

# 华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 27 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50

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 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
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 .....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	78
8.12 投资组合报告附注 .....	78
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>79</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
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情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>79</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>80</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
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 .....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.8 其他重大事件 .....	82
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>83</b>
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 .....	83
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
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	华安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中证 500 指数增强	
基金主代码	014587	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 24 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	65,524,657.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014587	014588
报告期末下属分级基金的份额总额	23,285,283.87 份	42,239,373.55 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要利用量化选股模型，在保持对中证 500 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。具体策略包括：</p> <p>（1）指数化被动投资策略</p> <p>（2）量化增强投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>6、参与融资业务相关策略</p> <p>7、参与转融通证券出借业务投资策略</p> <p>8、存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## 2.5 其他相关资料

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	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## § 3 主要财务指标、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	2023 年		2022 年 5 月 24 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-8,807,798.65	-14,320,937.58	762,404.18	703,200.58

本期利润	-8,255,199.49	-11,458,918.37	-928,094.27	-1,167,200.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1082	-0.1068	-0.0178	-0.0184
本期加权平均净值利润率	-11.48%	-11.38%	-1.80%	-1.88%
本期基金份额净值增长率	-12.32%	-12.66%	-5.16%	-5.39%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-4,736,036.35	-8,800,538.20	-1,782,069.64	-4,323,724.45
期末可供分配基金份额利润	-0.2034	-0.2083	-0.0516	-0.0539
期末基金资产净值	19,364,730.06	34,904,428.54	32,747,398.17	75,843,422.84
期末基金份额净值	0.8316	0.8263	0.9484	0.9461
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-16.84%	-17.37%	-5.16%	-5.39%

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

华安中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.68%	0.84%	-4.36%	0.82%	-0.32%	0.02%
过去六个月	-9.72%	0.77%	-9.01%	0.81%	-0.71%	-0.04%
过去一年	-12.32%	0.74%	-7.03%	0.78%	-5.29%	-0.04%

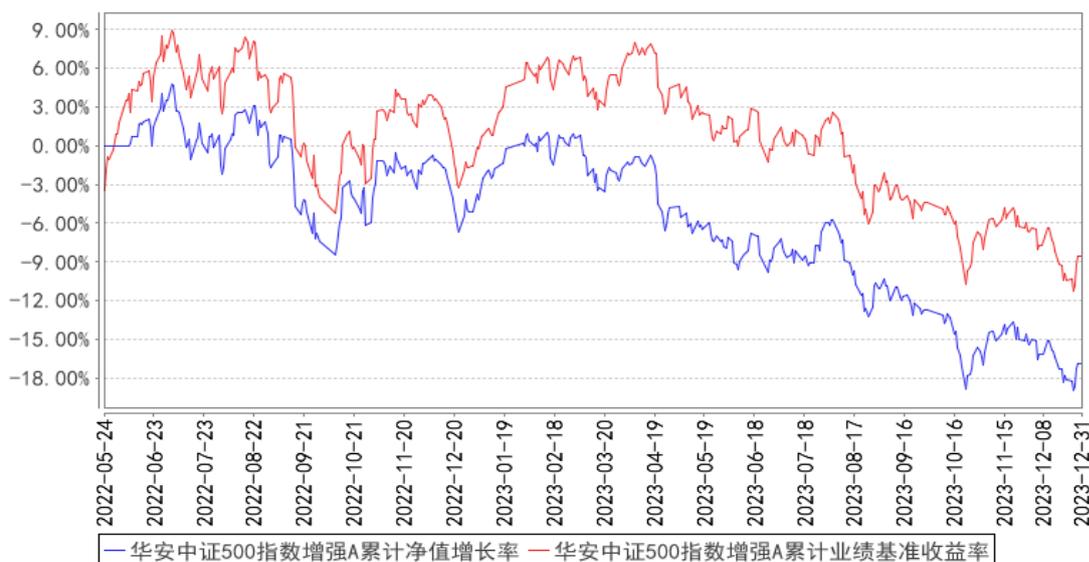
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-16.84%	0.82%	-8.52%	0.91%	-8.32%	-0.09%

华安中证 500 指数增强 C

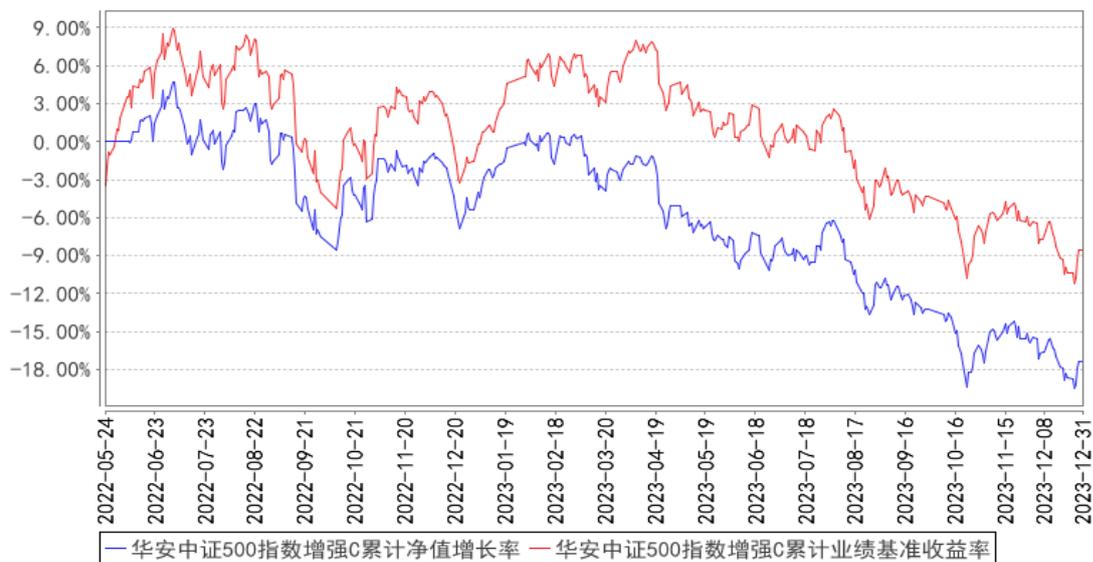
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.76%	0.83%	-4.36%	0.82%	-0.40%	0.01%
过去六个月	-9.90%	0.77%	-9.01%	0.81%	-0.89%	-0.04%
过去一年	-12.66%	0.73%	-7.03%	0.78%	-5.63%	-0.05%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-17.37%	0.82%	-8.52%	0.91%	-8.85%	-0.09%

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

华安中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

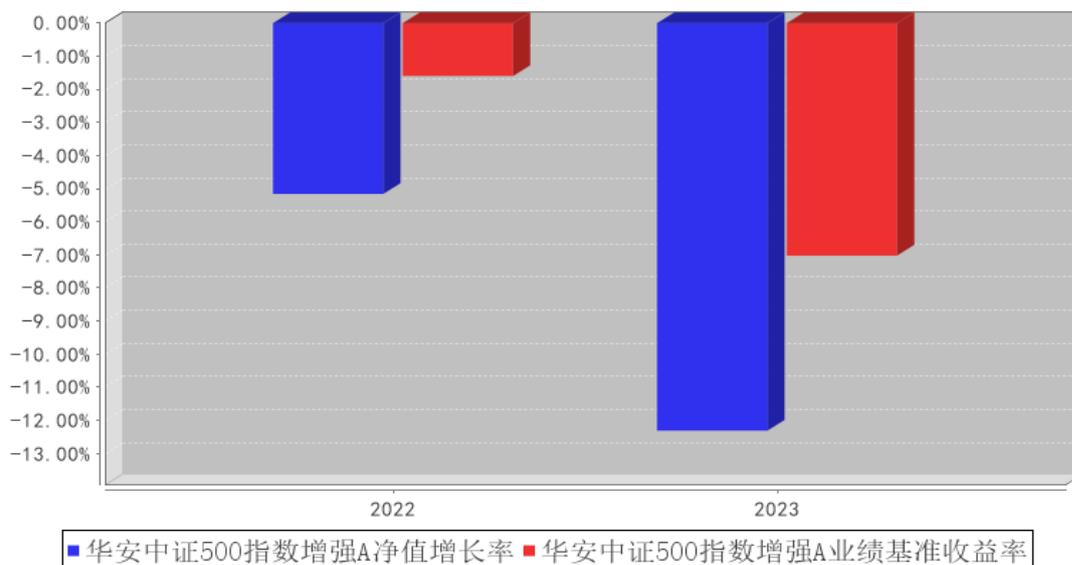


华安中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

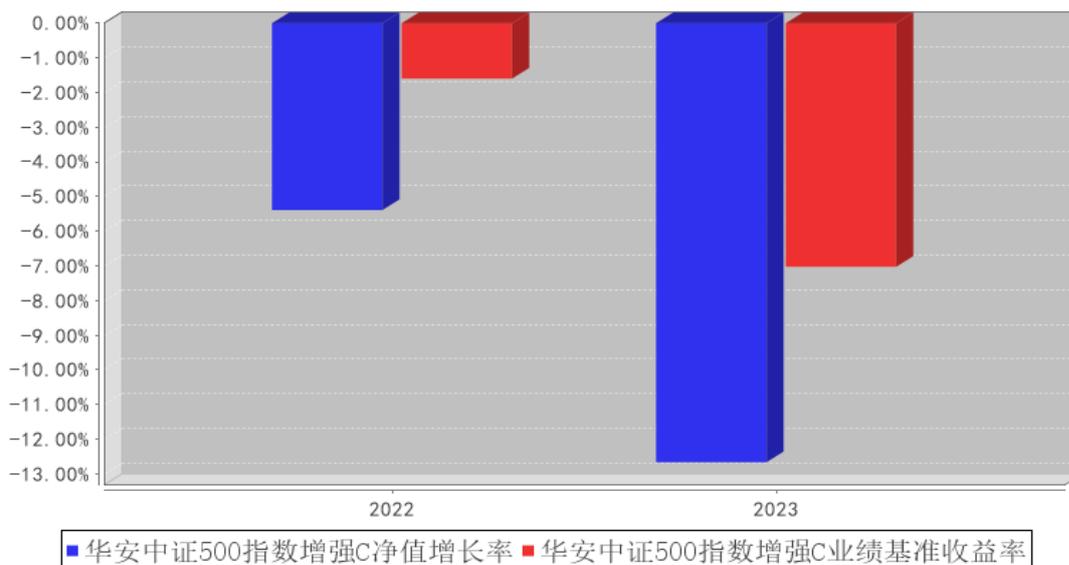


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华安中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期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

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本1.5亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至2023年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248只证券投资基金，管理资产规模达到6,040.77亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马韬	本基金的基金经理	2022年5月24日	-	9年	硕士研究生，9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 月至 2023 年 2 月，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起，同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
朱宝臣	本基金的基金经理	2022 年 5 月 30 日	2023 年 7 月 7 日	16 年	硕士研究生，16 年证券、基金行业从业经验。曾任中信证券风险控制部高级经理、中金国际金融有限公司资产管理部量化团队负责人、中金基金管理有限公司量化投资部量化投资负责人。2021 年 8 月加入华安基金，任量化投资部总监、基金经理。2022 年 5 月至 2023 年 7 月，担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 8 月至 2023 年 7 月，同时担任华安中证 1000 指数增强型证券投资基金、华安创新医药锐选量化股票型发起式证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 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 8 次，未出现异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年来看，国内宏观环境呈弱复苏态势。市场对经济的疫后强复苏预期逐渐向温和的现实状况回归。地产方面，在下半年出台了系列提振楼市的政策，但整体的政策效果并没有马上显现，地产销售没有明显的起色，长端利率再度下行。货币政策方面，2023 年维持了货币宽松环境，全年 MLF 降低了 25bps，降准两次共 0.5 个百分点。下半年受汇率压力、资金防空转等影响，狭义资金面有所收敛，但整体货币流动性保持在合理充裕状态。

从 2023 年权益市场的表现来看，主要宽基指数均呈现不同程度下跌，其中创业板跌幅明显，微盘股、中证 2000 取得正收益，特别是微盘股指数上涨接近 50%，小微盘风格演绎较为极致。行业板块来看，受 AI 主题催化，传媒、通信、计算机、汽车、电子领涨。从大类风格表现来看，“小市值+红利+低波”是全年表现最强的三大类因子，高盈利、高成长则相对弱势。另外，深度学习类的量价因子表现仍然较为稳定，维持了较高的收益及胜率。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.8316 元，本报告期份额净值增长率为-12.32%，同期业绩比较基准增长率为-7.03%；本基金 C 类份额净值为 0.8263 元；本报告期份额净值增长率为-12.66%，同期业绩比较基准增长率为-7.03%。

## 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 2024 年，国内经济仍将保持温和修复走势。楼市放松政策将持续推进，但地产端复苏效果有待观察。在 12 月底经济工作会议“以进促稳”、“先立后破”等指导方针下，财政政策方面跨周期、适度加力的政策端发力是今年稳经济的重要抓手。货币政策将继续保持稳健，配合财政政策发力。

从 ERP 的指标来看，当前权益资产赔率再次达到历史极值位置，主要大类宽基指数估值均处于历史较低水平，权益资产的配置性价比是比较高的。前期压制市场情绪的一些外生变量，也都有了不同程度的缓和，我们仍然相对看好权益资产的投资机会。

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

化因子策略，勤勉尽责，力争为投资者获得长期稳定的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作：

在合规风控方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在内审稽核方面，定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，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，以风险控制为核心，不断提高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、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21197 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了华安中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“华安中证 500 指数增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见

	<p>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,公允反映了华安中证 500 指数增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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,我们独立于华安中证 500 指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华安中证 500 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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安中证 500 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中证 500 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华安中证 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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中证 500 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中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   楼茜蓉
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 华安中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	2,698,548.24	5,514,065.40
结算备付金		718,108.86	850,854.96
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	51,132,817.71	102,658,649.46
其中: 股票投资		51,132,817.71	102,658,649.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		44,625.70	183,044.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		54,594,100.51	109,206,614.08
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		98,325.59	408,567.41
应付管理人报酬		27,764.27	56,851.93
应付托管费		6,941.02	14,212.99
应付销售服务费		11,911.03	26,160.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	180,000.00	110,000.00
负债合计		324,941.91	615,793.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	65,524,657.42	114,696,615.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-11,255,498.82	-6,105,794.09
净资产合计		54,269,158.60	108,590,821.01
负债和净资产总计		54,594,100.51	109,206,614.08

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 65,524,657.42 份，其中华安中证 500 指数增强 A 份额净值 0.8316 元，基金份额总额 23,285,283.87 份；华安中证 500 指数增强 C 份额净值 0.8263 元，基金份额总额 42,239,373.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-17,806,645.05	-1,321,481.26
1. 利息收入		55,431.69	101,185.71
其中：存款利息收入	7.4.7.9	55,431.69	31,854.70
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	69,331.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-21,286,386.06	1,131,699.51
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-24,150,988.38	-193,605.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	136,371.44	29,979.70
资产支持证券投 资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	330,277.26	248,879.11
股利收益	7.4.7.15	2,397,953.62	1,055,840.76
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-9,394.77
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.16	3,414,618.37	-3,560,899.63
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	9,690.95	1,006,533.15

<b>减：二、营业总支出</b>		1,907,472.81	773,813.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,051,316.31	408,628.32
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	262,829.06	102,157.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	407,833.92	148,775.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,790.16	898.76
8. 其他费用	7.4.7.19	183,703.36	113,353.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-19,714,117.86	-2,095,294.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-19,714,117.86	-2,095,294.87
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-19,714,117.86	-2,095,294.87

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	114,696,615.10	-	-6,105,794.09	108,590,821.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	114,696,615.10	-	-6,105,794.09	108,590,821.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-49,171,957.68	-	-5,149,704.73	-54,321,662.41
(一)、综合收益总额	-	-	-19,714,117.86	-19,714,117.86
(二)、本期基金	-49,171,957.68	-	14,564,413.13	-34,607,544.55

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	228,699,806.01	-	-5,474,244.64	223,225,561.37
2. 基金赎回款	- 277,871,763.69	-	20,038,657.77	-257,833,105.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	65,524,657.42	-	-11,255,498.82	54,269,158.60
项目	上年度可比期间 2022年5月24日(基金合同生效日)至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	309,758,591.90	-	-	309,758,591.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 195,061,976.80	-	-6,105,794.09	-201,167,770.89
(一)、综合收益总额	-	-	-2,095,294.87	-2,095,294.87
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	- 195,061,976.80	-	-4,010,499.22	-199,072,476.02
其中: 1. 基金申购款	95,871,627.67	-	-2,632,436.70	93,239,190.97

2. 基金赎回款	- 290,933,604.47	-	-1,378,062.52	-292,311,666.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	114,696,615.10	-	-6,105,794.09	108,590,821.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>朱学华</u>	<u>朱学华</u>	<u>陈松一</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

根据《华安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购或申购基金时收取认购费或申

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。当法律法规或监管机构的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 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 2024 年 3 月 22 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

#### 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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅

为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发

行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,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,以及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当期损益。

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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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、债券投资和资产支持证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、市盈率法、现金流量折现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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	2,698,548.24	5,514,065.40
等于：本金	2,698,261.06	5,513,482.99
加：应计利息	287.18	582.41
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,698,548.24	5,514,065.40

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,279,098.97	-	51,132,817.71	-146,281.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,279,098.97	-	51,132,817.71	-146,281.26
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	106,219,549.09	-	102,658,649.46	-3,560,899.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	106,219,549.09	-	102,658,649.46	-3,560,899.63

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	110,000.00
合计	180,000.00	110,000.00

### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安中证 500 指数增强 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,529,467.81	34,529,467.81
本期申购	103,500,227.23	103,500,227.23
本期赎回（以“-”号填列）	-114,744,411.17	-114,744,411.17
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	23,285,283.87	23,285,283.87

华安中证 500 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	80,167,147.29	80,167,147.29
本期申购	125,199,578.78	125,199,578.78
本期赎回（以“-”号填列）	-163,127,352.52	-163,127,352.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,239,373.55	42,239,373.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-129,264.75	-1,652,804.89	-1,782,069.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-129,264.75	-1,652,804.89	-1,782,069.64
本期利润	-8,807,798.65	552,599.16	-8,255,199.49
本期基金份额交易产生的变动数	4,201,027.05	1,915,688.27	6,116,715.32
其中：基金申购款	-1,340,501.82	-735,334.67	-2,075,836.49
基金赎回款	5,541,528.87	2,651,022.94	8,192,551.81
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-4,736,036.35	815,482.54	-3,920,553.81
华安中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-491,876.57	-3,831,847.88	-4,323,724.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-491,876.57	-3,831,847.88	-4,323,724.45
本期利润	-14,320,937.58	2,862,019.21	-11,458,918.37
本期基金份额交易产生的变动数	6,012,275.95	2,435,421.86	8,447,697.81
其中：基金申购款	-2,382,988.87	-1,015,419.28	-3,398,408.15
基金赎回款	8,395,264.82	3,450,841.14	11,846,105.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,800,538.20	1,465,593.19	-7,334,945.01

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,242.06	15,674.98
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	22,189.63	16,179.72
其他	-	-
合计	55,431.69	31,854.70

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-24,150,988.38	-193,605.29
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券	-	-

出借差价收入		
合计	-24,150,988.38	-193,605.29

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年5月24日（基金合 同生效日）至2022年12月31 日
卖出股票成交总额	2,347,052,461.58	693,878,840.76
减：卖出股票成本总额	2,367,316,856.69	692,796,297.61
减：交易费用	3,886,593.27	1,276,148.44
买卖股票差价收入	-24,150,988.38	-193,605.29

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年5月24日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	181.96	184,127.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	136,189.48	-154,147.93
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	136,371.44	29,979.70

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年5月24日（基金合同 生效日）至2022年12月31日
----	---------------------------------	------------------------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	703,817.80	240,248,483.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	567,300.00	236,204,369.68
减：应计利息总额	187.42	4,102,216.93
减：交易费用	140.90	96,044.87
买卖债券差价收入	136,189.48	-154,147.93

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同 生效日）至 2022 年 12 月 31
----	-------------------------------------------	---------------------------------------------------------

		日
股指期货投资收益	330,277.26	248,879.11

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,397,953.62	1,055,840.76
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,397,953.62	1,055,840.76

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,414,618.37	-3,560,899.63
股票投资	3,414,618.37	-3,560,899.63
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	3,414,618.37	-3,560,899.63

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	9,354.62	1,005,013.99
基金转换费收入	336.33	1,519.16
合计	9,690.95	1,006,533.15

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 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,679.14	2,953.37
其他	24.22	400.00
合计	183,703.36	113,353.37

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰君安投资管理股份有限公司	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
上海上国投资资产管理有限公司	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。

#### 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

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,051,316.31	408,628.32
其中：应支付销售机构的客户维护 费	331,615.19	173,561.91
应支付基金管理人的净管理费	719,701.12	235,066.41

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	262,829.06	102,157.18

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	29.49	29.49
华安基金管理有限公司	-	149,952.69	149,952.69
招商银行股份有限公司	-	1,692.24	1,692.24
合计	-	151,674.42	151,674.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C	合计
华安基金管理有限公司	-	22,115.33	22,115.33
招商银行股份有限公司	-	1,192.50	1,192.50
合计	-	23,307.83	23,307.83

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

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.40%/ 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

无。

##### 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

无。

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

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 5 月 24 日（基金合同生效日）至 2022 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
招商银行股份有限公司	2,698,548.24	33,242.06	5,514,065.40	15,674.98

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 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

无。

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

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动

式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金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，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 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招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小，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 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

#### 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 2023 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，可赎回基金份额净值(净资产)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%。

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 2023 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和结算备付金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,698,548.24	-	-	-	2,698,548.24
结算备付金	718,108.86	-	-	-	718,108.86
交易性金融资产	-	-	-	51,132,817.71	51,132,817.71
应收申购款	-	-	-	44,625.70	44,625.70
资产总计	3,416,657.10	-	-	51,177,443.41	54,594,100.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	98,325.59	98,325.59
应付管理人报酬	-	-	-	27,764.27	27,764.27
应付托管费	-	-	-	6,941.02	6,941.02

应付销售服务费	-	-	-	11,911.03	11,911.03
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	324,941.91	324,941.91
利率敏感度缺口	3,416,657.10	-	-	50,852,501.50	54,269,158.60
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,514,065.40	-	-	-	5,514,065.40
结算备付金	850,854.96	-	-	-	850,854.96
交易性金融资产	-	-	-	102,658,649.46	102,658,649.46
应收申购款	-	-	-	183,044.26	183,044.26
资产总计	6,364,920.36	-	-	102,841,693.72	109,206,614.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	408,567.41	408,567.41
应付管理人报酬	-	-	-	56,851.93	56,851.93
应付托管费	-	-	-	14,212.99	14,212.99
应付销售服务费	-	-	-	26,160.74	26,160.74
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	615,793.07	615,793.07
利率敏感度缺口	6,364,920.36	-	-	102,225,900.65	108,590,821.01

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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

#### 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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,132,817.71	94.22	102,658,649.46	94.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,132,817.71	94.22	102,658,649.46	94.54

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,432,212.01	4,570,000.00

	业绩比较基准下降 5%	-2,432,212.01	-4,570,000.00
--	----------------	---------------	---------------

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	51,132,817.71	102,658,649.46
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	51,132,817.71	102,658,649.46

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

###### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12

月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	51,132,817.71	93.66
	其中：股票	51,132,817.71	93.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,416,657.10	6.26
8	其他各项资产	44,625.70	0.08
9	合计	54,594,100.51	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	388,379.00	0.72
B	采矿业	2,919,909.00	5.38
C	制造业	19,542,573.25	36.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,553,366.26	4.71
E	建筑业	605,475.00	1.12
F	批发和零售业	1,576,743.00	2.91
G	交通运输、仓储	2,260,210.00	4.16

	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	2,811,085.00	5.18
J	金融业	7,250,771.00	13.36
K	房地产业	1,220,463.00	2.25
L	租赁和商务服务业	472,848.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	605,928.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	387,934.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	735,204.00	1.35
S	综合	-	-
	合计	43,330,888.51	79.84

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	157,693.00	0.29
B	采矿业	216,434.00	0.40
C	制造业	4,646,071.16	8.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,242.00	0.10
E	建筑业	95,270.00	0.18
F	批发和零售业	371,003.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	103,456.00	0.19
H	住宿和餐饮业	54,136.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,052,210.04	1.94
J	金融业	52,576.00	0.10
K	房地产业	106,325.00	0.20
L	租赁和商务服务业	104,960.00	0.19
M	科学研究和技术	396,311.00	0.73

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	206,824.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,205.00	0.08
Q	卫生和社会工作	140,213.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,801,929.20	14.38

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002595	豪迈科技	16,600	494,182.00	0.91
2	601555	东吴证券	66,800	488,308.00	0.90
3	601168	西部矿业	33,400	476,618.00	0.88
4	601077	渝农商行	113,600	463,488.00	0.85
5	600348	华阳股份	47,100	459,696.00	0.85
6	300395	菲利华	12,300	449,688.00	0.83
7	688521	芯原股份	8,985	448,890.60	0.83
8	603000	人民网	15,900	444,882.00	0.82
9	300866	安克创新	5,000	443,000.00	0.82
10	601997	贵阳银行	85,300	438,442.00	0.81
11	689009	九号公司	14,703	436,090.98	0.80
12	601717	郑煤机	33,900	428,835.00	0.79
13	600642	申能股份	65,800	422,436.00	0.78
14	603444	吉比特	1,700	416,704.00	0.77
15	600959	江苏有线	130,000	408,200.00	0.75
16	600373	中文传媒	30,800	405,944.00	0.75
17	002028	思源电气	7,800	405,912.00	0.75
18	000060	中金岭南	92,700	400,464.00	0.74
19	600369	西南证券	96,700	395,503.00	0.73
20	688536	思瑞浦	2,698	394,717.40	0.73
21	600500	中化国际	88,900	392,938.00	0.72
22	601665	齐鲁银行	100,400	392,564.00	0.72
23	601598	中国外运	74,800	391,952.00	0.72

24	000783	长江证券	72,800	391,664.00	0.72
25	000932	华菱钢铁	76,000	391,400.00	0.72
26	300296	利亚德	65,200	391,200.00	0.72
27	603882	金域医学	6,200	387,934.00	0.71
28	600998	九州通	55,300	387,653.00	0.71
29	600582	天地科技	68,500	372,640.00	0.69
30	600598	北大荒	31,100	372,267.00	0.69
31	600398	海澜之家	50,100	371,742.00	0.68
32	000402	金融街	101,700	369,171.00	0.68
33	000937	冀中能源	51,600	368,424.00	0.68
34	600155	华创云信	43,900	366,126.00	0.67
35	600066	宇通客车	27,600	365,700.00	0.67
36	000423	东阿阿胶	7,400	364,968.00	0.67
37	000930	中粮科技	54,900	364,536.00	0.67
38	601231	环旭电子	24,100	364,151.00	0.67
39	002153	石基信息	36,900	359,406.00	0.66
40	600873	梅花生物	37,600	359,080.00	0.66
41	600497	驰宏锌锗	71,100	359,055.00	0.66
42	600867	通化东宝	33,100	358,473.00	0.66
43	601162	天风证券	115,500	356,895.00	0.66
44	000893	亚钾国际	13,500	354,240.00	0.65
45	600517	国网英大	74,100	353,457.00	0.65
46	000630	铜陵有色	106,900	350,632.00	0.65
47	600863	内蒙华电	89,700	349,830.00	0.64
48	601866	中远海发	149,100	348,894.00	0.64
49	600177	雅戈尔	53,200	348,460.00	0.64
50	603868	飞科电器	6,900	348,450.00	0.64
51	002966	苏州银行	53,600	346,256.00	0.64
52	601158	重庆水务	61,000	345,870.00	0.64
53	600820	隧道股份	60,000	345,600.00	0.64
54	688779	长远锂科	47,282	345,158.60	0.64
55	002078	太阳纸业	28,300	344,411.00	0.63
56	600481	双良节能	40,700	344,322.00	0.63
57	000750	国海证券	95,600	338,424.00	0.62
58	002294	信立泰	10,300	336,398.00	0.62
59	000967	盈峰环境	70,100	332,975.00	0.61
60	000898	鞍钢股份	133,500	332,415.00	0.61
61	600739	辽宁成大	28,100	331,018.00	0.61
62	000728	国元证券	48,400	330,572.00	0.61
63	603688	石英股份	3,800	330,144.00	0.61
64	300251	光线传媒	40,400	329,260.00	0.61
65	600546	山煤国际	18,800	329,188.00	0.61
66	600339	中油工程	108,100	327,543.00	0.60

67	000598	兴蓉环境	57,100	324,899.00	0.60
68	601228	广州港	102,400	320,512.00	0.59
69	601966	玲珑轮胎	16,600	319,218.00	0.59
70	002430	杭氧股份	10,800	315,468.00	0.58
71	600879	航天电子	40,900	315,339.00	0.58
72	002673	西部证券	49,500	315,315.00	0.58
73	601000	唐山港	89,700	313,950.00	0.58
74	600325	华发股份	43,500	313,635.00	0.58
75	600060	海信视像	14,900	311,410.00	0.57
76	000987	越秀资本	51,700	311,234.00	0.57
77	600967	内蒙一机	37,600	310,576.00	0.57
78	300073	当升科技	8,100	309,420.00	0.57
79	601187	厦门银行	61,000	309,270.00	0.57
80	688107	安路科技	8,406	309,172.68	0.57
81	002423	中粮资本	45,800	305,944.00	0.56
82	601608	中信重工	79,000	304,940.00	0.56
83	600350	山东高速	43,400	301,196.00	0.56
84	601179	中国西电	60,900	300,237.00	0.55
85	000959	首钢股份	86,500	299,290.00	0.55
86	600390	五矿资本	63,900	299,052.00	0.55
87	000031	大悦城	100,600	298,782.00	0.55
88	002568	百润股份	11,900	292,859.00	0.54
89	600909	华安证券	59,900	292,312.00	0.54
90	002653	海思科	12,600	291,690.00	0.54
91	002558	巨人网络	26,100	290,754.00	0.54
92	600583	海油工程	48,300	286,902.00	0.53
93	600008	首创环保	106,200	285,678.00	0.53
94	600765	中航重机	14,700	280,917.00	0.52
95	688520	神州细胞	5,201	280,177.87	0.52
96	688200	华峰测控	2,261	277,650.80	0.51
97	002939	长城证券	34,600	276,800.00	0.51
98	002326	永太科技	23,700	275,394.00	0.51
99	002958	青农商行	104,600	274,052.00	0.50
100	300070	碧水源	54,700	272,953.00	0.50
101	600282	南钢股份	72,800	269,360.00	0.50
102	002683	广东宏大	13,300	267,064.00	0.49
103	601611	中国核建	37,500	259,875.00	0.48
104	002608	江苏国信	39,500	259,515.00	0.48
105	600755	厦门国贸	37,100	258,587.00	0.48
106	600377	宁沪高速	25,200	258,300.00	0.48
107	000709	河钢股份	120,900	257,517.00	0.47
108	601992	金隅集团	132,900	253,839.00	0.47
109	688297	中无人机	6,562	251,521.46	0.46

110	601216	君正集团	66,900	250,206.00	0.46
111	600808	马钢股份	91,400	248,608.00	0.46
112	000559	万向钱潮	47,900	248,601.00	0.46
113	000785	居然之家	74,800	246,840.00	0.45
114	600167	联美控股	43,200	244,944.00	0.45
115	600985	淮北矿业	14,400	239,472.00	0.44
116	600663	陆家嘴	27,300	238,875.00	0.44
117	603355	莱克电气	10,700	238,610.00	0.44
118	000553	安道麦 A	33,100	229,714.00	0.42
119	601828	美凯龙	58,400	226,008.00	0.42
120	002399	海普瑞	18,200	213,486.00	0.39
121	002563	森马服饰	36,600	211,182.00	0.39
122	002797	第一创业	35,300	205,093.00	0.38
123	002092	中泰化学	32,900	200,690.00	0.37
124	000513	丽珠集团	5,300	185,553.00	0.34
125	603225	新凤鸣	12,800	181,760.00	0.33
126	600032	浙江新能	22,521	181,519.26	0.33
127	600511	国药股份	5,300	151,686.00	0.28
128	000933	神火股份	8,300	139,440.00	0.26
129	603156	养元饮品	6,400	136,064.00	0.25
130	601958	金钼股份	14,300	135,135.00	0.25
131	600352	浙江龙盛	16,000	134,400.00	0.25
132	600885	宏发股份	4,700	129,908.00	0.24
133	000089	深圳机场	18,900	121,527.00	0.22
134	600655	豫园股份	19,100	118,611.00	0.22
135	000629	钒钛股份	31,200	102,336.00	0.19
136	601016	节能风电	34,000	102,000.00	0.19
137	601298	青岛港	16,000	98,880.00	0.18
138	300558	贝达药业	1,600	82,480.00	0.15
139	000401	冀东水泥	11,700	74,763.00	0.14
140	601880	辽港股份	47,700	69,165.00	0.13
141	300682	朗新集团	2,900	47,531.00	0.09
142	000539	粤电力 A	7,500	36,675.00	0.07
143	002468	申通快递	4,600	35,834.00	0.07
144	301029	怡合达	1,300	33,514.00	0.06
145	000825	太钢不锈	8,500	31,705.00	0.06
146	002791	坚朗五金	700	28,343.00	0.05
147	688690	纳微科技	933	25,582.86	0.05
148	601118	海南橡胶	3,800	16,112.00	0.03

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-----------	----------	------------------

1	003012	东鹏控股	18,500	152,625.00	0.28
2	300887	谱尼测试	11,500	135,815.00	0.25
3	301200	大族数控	3,500	132,195.00	0.24
4	300358	楚天科技	11,800	126,260.00	0.23
5	600363	联创光电	3,300	112,200.00	0.21
6	300512	中亚股份	13,200	111,012.00	0.20
7	601028	玉龙股份	10,300	110,313.00	0.20
8	300215	电科院	20,800	110,032.00	0.20
9	688699	明微电子	2,709	109,308.15	0.20
10	002171	楚江新材	14,500	108,460.00	0.20
11	000603	盛达资源	9,800	108,290.00	0.20
12	300768	迪普科技	7,200	106,416.00	0.20
13	002534	西子洁能	8,500	106,165.00	0.20
14	300994	久祺股份	7,200	105,840.00	0.20
15	300582	英飞特	8,800	105,688.00	0.19
16	002649	博彦科技	8,600	105,522.00	0.19
17	300802	矩子科技	5,500	105,160.00	0.19
18	301006	迈拓股份	5,800	105,038.00	0.19
19	002344	海宁皮城	25,600	104,960.00	0.19
20	603181	皇马科技	9,600	104,928.00	0.19
21	603308	应流股份	7,300	104,609.00	0.19
22	300132	青松股份	19,900	103,878.00	0.19
23	301108	洁雅股份	3,000	103,620.00	0.19
24	603609	禾丰股份	12,100	103,576.00	0.19
25	000088	盐田港	21,200	103,456.00	0.19
26	002124	天邦食品	28,500	103,455.00	0.19
27	603113	金能科技	12,800	103,296.00	0.19
28	300639	凯普生物	11,000	102,740.00	0.19
29	688737	中自科技	3,097	102,510.70	0.19
30	300645	正元智慧	5,600	101,864.00	0.19
31	300578	会畅通讯	5,700	101,802.00	0.19
32	300816	艾可蓝	4,100	101,147.00	0.19
33	300464	星徽股份	16,800	101,136.00	0.19
34	301335	天元宠物	4,700	100,580.00	0.19
35	000761	本钢板材	27,800	99,246.00	0.18
36	301047	义翘神州	1,200	98,880.00	0.18
37	688083	中望软件	978	97,350.12	0.18
38	603098	森特股份	7,000	95,270.00	0.18
39	688196	卓越新能	2,680	89,967.60	0.17
40	301239	普瑞眼科	1,000	86,000.00	0.16
41	688598	金博股份	902	63,049.80	0.12
42	600389	江山股份	3,300	57,420.00	0.11
43	300302	同有科技	4,200	56,868.00	0.10

44	603095	越剑智能	3,500	56,770.00	0.10
45	688418	震有科技	2,994	56,466.84	0.10
46	688786	悦安新材	1,269	56,394.36	0.10
47	002297	博云新材	7,000	55,790.00	0.10
48	301316	慧博云通	2,400	55,776.00	0.10
49	300893	松原股份	1,900	55,537.00	0.10
50	001256	炜冈科技	3,000	55,530.00	0.10
51	603528	多伦科技	6,100	55,388.00	0.10
52	002100	天康生物	6,300	55,251.00	0.10
52	301021	英诺激光	2,100	55,251.00	0.10
53	301219	腾远钴业	1,400	55,118.00	0.10
54	002565	顺灏股份	16,200	54,918.00	0.10
55	002250	联化科技	7,700	54,901.00	0.10
56	000917	电广传媒	10,000	54,800.00	0.10
57	600338	西藏珠峰	4,500	54,720.00	0.10
58	688085	三友医疗	2,804	54,678.00	0.10
59	688306	均普智能	9,798	54,574.86	0.10
60	002392	北京利尔	14,400	54,432.00	0.10
61	688022	瀚川智能	2,480	54,411.20	0.10
62	300900	广联航空	2,200	54,296.00	0.10
63	300829	金丹科技	2,600	54,288.00	0.10
64	002267	陕天然气	7,400	54,242.00	0.10
65	000735	罗牛山	9,400	54,238.00	0.10
66	300143	盈康生命	5,100	54,213.00	0.10
67	601007	金陵饭店	6,700	54,136.00	0.10
68	300198	纳川股份	20,100	54,069.00	0.10
69	688558	国盛智科	1,902	54,016.80	0.10
70	600223	福瑞达	5,600	53,928.00	0.10
71	688369	致远互联	1,557	53,887.77	0.10
72	600211	西藏药业	1,100	53,680.00	0.10
73	603533	掌阅科技	2,700	53,676.00	0.10
74	605376	博迁新材	1,900	53,580.00	0.10
75	300164	通源石油	11,200	53,424.00	0.10
76	688048	长光华芯	851	53,332.17	0.10
77	600713	南京医药	11,000	53,240.00	0.10
78	002277	友阿股份	13,200	53,196.00	0.10
79	301017	漱玉平民	2,600	53,118.00	0.10
80	600285	羚锐制药	3,100	53,041.00	0.10
81	002573	清新环境	10,700	52,965.00	0.10
82	688658	悦康药业	2,539	52,963.54	0.10
83	300695	兆丰股份	1,000	52,960.00	0.10
84	301185	鸥玛软件	2,600	52,936.00	0.10
85	300627	华测导航	1,700	52,734.00	0.10

86	300422	博世科	8,800	52,712.00	0.10
87	688519	南亚新材	2,046	52,704.96	0.10
88	601136	首创证券	3,100	52,576.00	0.10
89	600684	珠江股份	15,100	52,397.00	0.10
90	301314	科瑞思	1,200	52,368.00	0.10
91	600172	黄河旋风	14,000	52,360.00	0.10
92	001206	依依股份	3,300	52,074.00	0.10
93	300579	数字认证	2,000	51,720.00	0.10
94	301333	诺思格	800	51,584.00	0.10
95	688314	康拓医疗	1,563	51,438.33	0.09
96	300137	先河环保	9,200	51,152.00	0.09
97	000903	云内动力	17,300	50,516.00	0.09
98	300770	新媒股份	1,300	50,284.00	0.09
99	300593	新雷能	3,400	50,218.00	0.09
100	603118	共进股份	5,600	50,176.00	0.09
101	001270	铖昌科技	800	50,168.00	0.09
102	301063	海锅股份	2,200	50,160.00	0.09
103	002088	鲁阳节能	3,500	49,875.00	0.09
104	002434	万里扬	6,500	48,425.00	0.09
105	603377	东方时尚	10,500	44,205.00	0.08

#### 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	002422	科伦药业	10,659,643.00	9.82
2	300308	中际旭创	10,321,386.00	9.50
3	600489	中金黄金	10,020,057.66	9.23
4	600879	航天电子	9,961,260.10	9.17
5	603658	安图生物	9,320,922.22	8.58
6	600873	梅花生物	9,217,507.00	8.49
7	600373	中文传媒	9,017,224.00	8.30
8	688009	中国通号	8,962,743.74	8.25
9	002353	杰瑞股份	8,930,395.23	8.22
10	688122	西部超导	8,818,315.95	8.12
11	601872	招商轮船	8,708,861.25	8.02
12	600998	九州通	8,668,260.03	7.98
13	002152	广电运通	8,617,335.75	7.94
14	002738	中矿资源	8,542,353.60	7.87
15	002025	航天电器	8,494,566.30	7.82
16	600901	江苏金租	8,469,755.00	7.80
17	002430	杭氧股份	8,381,542.04	7.72
18	600079	人福医药	8,192,440.62	7.54

19	600967	内蒙一机	8,151,043.00	7.51
20	601098	中南传媒	8,065,595.03	7.43
21	002294	信立泰	8,045,315.00	7.41
22	600528	中铁工业	7,950,942.00	7.32
23	601666	平煤股份	7,903,251.63	7.28
24	600820	隧道股份	7,870,068.69	7.25
25	603605	珀莱雅	7,843,133.71	7.22
26	002078	太阳纸业	7,657,751.28	7.05
27	300003	乐普医疗	7,596,030.20	7.00
28	688099	晶晨股份	7,478,720.67	6.89
29	600546	山煤国际	7,454,062.00	6.86
30	300699	光威复材	7,451,801.20	6.86
31	002384	东山精密	7,433,301.00	6.85
32	600642	申能股份	7,425,573.56	6.84
33	688301	奕瑞科技	7,396,692.53	6.81
34	300682	朗新集团	7,396,044.00	6.81
35	600131	国网信通	7,380,084.99	6.80
36	002625	光启技术	7,378,863.26	6.80
37	000598	兴蓉环境	7,370,703.00	6.79
38	300832	新产业	7,274,578.00	6.70
39	600329	达仁堂	7,218,126.00	6.65
40	002250	联化科技	7,213,883.37	6.64
41	688390	固德威	7,152,007.94	6.59
42	300296	利亚德	7,146,550.00	6.58
43	688002	睿创微纳	7,090,275.54	6.53
44	000999	华润三九	7,088,495.00	6.53
45	600487	亨通光电	7,070,221.00	6.51
46	300604	长川科技	7,065,343.00	6.51
47	600985	淮北矿业	7,057,790.00	6.50
48	601139	深圳燃气	7,052,928.00	6.49
49	000513	丽珠集团	7,018,809.00	6.46
50	002128	电投能源	6,964,098.00	6.41
51	000807	云铝股份	6,958,742.31	6.41
52	002409	雅克科技	6,947,300.00	6.40
53	600066	宇通客车	6,909,423.00	6.36
54	600970	中材国际	6,880,770.00	6.34
55	603233	大参林	6,815,867.16	6.28
56	601108	财通证券	6,807,160.50	6.27
57	300724	捷佳伟创	6,760,484.05	6.23
58	601298	青岛港	6,748,771.00	6.21
59	300115	长盈精密	6,744,289.00	6.21
60	300390	天华新能	6,736,550.24	6.20
61	000739	普洛药业	6,719,881.00	6.19

62	300568	星源材质	6,711,748.00	6.18
63	002595	豪迈科技	6,640,971.00	6.12
64	000997	新大陆	6,623,487.46	6.10
65	300146	汤臣倍健	6,605,434.74	6.08
66	002690	美亚光电	6,577,318.50	6.06
67	600021	上海电力	6,566,899.00	6.05
68	601058	赛轮轮胎	6,552,668.00	6.03
69	603444	吉比特	6,516,107.00	6.00
70	600704	物产中大	6,511,731.00	6.00
71	600566	济川药业	6,486,088.00	5.97
72	002080	中材科技	6,480,875.00	5.97
73	300866	安克创新	6,373,436.00	5.87
74	300558	贝达药业	6,345,143.00	5.84
75	600195	中牧股份	6,336,928.29	5.84
76	600765	中航重机	6,333,700.00	5.83
77	688385	复旦微电	6,314,689.26	5.82
78	300373	扬杰科技	6,272,352.00	5.78
79	600160	巨化股份	6,251,447.00	5.76
80	300136	信维通信	6,234,820.00	5.74
81	600623	华谊集团	6,233,028.00	5.74
82	688063	派能科技	6,224,024.56	5.73
83	688779	长远锂科	6,194,538.87	5.70
84	002624	完美世界	6,168,199.19	5.68
85	603456	九洲药业	6,146,982.00	5.66
86	002372	伟星新材	6,123,856.00	5.64
87	600161	天坛生物	6,085,554.80	5.60
88	603737	三棵树	6,033,428.00	5.56
89	002081	金螳螂	6,003,986.00	5.53
90	603056	德邦股份	6,000,223.76	5.53
91	300037	新宙邦	5,995,138.40	5.52
92	603613	国联股份	5,981,411.00	5.51
93	300888	稳健医疗	5,974,704.60	5.50
94	601168	西部矿业	5,973,367.00	5.50
95	603379	三美股份	5,968,150.00	5.50
96	002340	格林美	5,959,814.00	5.49
97	002249	大洋电机	5,952,739.00	5.48
98	600885	宏发股份	5,939,606.00	5.47
99	002572	索菲亚	5,926,085.00	5.46
100	600673	东阳光	5,895,289.00	5.43
101	002925	盈趣科技	5,892,892.95	5.43
102	002385	大北农	5,891,173.00	5.43
103	600535	天士力	5,869,875.00	5.41
104	300088	长信科技	5,867,307.00	5.40

105	300070	碧水源	5,861,653.00	5.40
106	002056	横店东磁	5,832,613.00	5.37
107	300058	蓝色光标	5,808,697.00	5.35
108	000559	万向钱潮	5,793,975.35	5.34
109	603868	飞科电器	5,721,334.00	5.27
110	688777	中控技术	5,700,704.54	5.25
111	002508	老板电器	5,679,152.00	5.23
112	603026	胜华新材	5,605,940.53	5.16
113	002867	周大生	5,600,917.76	5.16
114	603688	石英股份	5,592,945.00	5.15
115	002273	水晶光电	5,574,982.97	5.13
116	601156	东航物流	5,554,511.00	5.12
117	688690	纳微科技	5,519,067.47	5.08
118	300009	安科生物	5,502,881.40	5.07
119	000401	冀东水泥	5,491,453.86	5.06
120	601179	中国西电	5,484,600.00	5.05
121	603127	昭衍新药	5,474,145.52	5.04
122	603160	汇顶科技	5,473,561.00	5.04
123	000988	华工科技	5,453,220.00	5.02
124	601869	长飞光纤	5,439,513.43	5.01
125	000021	深科技	5,432,738.00	5.00
126	600637	东方明珠	5,422,822.22	4.99
127	601997	贵阳银行	5,399,767.00	4.97
128	300285	国瓷材料	5,345,595.00	4.92
129	601717	郑煤机	5,343,100.00	4.92
130	002497	雅化集团	5,331,477.00	4.91
131	002266	浙富控股	5,314,685.12	4.89
132	002192	融捷股份	5,292,083.65	4.87
133	600511	国药股份	5,250,880.00	4.84
134	603927	中科软	5,235,409.37	4.82
135	600517	国网英大	5,233,325.00	4.82
136	600895	张江高科	5,229,028.50	4.82
137	600827	百联股份	5,205,591.00	4.79
138	601577	长沙银行	5,195,899.00	4.78
139	002531	天顺风能	5,190,258.00	4.78
140	000930	中粮科技	5,174,557.00	4.77
141	601555	东吴证券	5,150,064.53	4.74
142	600500	中化国际	5,142,050.00	4.74
143	002563	森马服饰	5,128,416.00	4.72
144	002850	科达利	5,113,513.00	4.71
145	603355	莱克电气	5,074,942.76	4.67
146	600155	华创云信	5,070,481.00	4.67
147	600498	烽火通信	5,067,214.44	4.67

148	600271	航天信息	5,065,700.00	4.66
149	300861	美畅股份	5,026,117.00	4.63
150	603156	养元饮品	5,018,820.00	4.62
151	603228	景旺电子	5,010,628.18	4.61
152	000729	燕京啤酒	4,976,112.00	4.58
153	603883	老百姓	4,971,160.24	4.58
154	601928	凤凰传媒	4,931,145.60	4.54
155	600699	均胜电子	4,917,272.00	4.53
156	601958	金钼股份	4,917,193.00	4.53
157	600755	厦门国贸	4,910,967.25	4.52
158	600380	健康元	4,900,058.00	4.51
159	002368	太极股份	4,868,420.40	4.48
160	603707	健友股份	4,861,417.00	4.48
161	002429	兆驰股份	4,858,418.63	4.47
162	600027	华电国际	4,833,303.00	4.45
163	002019	亿帆医药	4,809,370.00	4.43
164	600398	海澜之家	4,793,529.03	4.41
165	600060	海信视像	4,759,587.03	4.38
166	600482	中国动力	4,746,878.46	4.37
167	300257	开山股份	4,733,203.00	4.36
168	000878	云南铜业	4,731,931.14	4.36
169	603345	安井食品	4,725,969.00	4.35
170	002028	思源电气	4,719,031.72	4.35
171	600486	扬农化工	4,715,523.30	4.34
172	600859	王府井	4,692,458.00	4.32
173	000402	金融街	4,691,678.00	4.32
174	601699	潞安环能	4,674,154.00	4.30
175	000400	许继电气	4,669,555.95	4.30
176	000783	长江证券	4,664,922.00	4.30
177	300630	普利制药	4,662,496.00	4.29
178	600299	安迪苏	4,651,250.00	4.28
179	000933	神火股份	4,646,920.85	4.28
180	600867	通化东宝	4,644,860.00	4.28
181	000975	银泰黄金	4,600,137.80	4.24
182	601665	齐鲁银行	4,588,221.00	4.23
183	002673	西部证券	4,570,260.50	4.21
184	600348	华阳股份	4,559,809.50	4.20
185	601158	重庆水务	4,543,891.00	4.18
186	000785	居然之家	4,537,498.93	4.18
187	603267	鸿远电子	4,467,816.00	4.11
188	002030	达安基因	4,461,312.00	4.11
189	000932	华菱钢铁	4,457,307.27	4.10
190	000738	航发控制	4,436,323.90	4.09

191	600282	南钢股份	4,408,026.00	4.06
192	688819	天能股份	4,388,067.13	4.04
193	600718	东软集团	4,386,346.13	4.04
194	000553	安道麦 A	4,367,128.00	4.02
195	000050	深天马 A	4,341,418.00	4.00
196	603786	科博达	4,341,108.75	4.00
197	688772	珠海冠宇	4,315,125.90	3.97
198	600377	宁沪高速	4,313,900.00	3.97
199	688029	南微医学	4,292,360.22	3.95
200	000581	威孚高科	4,229,832.97	3.90
201	600862	中航高科	4,227,673.11	3.89
202	601598	中国外运	4,217,626.00	3.88
203	002465	海格通信	4,208,230.00	3.88
204	600298	安琪酵母	4,196,326.00	3.86
205	688116	天奈科技	4,193,558.65	3.86
206	300251	光线传媒	4,174,137.00	3.84
207	600177	雅戈尔	4,153,757.48	3.83
208	002966	苏州银行	4,124,560.50	3.80
209	600064	南京高科	4,117,661.32	3.79
210	002683	广东宏大	4,112,444.72	3.79
211	001872	招商港口	4,107,913.99	3.78
212	603225	新凤鸣	4,100,961.82	3.78
213	688107	安路科技	4,096,816.69	3.77
214	000623	吉林敖东	4,091,448.70	3.77
215	600143	金发科技	4,088,812.00	3.77
216	601198	东兴证券	4,063,513.00	3.74
217	600378	昊华科技	4,059,008.00	3.74
218	603816	顾家家居	4,052,469.74	3.73
219	600663	陆家嘴	4,047,177.68	3.73
220	600582	天地科技	4,041,395.41	3.72
221	002281	光迅科技	4,010,755.00	3.69
222	600563	法拉电子	4,007,540.00	3.69
223	300144	宋城演艺	3,982,068.85	3.67
224	600909	华安证券	3,980,442.00	3.67
225	600415	小商品城	3,974,728.00	3.66
226	002244	滨江集团	3,966,351.00	3.65
227	600499	科达制造	3,965,275.03	3.65
228	600392	盛和资源	3,953,932.79	3.64
229	601828	美凯龙	3,953,842.12	3.64
230	301029	怡合达	3,953,485.39	3.64
231	002138	顺络电子	3,916,776.90	3.61
232	002568	百润股份	3,897,739.40	3.59
233	000959	首钢股份	3,876,942.26	3.57

234	300357	我武生物	3,848,012.50	3.54
235	600153	建发股份	3,847,964.00	3.54
236	002653	海思科	3,845,399.00	3.54
237	603589	口子窖	3,840,416.00	3.54
238	601607	上海医药	3,840,375.87	3.54
239	000987	越秀资本	3,813,678.75	3.51
240	603893	瑞芯微	3,802,785.00	3.50
241	601611	中国核建	3,797,972.00	3.50
242	688188	柏楚电子	3,772,842.12	3.47
243	601568	北元集团	3,771,325.30	3.47
244	002110	三钢闽光	3,769,057.98	3.47
245	603939	益丰药房	3,757,358.20	3.46
246	601231	环旭电子	3,749,824.00	3.45
247	002396	星网锐捷	3,747,669.00	3.45
248	603712	七一二	3,734,866.16	3.44
249	002242	九阳股份	3,717,083.00	3.42
250	600848	上海临港	3,690,912.40	3.40
251	688006	杭可科技	3,674,379.71	3.38
252	002048	宁波华翔	3,667,986.00	3.38
253	600109	国金证券	3,637,482.49	3.35
254	600655	豫园股份	3,626,924.00	3.34
255	300012	华测检测	3,620,805.00	3.33
256	002929	润建股份	3,612,790.00	3.33
257	603568	伟明环保	3,565,785.80	3.28
258	600126	杭钢股份	3,538,662.00	3.26
259	000967	盈峰环境	3,525,779.00	3.25
260	300363	博腾股份	3,518,409.00	3.24
261	600529	山东药玻	3,513,532.00	3.24
262	000778	新兴铸管	3,513,147.00	3.24
263	600258	首旅酒店	3,506,124.00	3.23
264	600707	彩虹股份	3,493,062.00	3.22
265	600549	厦门钨业	3,476,565.00	3.20
266	688200	华峰测控	3,441,947.83	3.17
267	601990	南京证券	3,434,853.00	3.16
268	000027	深圳能源	3,422,970.00	3.15
269	300024	机器人	3,402,334.13	3.13
270	600516	方大炭素	3,401,127.00	3.13
271	002468	申通快递	3,397,753.48	3.13
272	000060	中金岭南	3,396,527.00	3.13
273	601187	厦门银行	3,391,171.22	3.12
274	603858	步长制药	3,390,499.90	3.12
275	600399	抚顺特钢	3,389,821.00	3.12
276	001914	招商积余	3,385,134.00	3.12

277	002926	华西证券	3,361,835.00	3.10
278	300358	楚天科技	3,356,151.00	3.09
279	600739	辽宁成大	3,351,840.00	3.09
280	600167	联美控股	3,345,947.00	3.08
281	002831	裕同科技	3,329,835.94	3.07
282	000591	太阳能	3,311,262.00	3.05
283	002203	海亮股份	3,305,580.00	3.04
284	688072	拓荆科技	3,295,430.01	3.03
285	000031	大悦城	3,294,686.00	3.03
286	600118	中国卫星	3,263,994.00	3.01
287	002223	鱼跃医疗	3,263,100.00	3.00
288	688536	思瑞浦	3,262,244.15	3.00
289	603000	人民网	3,258,674.00	3.00
290	600325	华发股份	3,241,528.00	2.99
291	002399	海普瑞	3,236,131.00	2.98
292	000089	深圳机场	3,218,931.36	2.96
293	002705	新宝股份	3,217,658.00	2.96
294	600026	中远海能	3,207,411.00	2.95
295	002299	圣农发展	3,205,263.00	2.95
296	300244	迪安诊断	3,203,840.00	2.95
297	002500	山西证券	3,203,658.00	2.95
298	600390	五矿资本	3,202,770.00	2.95
299	000970	中科三环	3,202,498.50	2.95
300	000009	中国宝安	3,198,842.00	2.95
301	000937	冀中能源	3,191,420.00	2.94
302	600580	卧龙电驱	3,191,143.00	2.94
303	000887	中鼎股份	3,184,447.69	2.93
304	600259	广晟有色	3,178,846.00	2.93
305	603648	畅联股份	3,178,510.00	2.93
306	688586	江航装备	3,162,615.82	2.91
307	300850	新强联	3,157,774.00	2.91
308	002398	垒知集团	3,157,259.12	2.91
309	688521	芯原股份	3,143,915.06	2.90
310	600418	江淮汽车	3,108,650.84	2.86
311	688234	天岳先进	3,104,561.89	2.86
312	300073	当升科技	3,094,008.00	2.85
313	002797	第一创业	3,092,083.09	2.85
314	002790	瑞尔特	3,089,853.00	2.85
315	600956	新天绿能	3,084,729.00	2.84
316	600350	山东高速	3,072,359.00	2.83
317	000030	富奥股份	3,067,186.45	2.82
318	300618	寒锐钴业	3,042,809.00	2.80
319	300001	特锐德	3,040,547.00	2.80

320	688220	翱捷科技	3,033,868.89	2.79
321	002153	石基信息	3,033,808.80	2.79
322	002739	万达电影	3,019,833.00	2.78
323	600352	浙江龙盛	3,011,164.00	2.77
324	601118	海南橡胶	3,010,034.00	2.77
325	300676	华大基因	2,998,672.00	2.76
326	601000	唐山港	2,985,928.00	2.75
327	002557	洽洽食品	2,959,277.00	2.73
328	002444	巨星科技	2,955,897.00	2.72
329	601991	大唐发电	2,932,637.00	2.70
330	000636	风华高科	2,902,863.71	2.67
331	600927	永安期货	2,897,946.95	2.67
332	300017	网宿科技	2,879,389.00	2.65
333	601636	旗滨集团	2,852,868.00	2.63
334	002745	木林森	2,841,231.00	2.62
335	600409	三友化工	2,822,273.92	2.60
336	600008	首创环保	2,817,944.00	2.60
337	603338	浙江鼎力	2,809,638.00	2.59
338	688208	道通科技	2,804,100.83	2.58
339	601908	京运通	2,803,741.00	2.58
340	000039	中集集团	2,781,637.00	2.56
341	000883	湖北能源	2,757,398.00	2.54
342	002901	大博医疗	2,728,582.76	2.51
343	002608	江苏国信	2,713,993.00	2.50
344	603650	彤程新材	2,710,904.86	2.50
345	688256	寒武纪	2,710,772.44	2.50
346	300447	全信股份	2,701,201.00	2.49
347	000728	国元证券	2,681,654.00	2.47
348	600210	紫江企业	2,675,977.00	2.46
349	300776	帝尔激光	2,656,949.00	2.45
350	600801	华新水泥	2,653,167.00	2.44
351	603977	国泰集团	2,645,270.32	2.44
352	603596	伯特利	2,640,848.00	2.43
353	688516	奥特维	2,628,293.18	2.42
354	002600	领益智造	2,619,541.00	2.41
355	000893	亚钾国际	2,612,618.00	2.41
356	601077	渝农商行	2,602,707.00	2.40
357	688052	纳芯微	2,602,459.24	2.40
358	688289	圣湘生物	2,572,697.91	2.37
359	601128	常熟银行	2,571,779.00	2.37
360	002065	东华软件	2,571,466.00	2.37
361	601456	国联证券	2,561,178.00	2.36
362	600096	云天化	2,548,801.00	2.35

363	600737	中粮糖业	2,542,222.00	2.34
364	603866	桃李面包	2,534,314.42	2.33
365	600536	中国软件	2,526,992.70	2.33
366	002423	中粮资本	2,519,219.00	2.32
367	002407	多氟多	2,518,898.60	2.32
368	688276	百克生物	2,502,250.42	2.30
369	605358	立昂微	2,498,053.00	2.30
370	600435	北方导航	2,496,451.00	2.30
371	000415	渤海租赁	2,483,264.00	2.29
372	603317	天味食品	2,478,146.65	2.28
373	002155	湖南黄金	2,474,462.00	2.28
374	002408	齐翔腾达	2,460,533.00	2.27
375	601608	中信重工	2,438,298.00	2.25
376	300376	易事特	2,416,981.00	2.23
377	002507	涪陵榨菜	2,413,501.00	2.22
378	688281	华秦科技	2,411,094.98	2.22
379	600863	内蒙华电	2,383,494.00	2.19
380	601696	中银证券	2,383,384.00	2.19
381	002701	奥瑞金	2,370,228.00	2.18
382	600376	首开股份	2,342,933.90	2.16
383	000703	恒逸石化	2,338,691.50	2.15
384	002268	电科网安	2,335,172.00	2.15
385	603339	四方科技	2,333,835.00	2.15
386	688520	神州细胞	2,315,185.89	2.13
387	688567	孚能科技	2,310,877.32	2.13
388	000563	陕国投 A	2,299,919.00	2.12
389	600667	太极实业	2,293,040.00	2.11
390	002985	北摩高科	2,276,956.00	2.10
391	300463	迈克生物	2,246,105.00	2.07
392	600521	华海药业	2,233,864.00	2.06
393	001696	宗申动力	2,226,776.00	2.05
394	300741	华宝股份	2,214,201.10	2.04
395	688538	和辉光电	2,193,125.55	2.02
396	601969	海南矿业	2,192,079.00	2.02
397	600507	方大特钢	2,177,630.00	2.01
398	000825	太钢不锈	2,175,851.00	2.00
399	300438	鹏辉能源	2,174,499.00	2.00

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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300308	中际旭创	11,930,526.95	10.99
2	002422	科伦药业	10,727,656.00	9.88
3	600373	中文传媒	10,384,290.00	9.56
4	600489	中金黄金	10,122,011.00	9.32
5	600901	江苏金租	10,040,405.55	9.25
6	002738	中矿资源	10,015,489.20	9.22
7	002353	杰瑞股份	9,855,451.85	9.08
8	600879	航天电子	9,825,912.00	9.05
9	603658	安图生物	9,310,123.76	8.57
10	002430	杭氧股份	9,155,112.00	8.43
11	688009	中国通号	9,035,046.19	8.32
12	601872	招商轮船	9,020,112.24	8.31
13	002384	东山精密	8,912,981.67	8.21
14	688122	西部超导	8,828,342.73	8.13
15	600820	隧道股份	8,714,310.41	8.02
16	002152	广电运通	8,681,402.00	7.99
17	600873	梅花生物	8,643,895.91	7.96
18	688390	固德威	8,609,925.55	7.93
19	600998	九州通	8,587,386.97	7.91
20	002409	雅克科技	8,488,349.00	7.82
21	000997	新大陆	8,389,870.00	7.73
22	300724	捷佳伟创	8,385,771.25	7.72
23	601666	平煤股份	8,291,825.00	7.64
24	600528	中铁工业	8,260,316.00	7.61
25	601098	中南传媒	8,231,934.92	7.58
26	601058	赛轮轮胎	8,093,194.00	7.45
27	002025	航天电器	8,083,403.00	7.44
28	600967	内蒙一机	8,080,881.00	7.44
29	600079	人福医药	8,054,516.00	7.42
30	600546	山煤国际	8,039,086.00	7.40
31	300390	天华新能	7,849,126.00	7.23
32	002294	信立泰	7,796,554.18	7.18
33	601298	青岛港	7,789,446.00	7.17
34	300146	汤臣倍健	7,755,907.48	7.14
35	600160	巨化股份	7,722,548.00	7.11
36	600985	淮北矿业	7,668,049.00	7.06
37	688385	复旦微电	7,645,560.53	7.04
38	603444	吉比特	7,641,548.11	7.04
39	300373	扬杰科技	7,635,629.30	7.03
40	600131	国网信通	7,606,174.00	7.00
41	603605	珀莱雅	7,592,855.60	6.99
42	300568	星源材质	7,574,566.80	6.98

43	300115	长盈精密	7,553,135.43	6.96
44	600329	达仁堂	7,471,574.80	6.88
45	300682	朗新集团	7,468,049.06	6.88
46	000999	华润三九	7,456,744.10	6.87
47	002128	电投能源	7,430,712.00	6.84
48	300832	新产业	7,422,499.61	6.84
49	300003	乐普医疗	7,421,079.00	6.83
50	002625	光启技术	7,361,127.00	6.78
51	601108	财通证券	7,327,298.57	6.75
52	688099	晶晨股份	7,305,800.22	6.73
53	002273	水晶光电	7,287,523.39	6.71
54	600765	中航重机	7,256,786.92	6.68
55	688002	睿创微纳	7,256,230.03	6.68
56	002078	太阳纸业	7,243,948.86	6.67
57	688301	奕瑞科技	7,187,677.58	6.62
58	600970	中材国际	7,157,102.00	6.59
59	000598	兴蓉环境	7,084,985.00	6.52
60	688063	派能科技	7,059,697.68	6.50
61	002250	联化科技	7,044,376.00	6.49
62	600642	申能股份	7,015,753.00	6.46
63	600487	亨通光电	6,998,490.00	6.44
64	601139	深圳燃气	6,952,873.00	6.40
65	300296	利亚德	6,947,827.00	6.40
66	600066	宇通客车	6,928,843.00	6.38
67	002056	横店东磁	6,923,251.88	6.38
68	000513	丽珠集团	6,910,932.91	6.36
69	300604	长川科技	6,897,240.00	6.35
70	000807	云铝股份	6,841,605.45	6.30
71	300136	信维通信	6,794,146.39	6.26
72	300699	光威复材	6,701,171.60	6.17
73	600195	中牧股份	6,686,190.10	6.16
74	600566	济川药业	6,607,277.00	6.08
75	600704	物产中大	6,602,203.00	6.08
76	601577	长沙银行	6,588,147.88	6.07
77	002497	雅化集团	6,536,127.05	6.02
78	002595	豪迈科技	6,524,802.66	6.01
79	000739	普洛药业	6,505,596.00	5.99
80	002690	美亚光电	6,494,687.71	5.98
81	603456	九洲药业	6,413,143.00	5.91
82	600895	张江高科	6,410,835.00	5.90
83	002080	中材科技	6,392,288.00	5.89
84	600021	上海电力	6,372,757.00	5.87
85	300558	贝达药业	6,369,896.60	5.87

86	603233	大参林	6,358,681.55	5.86
87	300866	安克创新	6,322,645.99	5.82
88	603379	三美股份	6,304,104.92	5.81
89	002624	完美世界	6,294,182.29	5.80
90	002372	伟星新材	6,288,559.54	5.79
91	603127	昭衍新药	6,254,556.88	5.76
92	600623	华谊集团	6,252,526.00	5.76
93	000878	云南铜业	6,244,648.77	5.75
94	601869	长飞光纤	6,198,478.78	5.71
95	600161	天坛生物	6,171,333.85	5.68
96	300037	新宙邦	6,169,616.43	5.68
97	603927	中科软	6,168,121.00	5.68
98	601699	潞安环能	6,155,964.00	5.67
99	300070	碧水源	6,102,316.38	5.62
100	002249	大洋电机	6,099,213.00	5.62
101	002925	盈趣科技	6,094,435.50	5.61
102	300088	长信科技	6,070,783.00	5.59
103	300861	美畅股份	6,051,856.14	5.57
104	600060	海信视像	6,046,065.00	5.57
105	000988	华工科技	6,016,868.40	5.54
106	002081	金螳螂	5,957,033.42	5.49
107	600535	天士力	5,891,146.40	5.43
108	002340	格林美	5,867,615.00	5.40
109	002572	索菲亚	5,865,285.98	5.40
110	603160	汇顶科技	5,855,193.40	5.39
111	688819	天能股份	5,803,710.86	5.34
112	600673	东阳光	5,800,030.00	5.34
113	603737	三棵树	5,739,324.00	5.29
114	300058	蓝色光标	5,735,646.15	5.28
115	601168	西部矿业	5,690,308.00	5.24
116	002465	海格通信	5,682,926.00	5.23
117	300888	稳健医疗	5,673,694.80	5.22
118	002508	老板电器	5,652,599.60	5.21
119	603613	国联股份	5,651,272.00	5.20
120	002281	光迅科技	5,648,882.00	5.20
121	601156	东航物流	5,601,119.00	5.16
122	600885	宏发股份	5,565,542.80	5.13
123	601717	郑煤机	5,549,519.00	5.11
124	000559	万向钱潮	5,546,742.00	5.11
125	000021	深科技	5,542,460.67	5.10
126	002867	周大生	5,542,411.34	5.10
127	600637	东方明珠	5,523,959.78	5.09
128	600862	中航高科	5,522,174.00	5.09

129	603688	石英股份	5,512,518.00	5.08
130	601997	贵阳银行	5,503,711.00	5.07
131	688777	中控技术	5,496,573.30	5.06
132	600499	科达制造	5,469,753.00	5.04
133	300009	安科生物	5,445,836.40	5.02
134	603868	飞科电器	5,424,977.00	5.00
135	600377	宁沪高速	5,404,357.00	4.98
136	603026	胜华新材	5,374,707.10	4.95
137	688779	长远锂科	5,359,606.87	4.94
138	603056	德邦股份	5,343,924.78	4.92
139	002385	大北农	5,342,874.00	4.92
140	600143	金发科技	5,308,820.00	4.89
141	603228	景旺电子	5,296,876.00	4.88
142	000401	冀东水泥	5,288,527.80	4.87
143	600511	国药股份	5,287,896.00	4.87
144	600827	百联股份	5,267,527.00	4.85
145	300285	国瓷材料	5,266,858.00	4.85
146	002266	浙富控股	5,257,564.70	4.84
147	600271	航天信息	5,193,341.82	4.78
148	601179	中国西电	5,192,494.00	4.78
149	600298	安琪酵母	5,180,436.00	4.77
150	688690	纳微科技	5,144,826.97	4.74
151	002850	科达利	5,121,700.92	4.72
152	002048	宁波华翔	5,111,468.00	4.71
153	603355	莱克电气	5,097,362.60	4.69
154	600498	烽火通信	5,040,931.00	4.64
155	603707	健友股份	5,033,457.61	4.64
156	002563	森马服饰	5,014,115.00	4.62
157	601231	环旭电子	4,991,825.00	4.60
158	600699	均胜电子	4,983,868.00	4.59
159	600380	健康元	4,979,714.64	4.59
160	002429	兆驰股份	4,979,637.11	4.59
161	603156	养元饮品	4,944,872.40	4.55
162	600155	华创云信	4,914,714.00	4.53
163	600517	国网英大	4,905,187.00	4.52
164	002531	天顺风能	4,871,706.00	4.49
165	601928	凤凰传媒	4,831,543.00	4.45
166	002019	亿帆医药	4,818,914.00	4.44
167	603883	老百姓	4,787,178.80	4.41
168	300357	我武生物	4,782,887.00	4.40
169	600482	中国动力	4,763,276.00	4.39
170	000729	燕京啤酒	4,759,041.00	4.38
171	300257	开山股份	4,728,067.00	4.35

172	000975	银泰黄金	4,715,469.00	4.34
173	601555	东吴证券	4,711,016.00	4.34
174	000930	中粮科技	4,704,695.00	4.33
175	600398	海澜之家	4,702,826.00	4.33
176	600299	安迪苏	4,694,088.83	4.32
177	603345	安井食品	4,670,250.00	4.30
178	000933	神火股份	4,667,740.00	4.30
179	002368	太极股份	4,649,935.00	4.28
180	000400	许继电气	4,625,512.93	4.26
181	600027	华电国际	4,623,437.00	4.26
182	600500	中化国际	4,621,664.00	4.26
183	002192	融捷股份	4,606,947.00	4.24
184	300630	普利制药	4,577,327.00	4.22
185	603267	鸿远电子	4,570,304.66	4.21
186	002203	海亮股份	4,567,518.00	4.21
187	600486	扬农化工	4,511,068.00	4.15
188	603786	科博达	4,477,846.00	4.12
189	601958	金钼股份	4,449,165.00	4.10
190	000581	威孚高科	4,440,083.88	4.09
191	600755	厦门国贸	4,415,801.00	4.07
192	000738	航发控制	4,415,223.00	4.07
193	600109	国金证券	4,413,055.61	4.06
194	002673	西部证券	4,403,450.52	4.06
195	600718	东软集团	4,384,695.47	4.04
196	002028	思源电气	4,374,788.00	4.03
197	000050	深天马 A	4,355,218.00	4.01
198	600859	王府井	4,348,879.11	4.00
199	002030	达安基因	4,347,414.20	4.00
200	000402	金融街	4,322,295.00	3.98
201	002705	新宝股份	4,316,646.00	3.98
202	002444	巨星科技	4,299,574.00	3.96
203	600064	南京高科	4,292,291.00	3.95
204	600867	通化东宝	4,288,702.00	3.95
205	688029	南微医学	4,261,340.84	3.92
206	688772	珠海冠宇	4,243,689.65	3.91
207	688107	安路科技	4,219,961.31	3.89
208	601665	齐鲁银行	4,208,951.00	3.88
209	601158	重庆水务	4,178,896.00	3.85
210	600282	南钢股份	4,124,079.00	3.80
211	002557	洽洽食品	4,115,497.00	3.79
212	002138	顺络电子	4,111,216.12	3.79
213	000783	长江证券	4,086,673.00	3.76
214	002244	滨江集团	4,065,226.00	3.74

215	601607	上海医药	4,061,228.00	3.74
216	300073	当升科技	4,057,184.99	3.74
217	000553	安道麦 A	4,038,506.00	3.72
218	000623	吉林敖东	4,034,018.88	3.71
219	600529	山东药玻	4,019,617.00	3.70
220	000932	华菱钢铁	4,012,461.00	3.70
221	000785	居然之家	3,998,410.00	3.68
222	688116	天奈科技	3,982,218.45	3.67
223	001872	招商港口	3,980,843.00	3.67
224	600549	厦门钨业	3,974,621.00	3.66
225	603589	口子窖	3,968,953.00	3.65
226	603225	新凤鸣	3,963,116.00	3.65
227	600415	小商品城	3,952,424.00	3.64
228	600378	昊华科技	3,936,064.00	3.62
229	603893	瑞芯微	3,926,867.68	3.62
230	300017	网宿科技	3,918,070.97	3.61
231	601198	东兴证券	3,915,729.00	3.61
232	600582	天地科技	3,911,048.00	3.60
233	688006	杭可科技	3,907,799.36	3.60
234	601598	中国外运	3,906,467.00	3.60
235	600392	盛和资源	3,901,539.00	3.59
236	600153	建发股份	3,900,337.17	3.59
237	300144	宋城演艺	3,881,303.98	3.57
238	300251	光线传媒	3,880,888.00	3.57
239	600663	陆家嘴	3,880,151.00	3.57
240	600210	紫江企业	3,858,313.00	3.55
241	601568	北元集团	3,834,130.30	3.53
242	600348	华阳股份	3,827,609.50	3.52
243	600177	雅戈尔	3,823,836.60	3.52
244	002110	三钢闽光	3,809,894.00	3.51
245	603816	顾家家居	3,796,757.00	3.50
246	601908	京运通	3,732,304.00	3.44
247	600848	上海临港	3,727,422.77	3.43
248	002985	北摩高科	3,715,366.50	3.42
249	000987	越秀资本	3,686,745.00	3.40
250	600909	华安证券	3,685,613.00	3.39
251	002966	苏州银行	3,683,533.10	3.39
252	002396	星网锐捷	3,668,407.00	3.38
253	002929	润建股份	3,657,123.00	3.37
254	688188	柏楚电子	3,653,489.68	3.36
255	601828	美凯龙	3,648,996.50	3.36
256	000959	首钢股份	3,644,904.00	3.36
257	600563	法拉电子	3,636,356.00	3.35

258	002653	海思科	3,610,813.00	3.33
259	603939	益丰药房	3,607,525.60	3.32
260	002683	广东宏大	3,607,038.28	3.32
261	300024	机器人	3,581,983.00	3.30
262	000970	中科三环	3,576,326.35	3.29
263	301029	怡合达	3,561,398.40	3.28
264	601611	中国核建	3,550,461.00	3.27
265	600655	豫园股份	3,550,348.00	3.27
266	600707	彩虹股份	3,520,774.00	3.24
267	600126	杭钢股份	3,501,874.00	3.22
268	000778	新兴铸管	3,488,050.54	3.21
269	603712	七一二	3,484,623.00	3.21
270	603568	伟明环保	3,473,294.80	3.20
271	002568	百润股份	3,463,524.00	3.19
272	002242	九阳股份	3,446,580.00	3.17
273	600516	方大炭素	3,423,264.00	3.15
274	000027	深圳能源	3,412,891.00	3.14
275	600580	卧龙电驱	3,389,336.00	3.12
276	002223	鱼跃医疗	3,373,939.07	3.11
277	600118	中国卫星	3,371,491.96	3.10
278	603858	步长制药	3,370,229.00	3.10
279	601990	南京证券	3,360,391.00	3.09
280	603977	国泰集团	3,333,114.84	3.07
281	002831	裕同科技	3,332,771.00	3.07
282	300012	华测检测	3,319,192.08	3.06
283	300363	博腾股份	3,316,804.00	3.05
284	000591	太阳能	3,309,244.00	3.05
285	001914	招商积余	3,304,258.64	3.04
286	002468	申通快递	3,301,281.00	3.04
287	002507	涪陵榨菜	3,298,658.56	3.04
288	002926	华西证券	3,289,562.72	3.03
289	600258	首旅酒店	3,276,506.57	3.02
290	300358	楚天科技	3,272,421.00	3.01
291	600026	中远海能	3,234,313.00	2.98
292	002500	山西证券	3,211,192.90	2.96
293	688200	华峰测控	3,209,385.06	2.96
294	688072	拓荆科技	3,204,729.37	2.95
295	300244	迪安诊断	3,203,458.00	2.95
296	000967	盈峰环境	3,189,777.28	2.94
297	002398	垒知集团	3,183,430.00	2.93
298	000009	中国宝安	3,178,435.00	2.93
299	603648	畅联股份	3,176,549.00	2.93
300	600418	江淮汽车	3,164,072.00	2.91

301	600399	抚顺特钢	3,147,827.00	2.90
302	300001	特锐德	3,145,509.00	2.90
303	000937	冀中能源	3,144,124.00	2.90
304	688586	江航装备	3,140,710.03	2.89
305	600259	广晟有色	3,129,671.00	2.88
306	600325	华发股份	3,079,428.00	2.84
307	000030	富奥股份	3,077,233.17	2.83
308	002299	圣农发展	3,071,951.25	2.83
309	000012	南玻 A	3,065,281.91	2.82
310	300618	寒锐钴业	3,043,070.00	2.80
311	300741	华宝股份	3,042,346.00	2.80
312	300850	新强联	3,037,213.30	2.80
313	000887	中鼎股份	3,031,915.00	2.79
314	000031	大悦城	3,023,997.00	2.78
315	002739	万达电影	3,023,861.50	2.78
316	600739	辽宁成大	3,005,900.00	2.77
317	601187	厦门银行	3,004,537.00	2.77
318	000089	深圳机场	3,002,059.00	2.76
319	600390	五矿资本	2,980,550.00	2.74
320	002790	瑞尔特	2,978,325.00	2.74
321	000636	风华高科	2,974,874.00	2.74
322	600956	新天绿能	2,967,268.00	2.73
323	002399	海普瑞	2,965,493.00	2.73
324	600167	联美控股	2,954,014.00	2.72
325	600927	永安期货	2,944,765.00	2.71
326	601118	海南橡胶	2,939,062.00	2.71
327	002797	第一创业	2,932,817.36	2.70
328	000060	中金岭南	2,931,318.00	2.70
329	688220	翱捷科技	2,922,460.25	2.69
330	300676	华大基因	2,882,695.00	2.65
331	002745	木林森	2,862,043.00	2.64
332	688234	天岳先进	2,860,044.48	2.63
333	688536	思瑞浦	2,854,556.46	2.63
334	601128	常熟银行	2,839,520.00	2.61
335	600350	山东高速	2,837,554.80	2.61
336	603000	人民网	2,832,496.00	2.61
337	300447	全信股份	2,830,498.00	2.61
338	002901	大博医疗	2,825,275.00	2.60
339	603338	浙江鼎力	2,810,503.44	2.59
340	603596	伯特利	2,800,976.40	2.58
341	688256	寒武纪	2,800,631.61	2.58
342	000883	湖北能源	2,760,392.00	2.54
343	002600	领益智造	2,752,863.00	2.54

344	600352	浙江龙盛	2,752,473.00	2.53
345	000039	中集集团	2,751,571.00	2.53
346	688208	道通科技	2,748,284.88	2.53
347	600409	三友化工	2,748,247.00	2.53
348	601991	大唐发电	2,721,956.00	2.51
349	601000	唐山港	2,667,306.93	2.46
350	601456	国联证券	2,663,759.00	2.45
351	603650	彤程新材	2,661,469.76	2.45
352	000415	渤海租赁	2,659,507.00	2.45
353	601636	旗滨集团	2,655,082.00	2.45
354	600096	云天化	2,642,073.00	2.43
355	688521	芯原股份	2,594,463.70	2.39
356	688289	圣湘生物	2,586,830.09	2.38
357	600737	中粮糖业	2,584,802.00	2.38
358	688516	奥特维	2,540,370.68	2.34
359	600801	华新水泥	2,536,395.00	2.34
360	600667	太极实业	2,522,200.00	2.32
361	600435	北方导航	2,521,786.00	2.32
362	600536	中国软件	2,516,754.50	2.32
363	300376	易事特	2,511,335.00	2.31
364	300776	帝尔激光	2,494,761.40	2.30
365	002153	石基信息	2,486,880.80	2.29
366	688276	百克生物	2,484,615.64	2.29
367	601696	中银证券	2,476,549.00	2.28
368	002065	东华软件	2,470,033.64	2.27
369	002407	多氟多	2,463,377.40	2.27
370	000728	国元证券	2,452,735.88	2.26
371	001696	宗申动力	2,451,794.60	2.26
372	603339	四方科技	2,447,766.00	2.25
373	002423	中粮资本	2,429,890.00	2.24
374	600008	首创环保	2,429,410.00	2.24
375	002408	齐翔腾达	2,399,090.00	2.21
376	688052	纳芯微	2,383,061.09	2.19
377	605358	立昂微	2,370,661.53	2.18
378	002608	江苏国信	2,368,898.00	2.18
379	300595	欧普康视	2,358,855.82	2.17
380	000893	亚钾国际	2,345,217.83	2.16
381	000703	恒逸石化	2,342,333.70	2.16
382	688567	孚能科技	2,336,062.59	2.15
383	603317	天味食品	2,333,278.52	2.15
384	603866	桃李面包	2,327,054.35	2.14
385	688281	华秦科技	2,307,009.82	2.12
386	002268	电科网安	2,297,870.00	2.12

387	000066	中国长城	2,293,975.00	2.11
388	002155	湖南黄金	2,276,552.00	2.10
389	002701	奥瑞金	2,246,157.00	2.07
390	300182	捷成股份	2,240,290.11	2.06
391	600376	首开股份	2,219,829.00	2.04
392	000563	陕国投 A	2,216,164.00	2.04
393	600906	财达证券	2,213,214.00	2.04
394	601077	渝农商行	2,202,516.00	2.03
395	600728	佳都科技	2,188,360.00	2.02
396	688538	和辉光电	2,178,083.31	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

买入股票成本（成交）总额	2,312,376,406.57
卖出股票收入（成交）总额	2,347,052,461.58

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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投资。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场

和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

## 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 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

2023 年 8 月 8 日，贵阳银行因关联交易管理不到位、贷款管理不规范、理财业务管理不规范，被国家金融监督管理总局贵州监管局（贵金罚决字（2023）5 号）给予罚款一百万元的行政处罚。

本基金投资上述证券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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,625.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,625.70

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
华安中证 500 指数增强 A	670	34,754.16	0.00	0.00	23,285,283.87	100.00
华安中证 500 指数增强 C	7,436	5,680.39	0.00	0.00	42,239,373.55	100.00
合计	8,106	8,083.48	0.00	0.00	65,524,657.42	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安中证 500 指数增强 A	601,198.26	2.58
	华安中证 500 指数增强 C	10.01	0.00
	合计	601,208.27	0.92

### 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情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安中证 500 指数增强 A	华安中证 500 指数增强 C
----	-----------------	-----------------

基金合同生效日 (2022 年 5 月 24 日) 基金份额总额	133, 507, 750. 06	176, 250, 841. 84
本报告期期初基金 份额总额	34, 529, 467. 81	80, 167, 147. 29
本报告期基金总申 购份额	103, 500, 227. 23	125, 199, 578. 78
减: 本报告期基金 总赎回份额	114, 744, 411. 17	163, 127, 352. 52
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	23, 285, 283. 87	42, 239, 373. 55

## § 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：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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 60, 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
广发证券	2	4,659,428,868.15	100.00	1,450,639.78	100.00	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

(1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，交易能力较强，近三年无重大违法违规行为，在业内有良好的声誉；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；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进

行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	1,271,117.80	100.00	-	-	-	-

### 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	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 20 日
2	华安中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 3 日
3	华安中证 500 指数增强型证券投资基金（华安中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 3 日
4	华安中证 500 指数增强型证券投资基金（华安中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 3 日
5	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 30 日
6	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 21 日
7	华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
8	华安中证 500 指数增强型证券投资	中国证监会基金电子披	2023 年 7 月 10 日

	基金（华安中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	露网站及基金管理人网站	
9	华安中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 10 日
10	华安中证 500 指数增强型证券投资基金（华安中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 10 日
11	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
12	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 22 日
13	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 30 日
14	关于终止南京途牛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及基金管理人网站	2023 年 8 月 31 日
15	关于终止凤凰金信（海口）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及基金管理人网站	2023 年 9 月 1 日
16	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 24 日
17	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 10 日
18	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及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日
19	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及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日

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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20230116~20230806	0.00	102,115,375.94	102,115,375.94	0.00	0.00
	2	20230113~20231015	0.00	51,186,527.44	51,186,527.44	0.00	0.00
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。							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 3 月 27 日