536,459.22	0.53
50	600660	福耀玻璃	2,474,483	116,647,128.62	0.51
51	601169	北京银行	26,142,433	116,072,402.52	0.51
52	600999	招商证券	6,554,890	115,693,808.50	0.51
53	688599	天合光能	1,461,627	115,322,370.30	0.50
54	600905	三峡能源	15,139,563	113,698,118.13	0.50
55	601988	中国银行	37,212,633	113,498,530.65	0.50
56	600019	宝钢股份	15,715,281	112,521,411.96	0.49
57	600010	包钢股份	40,205,089	112,172,198.31	0.49
58	601669	中国电建	13,508,259	109,146,732.72	0.48
59	600958	东方证券	7,369,937	108,632,871.38	0.47
60	601633	长城汽车	2,161,022	104,896,007.88	0.46
61	600196	复星医药	2,129,611	104,223,162.34	0.46
62	601390	中国中铁	17,984,240	104,128,749.60	0.45
63	600588	用友网络	2,885,109	103,517,710.92	0.45
64	601985	中国核电	12,363,834	102,619,822.20	0.45
65	601877	正泰电器	1,897,234	102,241,940.26	0.45
66	600028	中国石化	23,616,691	99,898,602.93	0.44
67	603659	璞泰来	612,320	98,344,715.20	0.43
68	601658	邮储银行	19,182,700	97,831,770.00	0.43
69	601818	光大银行	29,174,476	96,859,260.32	0.42
70	601377	兴业证券	9,460,944	93,474,126.72	0.41
71	601628	中国人寿	2,941,097	88,497,608.73	0.39
72	603806	福斯特	671,000	87,599,050.00	0.38
73	688111	金山办公	324,994	86,123,410.00	0.38
74	600346	恒力石化	3,729,449	85,665,443.53	0.37
75	601989	中国重工	20,120,721	84,909,442.62	0.37
76	601600	中国铝业	13,842,500	84,300,825.00	0.37

77	601857	中国石油	17,132,098	84,118,601.18	0.37
78	601138	工业富联	7,009,124	83,548,758.08	0.37
79	601225	陕西煤业	6,838,935	83,435,007.00	0.36
80	600426	华鲁恒升	2,608,398	81,642,857.40	0.36
81	600460	士兰微	1,497,403	81,159,242.60	0.35
82	600009	上海机场	1,698,075	79,283,121.75	0.35
83	601009	南京银行	8,826,739	79,087,581.44	0.35
84	600522	中天科技	4,658,646	79,010,636.16	0.35
85	600763	通策医疗	395,200	78,644,800.00	0.34
86	600741	华域汽车	2,778,514	78,631,946.20	0.34
87	600150	中国船舶	3,159,597	78,326,409.63	0.34
88	600176	中国巨石	4,233,493	77,049,572.60	0.34
89	601100	恒立液压	919,823	75,241,521.40	0.33
90	600011	华能国际	7,758,681	75,181,618.89	0.33
91	600760	中航沈飞	1,038,251	70,642,598.04	0.31
92	603993	洛阳钼业	12,480,020	69,638,511.60	0.30
93	601939	建设银行	11,854,172	69,465,447.92	0.30
94	600584	长电科技	2,197,000	68,150,940.00	0.30
95	600989	宝丰能源	3,882,749	67,404,522.64	0.29
96	601066	中信建投	2,294,024	67,100,202.00	0.29
97	600884	杉杉股份	2,045,900	67,044,143.00	0.29
98	600926	杭州银行	5,228,120	67,024,498.40	0.29
99	600132	重庆啤酒	426,628	64,557,348.96	0.28
100	601360	三六零	5,035,231	64,048,138.32	0.28
101	601186	中国铁建	8,108,674	63,247,657.20	0.28
102	601555	东吴证券	7,119,124	63,075,438.64	0.28
103	601868	中国能建	22,858,200	62,402,886.00	0.27
104	600600	青岛啤酒	625,650	61,939,350.00	0.27
105	600029	南方航空	8,929,421	60,809,357.01	0.27
106	603486	科沃斯	401,970	60,677,371.50	0.27
107	600886	国投电力	5,266,989	60,412,363.83	0.26
108	603369	今世缘	1,104,772	60,099,596.80	0.26
109	600547	山东黄金	3,192,145	60,076,168.90	0.26
110	601238	广汽集团	3,847,141	58,438,071.79	0.26
111	600352	浙江龙盛	4,590,300	57,975,489.00	0.25
112	601336	新华保险	1,471,388	57,207,565.44	0.25
113	601901	方正证券	7,250,640	56,845,017.60	0.25
114	603019	中科曙光	2,060,461	56,806,909.77	0.25
115	688012	中微公司	445,034	56,341,304.40	0.25
116	603882	金城医学	491,974	54,791,144.38	0.24
117	601800	中国交建	6,212,444	53,302,769.52	0.23
118	600298	安琪酵母	879,426	53,082,153.36	0.23
119	600862	中航高科	1,474,302	52,721,039.52	0.23
120	601865	福莱特	899,300	52,105,442.00	0.23

121	600383	金地集团	3,980,757	51,630,418.29	0.23
122	601788	光大证券	3,446,629	51,458,170.97	0.22
123	601108	财通证券	4,434,500	49,311,640.00	0.22
124	600918	中泰证券	4,922,100	49,073,337.00	0.21
125	600109	国金证券	4,276,092	48,448,122.36	0.21
126	601618	中国中冶	12,577,535	48,171,959.05	0.21
127	601111	中国国航	5,272,672	48,139,495.36	0.21
128	600183	生益科技	2,036,043	47,948,812.65	0.21
129	603833	欧派家居	322,018	47,497,655.00	0.21
130	603392	万泰生物	213,580	47,307,970.00	0.21
131	601155	新城控股	1,591,823	46,369,803.99	0.20
132	603589	口子窖	633,245	44,878,073.15	0.20
133	603517	绝味食品	650,100	44,421,333.00	0.19
134	601966	玲珑轮胎	1,208,724	44,178,862.20	0.19
135	600516	方大炭素	4,035,901	43,668,448.82	0.19
136	603160	汇顶科技	404,005	43,539,618.85	0.19
137	600038	中直股份	517,524	41,557,177.20	0.18
138	600779	水井坊	344,266	41,308,477.34	0.18
139	601689	拓普集团	777,400	41,202,200.00	0.18
140	600362	江西铜业	1,832,448	40,918,563.84	0.18
141	601607	上海医药	2,034,287	40,421,282.69	0.18
142	600143	金发科技	3,181,998	40,029,534.84	0.17
143	601990	南京证券	3,901,103	38,659,930.73	0.17
144	688169	石头科技	47,040	38,243,520.00	0.17
145	603260	合盛硅业	284,000	37,479,480.00	0.16
146	600872	中炬高新	986,047	37,440,204.59	0.16
147	600061	国投资本	4,529,802	37,234,972.44	0.16
148	600699	均胜电子	1,693,038	37,196,044.86	0.16
149	603345	安井食品	216,000	36,888,480.00	0.16
150	688185	康希诺	120,674	36,147,896.70	0.16
151	601878	浙商证券	2,733,666	36,029,717.88	0.16
152	601728	中国电信	8,235,643	35,651,241.61	0.16
153	600161	天坛生物	1,207,000	34,954,720.00	0.15
154	600521	华海药业	1,582,438	34,275,607.08	0.15
155	688126	沪硅产业	1,315,255	33,959,884.10	0.15
156	601696	中银证券	2,449,704	32,948,518.80	0.14
157	603185	上机数控	193,719	32,347,198.62	0.14
158	601216	君正集团	5,965,400	31,199,042.00	0.14
159	601162	天风证券	7,623,950	30,876,997.50	0.13
160	600882	妙可蓝多	544,900	30,514,400.00	0.13
161	688396	华润微	465,594	30,077,372.40	0.13
162	600606	绿地控股	6,742,590	29,262,840.60	0.13
163	600118	中国卫星	1,041,563	28,278,435.45	0.12
164	601995	中金公司	564,400	27,672,532.00	0.12

165	688363	华熙生物	169,010	26,247,253.00	0.11
166	601933	永辉超市	6,397,886	25,911,438.30	0.11
167	601881	中国银河	2,281,300	25,527,747.00	0.11
168	600315	上海家化	599,800	24,237,918.00	0.11
169	601319	中国人保	4,993,900	23,471,330.00	0.10
170	603195	公牛集团	137,552	23,012,449.60	0.10
171	603658	安图生物	414,031	22,796,546.86	0.10
172	600511	国药股份	666,600	21,017,898.00	0.09
173	600025	华能水电	3,181,085	20,963,350.15	0.09
174	603087	甘李药业	295,660	20,796,724.40	0.09
175	601236	红塔证券	1,661,320	19,802,934.40	0.09
176	600598	北大荒	1,255,000	18,272,800.00	0.08
177	601456	国联证券	1,270,900	17,754,473.00	0.08
178	605499	东鹏饮料	77,000	14,001,680.00	0.06
179	600621	华鑫股份	933,400	12,918,256.00	0.06
180	601698	中国卫通	783,100	11,268,809.00	0.05

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	688187	时代电气	33,865.00	2,595,752.25	0.01
2	688800	瑞可达	1,967.00	262,653.51	0.00
3	688670	金迪克	2,310.00	171,194.10	0.00
4	688305	科德数控	1,496.00	158,097.28	0.00
5	688210	统联精密	2,218.00	87,677.54	0.00
6	600927	永安期货	1,859.00	69,749.68	0.00
7	603230	内蒙新华	1,141.00	29,517.67	0.00
8	603176	汇通集团	1,924.00	4,713.80	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	380,251,744.39	1.59
2	601919	中远海控	224,283,045.39	0.94
3	688981	中芯国际	187,344,962.51	0.78
4	601816	京沪高铁	171,073,238.16	0.72

5	688111	金山办公	143,635,158.39	0.60
6	603259	药明康德	116,481,746.10	0.49
7	688599	天合光能	112,178,310.92	0.47
8	600905	三峡能源	101,299,256.35	0.42
9	600426	华鲁恒升	94,152,752.94	0.39
10	600460	士兰微	93,033,946.58	0.39
11	601600	中国铝业	88,394,863.27	0.37
12	600132	重庆啤酒	77,794,501.65	0.33
13	600884	杉杉股份	74,957,616.36	0.31
14	603882	金域医学	73,775,770.74	0.31
15	601658	邮储银行	72,966,808.12	0.31
16	600050	中国联通	71,630,191.00	0.30
17	603486	科沃斯	69,542,828.09	0.29
18	688169	石头科技	66,359,407.71	0.28
19	600900	长江电力	66,142,077.45	0.28
20	601868	中国能建	61,610,650.00	0.26

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	601318	中国平安	183,069,854.82	0.77
2	600703	三安光电	181,553,655.10	0.76
3	600036	招商银行	180,001,871.76	0.75
4	600887	伊利股份	132,299,080.12	0.55
5	600519	贵州茅台	125,590,455.34	0.53
6	600276	恒瑞医药	112,582,623.63	0.47
7	601166	兴业银行	81,614,088.17	0.34
8	601006	大秦铁路	79,914,073.51	0.33
9	601888	中国中免	71,929,427.07	0.30
10	600030	中信证券	58,675,969.41	0.25
11	601916	浙商银行	53,437,057.00	0.22
12	600739	辽宁成大	47,811,171.66	0.20
13	601398	工商银行	46,491,755.00	0.19
14	601688	华泰证券	46,363,884.37	0.19
15	600115	中国东航	46,220,260.40	0.19
16	600309	万华化学	45,441,215.50	0.19

17	601099	太平洋	45,037,821.26	0.19
18	603288	海天味业	43,030,184.70	0.18
19	600201	生物股份	42,829,143.16	0.18
20	600031	三一重工	42,594,634.72	0.18

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	4,501,368,528.26
卖出股票的收入（成交）总额	4,103,899,335.95

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	-	-
	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）	30,716,000.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,716,000.00	0.13

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	113052	兴业转债	307,160	30,716,000.00	0.13

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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（银保监会

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。

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	100,023.32
2	应收证券清算款	413,566.40
3	应收股利	28,150.00
4	应收利息	694,259.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,235,999.34

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

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	601012	隆基股份	67,236,000.00	0.29	转融通证券出借

2	600519	贵州茅台	61,500,000.00	0.27	转融通证券出借
3	601318	中国平安	23,188,600.00	0.10	转融通证券出借
4	601888	中国中免	15,358,700.00	0.07	转融通证券出借
5	600900	长江电力	11,123,000.00	0.05	转融通证券出借
6	600036	招商银行	10,716,200.00	0.05	转融通证券出借
7	600276	恒瑞医药	4,563,900.00	0.02	转融通证券出借
8	603259	药明康德	2,371,600.00	0.01	转融通证券出借
9	601166	兴业银行	1,904,000.00	0.01	转融通证券出借
10	600030	中信证券	1,848,700.00	0.01	转融通证券出借

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

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	688187	时代电气	2,595,752.25	0.01	处于锁定期
2	688800	瑞可达	262,653.51	0.00	处于锁定期
3	688670	金迪克	171,194.10	0.00	处于锁定期
4	688305	科德数控	158,097.28	0.00	处于锁定期
5	688210	统联精密	87,677.54	0.00	处于锁定期

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
15,861	349,161.95	5,360,627,135.00	96.80%	177,430,544.00	3.20%

9.2 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	中央汇金投资有限责任公司	5,231,571,046.00	94.47%
2	三菱日联国际资产管理公司—MAXIS 华安中国股票(上证 180 指数)ETF	49,852,214.00	0.90%

3	孙晓燕	7,150,000.00	0.13%
4	国泰君安证券股份有限公司	5,130,500.00	0.09%
5	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公司	4,500,000.00	0.08%
6	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	4,453,600.00	0.08%
7	广发证券股份有限公司	3,976,240.00	0.07%
8	中信建投证券股份有限公司	3,783,998.00	0.07%
9	招商证券股份有限公司	2,654,125.00	0.05%
10	广东欣利置业投资有限公司	2,000,000.00	0.04%
11	中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	38,881,625.00	0.70%

9.3 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%

9.4 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。

9.5 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(2006 年 4 月 13 日)基金份额总额	1,072,822,105.00
本报告期期初基金份额总额	5,590,557,679.00
本报告期基金总申购份额	212,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	265,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,538,057,679.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2021 年 6 月 29 日至 2021 年 7 月 21 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过《关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》，决议自 2021 年 7 月 22 日起生效，并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金修改后的《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自 2021 年 7 月 22 日起生效。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2021 年 7 月 23 日发布的《华安基金管理有限公司关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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：

无。

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

本基金管理人于 2021 年 7 月 23 日发布的《华安基金管理有限公司关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2021 年 7 月 22 日起上证 180 交易型开放式指数证券投资基金投资范围增加转融通证券出借业务，基金的投资策略作出相应的改变。详情请见本基金管理人发布的相关公告。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

11.6 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为人民币 167,000.00 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。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	5	5,063,031,146.89	59.01%	4,708,022.58	64.73%	-
招商证券	1	3,517,063,729.04	40.99%	2,564,745.39	35.27%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比 例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
国泰君安证券	183,909,565.50	85.69%	-	-	-	-
招商证券	30,716,000.00	14.31%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.9 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	上证 180 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	2021-02-06

		定媒介	
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	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金变更申赎简称的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-19
9	上证 180 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	上证 180 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
11	上证 180 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
12	华安上证 180 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
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	上证 180 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
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	上证 180 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	2021-05-31
19	上证 180 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 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	2021-05-31
20	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	2021-05-31

	关联方承销证券的公告（无锡振华）	露网站和公司网站等指定媒介	
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（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
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（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
23	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
24	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-19
25	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-21
26	关于以通讯方式召开上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-22
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（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
28	关于新增上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会投票方式的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-03
29	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 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
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（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
31	上证 180 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	2021-07-23
32	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议(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	2021-07-23
33	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-23
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（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

35	上证 180 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	2021-07-28
36	上证 180 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 3 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-07-28
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（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
38	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
39	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-08-30
40	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
41	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
42	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
43	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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	2021-12-27

		定媒介	
50	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	20210101-20211231	5,231,571.046.00	0.00	0.00	5,231,571,046.00	94.47%
联接基金	1	20210101-20211231	48,628,725.00	1,150,000.00	10,897,100.00	38,881,625.00	0.70%
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、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》；
- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于核准上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》；
- 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；

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