

# 华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2025 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2024 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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
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	14
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	14
<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>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51

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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	95
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 .....	95
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 .....	95
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 .....	95
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 .....	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	96
8.12 投资组合报告附注 .....	96
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>97</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	97
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 .....	98
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>98</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>98</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	98
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 .....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	99
11.4 基金投资策略的改变 .....	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	99
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 .....	99
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	99
11.8 其他重大事件 .....	101
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>102</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 .....	102
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>103</b>
13.1 备查文件目录 .....	103
13.2 存放地点 .....	103
13.3 查阅方式 .....	103

## § 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	58,069,539.20 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	30,836,787.07 份	27,232,752.13 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有风险。

## 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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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	2024 年		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	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	1,844,221.07	2,448,716.67	8,807,798.65	14,320,937.58	762,404.18	703,200.58

本期利润	2,871,238 .70	411,507.5 4	— 8,255,199 .49	— 11,458,91 8.37	— 928,094.2 7	— 1,167,200 .60
加权平均 基金份额 本期利润	0.0874	0.0165	-0.1082	-0.1068	-0.0178	-0.0184
本期加权 平均净值 利润率	10.90%	2.04%	-11.48%	-11.38%	-1.80%	-1.88%
本期基金 份额净值 增长率	3.74%	3.30%	-12.32%	-12.66%	-5.16%	-5.39%
3.1.2 期 末数据和 指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供 分配利润	— 4,235,361 .91	— 3,985,847 .91	— 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	-0.1373	-0.1464	-0.2034	-0.2083	-0.0516	-0.0539
期末基金 资产净值	26,601,42 5.16	23,246,90 4.22	19,364,73 0.06	34,904,42 8.54	32,747,39 8.17	75,843,42 2.84
期末基金 份额净值	0.8627	0.8536	0.8316	0.8263	0.9484	0.9461
3.1.3 累 计期末指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额 累计净值 增长率	-13.73%	-14.64%	-16.84%	-17.37%	-5.16%	-5.39%

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

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

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

## 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	-1.11%	1.84%	-0.23%	1.93%	-0.88%	-0.09%
过去六个月	11.45%	1.77%	14.97%	1.91%	-3.52%	-0.14%
过去一年	3.74%	1.66%	5.24%	1.73%	-1.50%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	-13.73%	1.21%	-3.72%	1.29%	- 10.01%	-0.08%

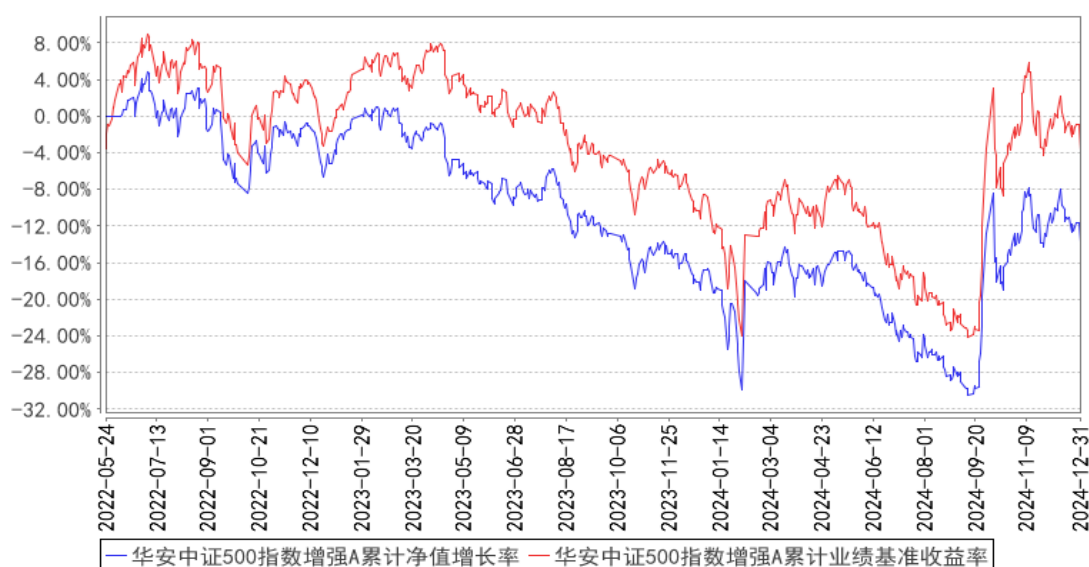
华安中证 500 指数增强 C

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	-1.23%	1.84%	-0.23%	1.93%	-1.00%	-0.09%
过去六个月	11.20%	1.77%	14.97%	1.91%	-3.77%	-0.14%
过去一年	3.30%	1.66%	5.24%	1.73%	-1.94%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	-14.64%	1.21%	-3.72%	1.29%	- 10.92%	-0.08%

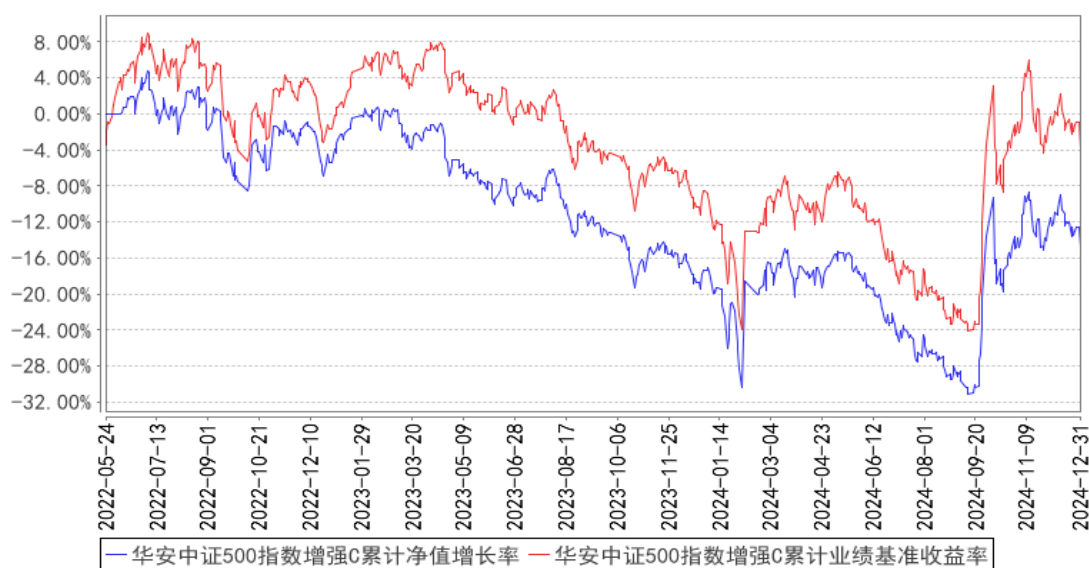


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

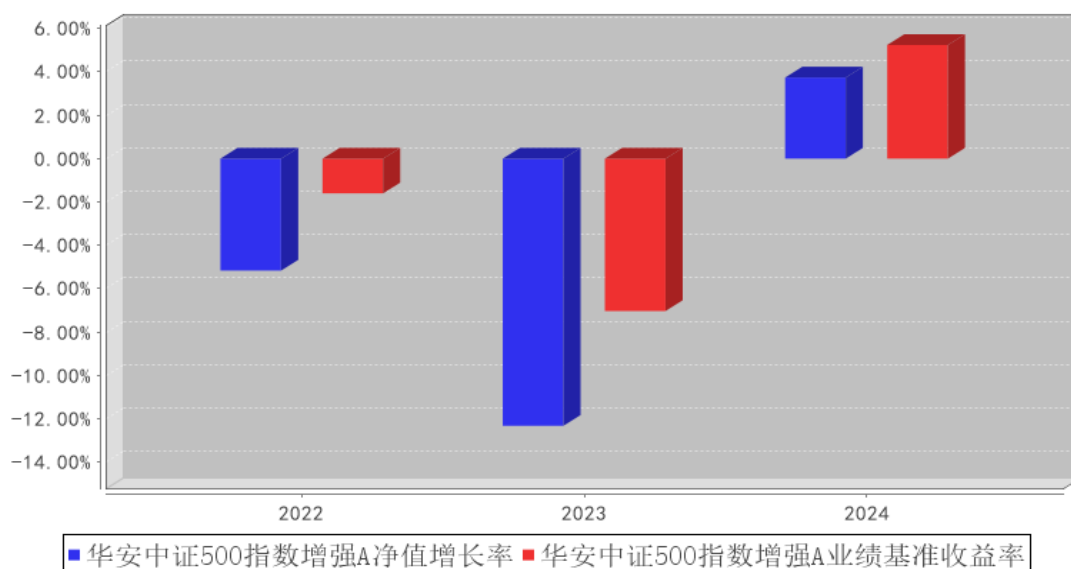


华安中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

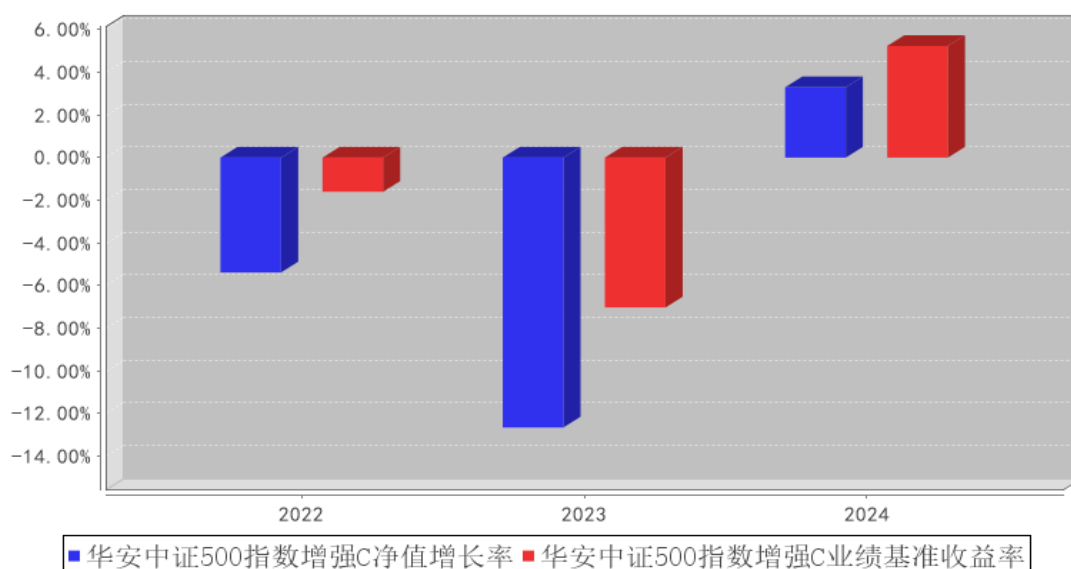


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 2024 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 275 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,931.69 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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	—	10 年	硕士研究生，10 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。

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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 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 1 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观方面，2024 年全年顺利实现 5.0% 的经济增长目标，多项经济指标显示宏观经济持续复

苏，结构上呈现高质量发展。整体失业率平稳，居民收入稳定增长，制造业景气度提升。企业利润虽略降，但高技术制造业增长迅速。

权益市场在全年表现为先抑后扬，年初小微盘股迅速下跌，并在此之后呈现出一个低位震荡的格局，随后在“9.24”政策组合拳的推动下迎来了一轮“V”型反转，主要投资者的风险偏好迅速提升，开始呈现出行业轮动加速、主题投资活跃等特点。行业层面，科技领衔，相关主题层出不穷；风格层面，中小盘股票活跃度提升明显，相对表现也明显强于前三季度。从市场的成交情况也能看到，全 A 日均成交额稳定在万亿以上。

主流的量化策略在过去这一年面临了两次较大挑战，这在历史上也是较为罕见的。一次是在春节前后小微盘流动性危机导致，另一次是在 9.24 之后市场在短期极致的反弹期间，针对此问题我们加强了在组合构建及风险控制方面的深入研究，预期在未来能更好的面对危机时刻。

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 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.8627 元，C 类份额净值为 0.8536 元；本报告期 A 份额净值增长率为 3.74%，同期业绩比较基准增长率为 5.24%；C 类份额净值增长率为 3.30%，同期业绩比较基准增长率为 5.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，仍然设定了 5%左右的稳定增长目标，维持经济的平稳过渡和持续发展，积极应对外部冲击，加大宏观调控，着眼长期规划，平衡供给需求等将成为政策的主要目标。在此背景下，权益市场仍然会有较强的稳定支撑力量，随时市场风险偏好的提升，市场交易活跃度的增强，我们对资本市场保持着长期乐观的态度。

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。

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。

坚持全流程合规与风险管控，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。通过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。

公司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有效提升，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，不断提高合规与风险管理水平，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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值存在连续超过 20 个工作日低于 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

托管人声明：

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的真实、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	毕马威华振审字第 2501511 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	<p>我们审计了后附的华安中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变</p>

	动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>该基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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>(1) 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</p>



	<p>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。</p> <p>(2) 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>(3) 评价该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>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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>我们与该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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	虞京京	朱伊俐
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	4,150,886.97	3,414,141.59
结算备付金		139,265.25	2,515.51
存出保证金		167,526.00	—
交易性金融资产	7.4.7.2	45,490,273.29	51,132,817.71
其中：股票投资		45,490,273.29	51,132,817.71
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		130,209.23	44,625.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		50,078,160.74	54,594,100.51
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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		176,278.82	98,325.59
应付管理人报酬		26,511.27	27,764.27
应付托管费		6,627.80	6,941.02
应付销售服务费		8,413.47	11,911.03
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	12,000.00	180,000.00
负债合计		229,831.36	324,941.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	58,069,539.20	65,524,657.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-8,221,209.82	-11,255,498.82
净资产合计		49,848,329.38	54,269,158.60
负债和净资产总计		50,078,160.74	54,594,100.51

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 58,069,539.20 份，其中 A 类基金份额净值 0.8627 元，基金份额总额 30,836,787.07 份；C 类基金份额净值 0.8536 元，基金份额总额

27,232,752.13 份。

(2) 货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		3,780,939.75	-17,806,645.05
1. 利息收入		21,579.49	55,431.69
其中：存款利息收入	7.4.7.9	21,579.49	55,431.69
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		4,717,853.97	-21,286,386.06
其中：股票投资收益	7.4.7.10	3,361,905.51	-24,150,988.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-434.71	136,371.44
资产支持证券投 资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	481,098.45	330,277.26
股利收益	7.4.7.13	875,370.76	2,397,953.62
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		-86.04	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.14	-1,010,191.50	3,414,618.37
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.15	51,697.79	9,690.95
<b>减：二、营业总支出</b>		498,193.51	1,907,472.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	280,469.16	1,051,316.31
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	7.4.10.2.2	70,117.24	262,829.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	81,261.64	407,833.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		539.21	-
其中：卖出回购金融资产支出		539.21	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1,736.38	1,790.16
8. 其他费用	7.4.7.17	64,069.88	183,703.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,282,746.24	-19,714,117.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,282,746.24	-19,714,117.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,282,746.24	-19,714,117.86

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	65,524,657.42	-	-11,255,498.82	54,269,158.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	65,524,657.42	-	-11,255,498.82	54,269,158.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,455,118.22	-	3,034,289.00	-4,420,829.22
（一）、综合收益总额	-	-	3,282,746.24	3,282,746.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-7,455,118.22	-	-248,457.24	-7,703,575.46

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	80,793,906.07	-	-13,716,445.18	67,077,460.89
2. 基金赎回款	-88,249,024.29	-	13,467,987.94	-74,781,036.35
(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	58,069,539.20	-	-8,221,209.82	49,848,329.38
项目	上年度可比期间 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)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-49,171,957.68	-	14,564,413.13	-34,607,544.55
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	-	-	20,038,657.77	-257,833,105.92
	277,871,763.69			

(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

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”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[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》的核准，由华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2022 年 5 月 24 日生效，首次设立募集规模为 309,758,591.90 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构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更新的基金招募说明书》，本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华安中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产的投资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资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,基金管理人将在依法履行适当程序后,可对本基金的投资比例做相应调整。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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

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

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信



用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技

术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未

分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，由公司根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

#### 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金额。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

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

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

价格数据进行估值。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税 [2014] 81 号文《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 [2016] 127 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《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[2023] 39 号《关于减半

征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对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。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、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。

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

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,487,808.90	2,698,548.24
等于：本金	2,487,535.04	2,698,261.06
加：应计利息	273.86	287.18
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	1,663,078.07	715,593.35
等于：本金	1,662,898.25	715,517.78
加：应计利息	179.82	75.57
减：坏账准备	—	—
合计	4,150,886.97	3,414,141.59

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	46,550,146.05	-	45,490,273.29	-1,059,872.76
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	46,550,146.05	-	45,490,273.29	-1,059,872.76
项目	上年度末 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

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍	1,213,440.00	-	-	-

生工具				
其中： 股指期货 投资	1,213,440.00	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	1,213,440.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	-
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	-	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/ 卖）	合约市值	公允价值变动
IC2506	IC2506	1.00	1,116,840.00	-96,600.00
合计				-96,600.00
减：可抵销期货 暂收款				-96,600.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	-	-
预提审计费	12,000.00	60,000.00
预提费用	-	120,000.00
合计	12,000.00	180,000.00

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,285,283.87	23,285,283.87
本期申购	36,083,697.60	36,083,697.60
本期赎回（以“-”号填列）	-28,532,194.40	-28,532,194.40
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	30,836,787.07	30,836,787.07

华安中证 500 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,239,373.55	42,239,373.55
本期申购	44,710,208.47	44,710,208.47
本期赎回（以“-”号填列）	-59,716,829.89	-59,716,829.89
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	27,232,752.13	27,232,752.13

#### 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	-4,736,036.35	815,482.54	-3,920,553.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,736,036.35	815,482.54	-3,920,553.81
本期利润	1,844,221.07	1,027,017.63	2,871,238.70
本期基金份额交易产生的变动数	-358,002.80	-2,828,044.00	-3,186,046.80
其中：基金申购款	-7,668,968.02	1,496,109.58	-6,172,858.44
基金赎回款	7,310,965.22	-4,324,153.58	2,986,811.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,249,818.08	-985,543.83	-4,235,361.91

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	-8,800,538.20	1,465,593.19	-7,334,945.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-8,800,538.20	1,465,593.19	-7,334,945.01
本期利润	2,448,716.67	-2,037,209.13	411,507.54
本期基金份额交易产生的变动数	3,226,908.72	-289,319.16	2,937,589.56
其中：基金申购款	-10,024,610.58	2,481,023.84	-7,543,586.74
基金赎回款	13,251,519.30	-2,770,343.00	10,481,176.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,124,912.81	-860,935.10	-3,985,847.91

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	9,055.46	33,242.06
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	7,216.65	12,973.16
结算备付金利息收入	5,307.38	9,216.47
其他	-	-
合计	21,579.49	55,431.69

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入

入。

#### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	3,361,905.51	-24,150,988.38
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	3,361,905.51	-24,150,988.38

##### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	836,792,182.22	2,347,052,461.58
减：卖出股票成本 总额	832,501,138.03	2,367,316,856.69
减：交易费用	929,138.68	3,886,593.27
买卖股票差价收入	3,361,905.51	-24,150,988.38

#### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	1,774.40	181.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收	-2,209.11	136,189.48

入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-434.71	136,371.44

#### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,363,204.61	703,817.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,302,022.00	567,300.00
减：应计利息总额	62,046.61	187.42
减：交易费用	1,345.11	140.90
买卖债券差价收入	-2,209.11	136,189.48

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
股指期货投资收益	481,098.45	330,277.26

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	875,370.76	2,397,953.62
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	875,370.76	2,397,953.62

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-913,591.50	3,414,618.37
股票投资	-913,591.50	3,414,618.37
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	-96,600.00	-
权证投资	-	-
期货投资	-96,600.00	-
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	-1,010,191.50	3,414,618.37

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	43,646.76	9,354.62
基金转换费收入	8,051.03	336.33
合计	51,697.79	9,690.95

#### 7.4.7.16 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	12,000.00	60,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,064.72	3,679.14
其他	5.16	24.22
合计	64,069.88	183,703.36



#### 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、基金注册登记机构、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：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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---	--

当期发生的基金应支付的管理费	280,469.16	1,051,316.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	121,546.50	331,615.19
应支付基金管理人的净管理费	158,922.66	719,701.12

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：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,117.24	262,829.06

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  $\times$  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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	—	430.66	430.66
华安基金管理有限公司	—	3,540.20	3,540.20
招商银行股份有限公司	—	3,672.43	3,672.43
合计	—	7,643.29	7,643.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额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

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,487,808.90	9,055.46	2,698,548.24	33,242.06

#### 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002494	华斯股份	2024 年 12 月 30 日	重大事项停牌	3.99	2025 年 1 月 14 日	3.60	11,300	46,364.77	45,087.00	-
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	1,300	9,880.00	9,386.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

#### 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。

#### 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 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 2024 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	4,150,886.97	-	-	-	4,150,886.97
结算备付金	139,265.25	-	-	-	139,265.25
存出保证金	-	-	-	167,526.00	167,526.00
交易性金融资产	-	-	-	45,490,273.29	45,490,273.29
应收申购款	-	-	-	130,209.23	130,209.23
资产总计	4,290,152.22	-	-	45,788,008.52	50,078,160.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	176,278.82	176,278.82
应付管理人报酬	-	-	-	26,511.27	26,511.27
应付托管费	-	-	-	6,627.80	6,627.80
应付销售服务费	-	-	-	8,413.47	8,413.47
其他负债	-	-	-	12,000.00	12,000.00
负债总计	-	-	-	229,831.36	229,831.36
利率敏感度缺口	4,290,152.22	-	-	45,558,177.16	49,848,329.38
上年度末 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	3,414,141.59	-	-	-	3,414,141.59
结算备付金	2,515.51	-	-	-	2,515.51
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

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 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上，根据预期收益、风险预算和交易成本的水平，采用成熟的优化软件对股票投资组合进行优化。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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	45,490,273.29	91.26	51,132,817.71	94.22
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	45,490,273.29	91.26	51,132,817.71	94.22

#### 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,328,546.31	2,432,212.01
	业绩比较基准下降 5%	-2,328,546.31	-2,432,212.01

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	45,435,800.29	51,132,817.71
第二层次	54,473.00	—
第三层次	—	—
合计	45,490,273.29	51,132,817.71

##### 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	45,490,273.29	90.84
	其中：股票	45,490,273.29	90.84
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	4,290,152.22	8.57
8	其他各项资产	297,735.23	0.59
9	合计	50,078,160.74	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	312,181.00	0.63
B	采矿业	1,986,638.00	3.99
C	制造业	20,705,047.95	41.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,824,634.00	3.66
E	建筑业	583,203.00	1.17
F	批发和零售业	1,066,934.92	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	971,164.00	1.95
H	住宿和餐饮业	288,852.00	0.58
I	信息传输、软件	2,505,786.60	5.03

	和信息技术服务业		
J	金融业	4,709,944.00	9.45
K	房地产业	271,798.00	0.55
L	租赁和商务服务业	365,820.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	342,234.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	273,772.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	61,120.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	753,232.00	1.51
S	综合	14,677.00	0.03
	合计	37,037,038.47	74.30

### 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	53,609.00	0.11
B	采矿业	143,333.00	0.29
C	制造业	5,510,032.83	11.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	155,320.00	0.31
E	建筑业	62,754.00	0.13
F	批发和零售业	223,188.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	339,159.00	0.68
H	住宿和餐饮业	29,314.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	538,871.53	1.08
J	金融业	414,239.00	0.83
K	房地产业	50,849.00	0.10
L	租赁和商务服务业	125,750.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	236,860.16	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	471,339.30	0.95

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,488.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	94,128.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	8,453,234.82	16.96

### 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	002625	光启技术	7,900	377,620.00	0.76
2	600418	江淮汽车	9,100	341,250.00	0.68
3	002966	苏州银行	38,300	310,613.00	0.62
4	300144	宋城演艺	31,200	289,848.00	0.58
5	688469	芯联集成	55,148	282,909.24	0.57
6	600352	浙江龙盛	26,600	273,714.00	0.55
7	600096	云天化	12,100	269,830.00	0.54
8	600008	首创环保	80,200	263,056.00	0.53
9	002273	水晶光电	11,800	262,196.00	0.53
10	002595	豪迈科技	5,200	260,988.00	0.52
11	600642	申能股份	26,600	252,434.00	0.51
12	600282	南钢股份	52,700	247,163.00	0.50
13	000423	东阿阿胶	3,900	244,608.00	0.49
14	601665	齐鲁银行	43,700	244,283.00	0.49
15	000937	冀中能源	37,700	238,264.00	0.48
16	002444	巨星科技	7,300	236,155.00	0.47
17	000729	燕京啤酒	19,400	233,576.00	0.47
18	600109	国金证券	26,600	232,218.00	0.47
19	601577	长沙银行	25,700	228,473.00	0.46
20	688538	和辉光电	98,229	227,891.28	0.46
21	601918	新集能源	31,500	226,170.00	0.45
22	000988	华工科技	5,200	225,160.00	0.45
23	600737	中粮糖业	21,400	218,494.00	0.44
24	600299	安迪苏	17,400	218,370.00	0.44
25	600968	海油发展	50,000	213,500.00	0.43
26	601228	广州港	62,900	213,231.00	0.43

27	000050	深天马 A	23,600	213,108.00	0.43
28	002958	青农商行	68,300	207,632.00	0.42
29	601666	平煤股份	20,600	206,412.00	0.41
30	002128	电投能源	10,500	205,590.00	0.41
31	600688	上海石化	67,900	205,058.00	0.41
32	300207	欣旺达	9,100	203,021.00	0.41
33	600529	山东药玻	7,700	198,429.00	0.40
34	600528	中铁工业	24,000	193,440.00	0.39
35	603160	汇顶科技	2,400	193,296.00	0.39
36	601128	常熟银行	24,800	187,736.00	0.38
37	002532	天山铝业	23,800	187,306.00	0.38
38	601997	贵阳银行	30,900	185,400.00	0.37
39	601098	中南传媒	12,200	183,122.00	0.37
40	600487	亨通光电	10,600	182,532.00	0.37
41	000778	新兴铸管	47,400	182,016.00	0.37
42	000739	普洛药业	11,100	180,486.00	0.36
43	600704	物产中大	35,600	180,136.00	0.36
44	300339	润和软件	3,600	180,108.00	0.36
45	002340	格林美	27,500	179,575.00	0.36
46	300140	节能环保	29,800	178,502.00	0.36
47	601162	天风证券	39,600	177,408.00	0.36
48	600258	首旅酒店	12,000	176,040.00	0.35
49	002797	第一创业	20,800	173,680.00	0.35
50	600380	健康元	15,300	172,431.00	0.35
51	002384	东山精密	5,900	172,280.00	0.35
52	601108	财通证券	21,000	171,570.00	0.34
53	600369	西南证券	36,200	169,054.00	0.34
54	600079	人福医药	7,200	168,336.00	0.34
55	600879	航天电子	18,600	166,656.00	0.33
56	600637	东方明珠	21,400	166,064.00	0.33
57	002831	裕同科技	6,100	165,310.00	0.33
58	600839	四川长虹	17,000	164,050.00	0.33
59	601866	中远海发	62,600	163,386.00	0.33
60	601611	中国核建	17,700	160,008.00	0.32
61	600298	安琪酵母	4,400	158,620.00	0.32
62	600141	兴发集团	7,300	158,410.00	0.32
63	002195	岩山科技	39,900	158,403.00	0.32
64	600820	隧道股份	22,000	158,180.00	0.32
65	603379	三美股份	4,100	157,358.00	0.32
66	688777	中控技术	3,162	157,056.54	0.32
67	600517	国网英大	28,500	157,035.00	0.32
68	300476	胜宏科技	3,700	155,733.00	0.31
69	601696	中银证券	13,900	155,124.00	0.31

70	002202	金风科技	15,000	154,950.00	0.31
71	600153	建发股份	14,700	154,644.00	0.31
72	601555	东吴证券	19,400	151,320.00	0.30
73	000738	航发控制	6,800	151,232.00	0.30
74	600655	豫园股份	23,500	151,105.00	0.30
75	601099	太平洋	35,400	150,804.00	0.30
76	600755	厦门国贸	22,300	148,072.00	0.30
77	002353	杰瑞股份	4,000	147,960.00	0.30
78	601991	大唐发电	51,600	147,060.00	0.30
79	600132	重庆啤酒	2,300	144,946.00	0.29
80	600143	金发科技	16,600	143,424.00	0.29
81	600578	京能电力	39,800	140,096.00	0.28
82	600863	内蒙华电	32,100	138,993.00	0.28
83	002373	千方科技	13,700	138,918.00	0.28
84	000831	中国稀土	4,900	137,445.00	0.28
85	300677	英科医疗	5,400	136,512.00	0.27
86	600500	中化国际	33,800	135,876.00	0.27
87	000830	鲁西化工	11,600	135,604.00	0.27
88	301236	软通动力	2,300	135,033.00	0.27
89	002739	万达电影	11,100	134,754.00	0.27
90	603290	斯达半导	1,500	134,730.00	0.27
91	601717	郑煤机	10,300	133,694.00	0.27
92	300003	乐普医疗	11,700	132,678.00	0.27
93	600390	五矿资本	20,300	130,935.00	0.26
94	000783	长江证券	19,100	130,262.00	0.26
95	300676	华大基因	3,100	130,107.00	0.26
96	000598	兴蓉环境	16,900	128,271.00	0.26
97	600004	白云机场	13,200	126,720.00	0.25
98	600392	盛和资源	12,300	126,444.00	0.25
99	600516	方大炭素	26,000	125,580.00	0.25
100	600350	山东高速	12,200	125,416.00	0.25
101	600177	雅戈尔	14,068	125,205.20	0.25
102	601568	北元集团	29,800	125,160.00	0.25
103	000563	陕国投 A	35,100	124,956.00	0.25
104	600707	彩虹股份	15,200	124,944.00	0.25
105	000636	风华高科	8,700	124,845.00	0.25
106	000883	湖北能源	24,600	122,508.00	0.25
107	301301	川宁生物	10,300	122,158.00	0.25
108	600021	上海电力	13,300	121,961.00	0.24
109	300017	网宿科技	11,500	121,555.00	0.24
110	000723	美锦能源	26,700	120,417.00	0.24
111	600535	天士力	8,300	120,018.00	0.24
112	600271	航天信息	13,100	119,341.00	0.24

113	002867	周大生	8,200	119,146.00	0.24
114	600582	天地科技	19,200	118,656.00	0.24
115	600901	江苏金租	22,600	117,972.00	0.24
116	603233	大参林	7,700	115,962.00	0.23
117	002156	通富微电	3,900	115,245.00	0.23
118	600754	锦江酒店	4,200	112,812.00	0.23
119	601106	中国一重	38,400	111,744.00	0.22
120	002939	长城证券	13,600	111,520.00	0.22
121	000426	兴业银锡	10,000	111,200.00	0.22
122	601615	明阳智能	8,800	110,968.00	0.22
123	603087	甘李药业	2,500	110,250.00	0.22
124	600925	苏能股份	20,700	109,710.00	0.22
125	002563	森马服饰	15,500	108,810.00	0.22
126	688425	铁建重工	24,615	108,306.00	0.22
127	688120	华海清科	661	107,736.39	0.22
128	601155	新城控股	9,000	107,640.00	0.22
129	603816	顾家家居	3,900	107,562.00	0.22
130	600583	海油工程	19,600	107,212.00	0.22
131	002185	华天科技	9,200	106,812.00	0.21
132	002153	石基信息	14,900	106,386.00	0.21
133	600129	太极集团	4,300	106,296.00	0.21
134	600928	西安银行	29,100	105,051.00	0.21
135	002984	森麒麟	4,200	103,572.00	0.21
136	002738	中矿资源	2,900	102,950.00	0.21
137	000998	隆平高科	9,200	102,764.00	0.21
138	000703	恒逸石化	16,300	102,364.00	0.21
139	688278	特宝生物	1,394	102,277.78	0.21
140	600885	宏发股份	3,200	101,824.00	0.20
141	002414	高德红外	13,700	101,791.00	0.20
142	000629	钒钛股份	35,300	101,664.00	0.20
143	002266	浙富控股	32,300	100,776.00	0.20
144	000066	中国长城	6,900	100,533.00	0.20
145	002281	光迅科技	1,900	99,123.00	0.20
146	601598	中国外运	18,400	98,440.00	0.20
147	601933	永辉超市	15,500	98,270.00	0.20
148	000932	华菱钢铁	23,500	98,230.00	0.20
149	002138	顺络电子	3,100	97,588.00	0.20
150	600598	北大荒	6,600	97,350.00	0.20
151	300001	特锐德	4,400	96,580.00	0.19
152	300070	碧水源	18,800	95,128.00	0.19
153	601000	唐山港	20,000	94,200.00	0.19
154	600536	中国软件	2,000	93,380.00	0.19
155	601168	西部矿业	5,800	93,206.00	0.19



156	002423	中粮资本	6,900	92,391.00	0.19
157	600339	中油工程	25,700	92,006.00	0.18
158	000728	国元证券	11,000	91,960.00	0.18
159	300487	蓝晓科技	1,900	90,953.00	0.18
160	601118	海南橡胶	16,700	90,347.00	0.18
161	601179	中国西电	11,800	89,562.00	0.18
162	003035	南网能源	21,100	88,198.00	0.18
163	002408	齐翔腾达	17,400	87,522.00	0.18
164	300395	菲利华	2,300	86,503.00	0.17
165	000032	深桑达 A	4,900	86,436.00	0.17
166	600873	梅花生物	8,600	86,258.00	0.17
167	600546	山煤国际	7,200	85,176.00	0.17
168	603883	老百姓	5,200	85,124.00	0.17
169	688122	西部超导	1,974	84,526.68	0.17
170	600988	赤峰黄金	5,400	84,294.00	0.17
171	000009	中国宝安	9,200	84,180.00	0.17
172	002223	鱼跃医疗	2,300	83,927.00	0.17
173	000513	丽珠集团	2,200	83,600.00	0.17
174	600862	中航高科	3,300	83,358.00	0.17
175	600007	中国国贸	3,400	83,164.00	0.17
176	601567	三星医疗	2,700	83,052.00	0.17
177	000559	万向钱潮	13,500	83,025.00	0.17
178	000967	盈峰环境	16,700	82,999.00	0.17
179	601233	桐昆股份	7,000	82,600.00	0.17
180	600521	华海药业	4,600	82,202.00	0.16
181	301358	湖南裕能	1,800	81,576.00	0.16
182	600486	扬农化工	1,400	81,018.00	0.16
183	002261	拓维信息	4,400	80,564.00	0.16
184	002507	涪陵榨菜	5,700	80,541.00	0.16
185	000591	太阳能	16,900	80,444.00	0.16
186	600959	江苏有线	24,000	80,400.00	0.16
187	002517	恺英网络	5,900	80,299.00	0.16
188	603156	养元饮品	3,500	79,940.00	0.16
189	601990	南京证券	9,200	79,672.00	0.16
190	601399	国机重装	25,700	79,156.00	0.16
191	002436	兴森科技	7,100	78,881.00	0.16
192	603658	安图生物	1,800	78,552.00	0.16
193	000519	中兵红箭	5,400	78,030.00	0.16
194	603568	伟明环保	3,600	77,868.00	0.16
195	300024	机器人	4,300	77,185.00	0.15
196	000683	远兴能源	13,800	77,142.00	0.15
197	601231	环旭电子	4,600	75,900.00	0.15
198	600765	中航重机	3,700	75,739.00	0.15

199	601016	节能风电	23,800	75,446.00	0.15
200	688617	惠泰医疗	202	75,210.66	0.15
201	002008	大族激光	3,000	75,000.00	0.15
201	600398	海澜之家	10,000	75,000.00	0.15
202	300474	景嘉微	800	74,792.00	0.15
203	002472	双环传动	2,400	73,488.00	0.15
204	300601	康泰生物	4,200	72,030.00	0.14
205	002085	万丰奥威	3,800	72,010.00	0.14
206	000709	河钢股份	32,500	71,825.00	0.14
207	300114	中航电测	1,000	71,780.00	0.14
208	002078	太阳纸业	4,800	71,376.00	0.14
209	300136	信维通信	2,800	71,232.00	0.14
210	601001	晋控煤业	5,200	71,084.00	0.14
211	600118	中国卫星	2,600	70,980.00	0.14
212	688099	晶晨股份	1,030	70,740.40	0.14
213	600699	均胜电子	4,500	70,515.00	0.14
214	601965	中国汽研	4,000	70,480.00	0.14
215	603341	龙旗科技	1,500	70,125.00	0.14
216	002926	华西证券	8,400	69,804.00	0.14
217	600566	济川药业	2,400	69,792.00	0.14
218	601216	君正集团	13,200	69,432.00	0.14
219	000060	中金岭南	14,800	69,412.00	0.14
220	002673	西部证券	8,500	69,275.00	0.14
221	000825	太钢不锈	19,900	69,252.00	0.14
222	600871	石化油服	33,700	68,748.00	0.14
223	001227	兰州银行	27,900	68,634.00	0.14
224	002500	山西证券	10,900	68,452.00	0.14
225	300002	神州泰岳	5,900	68,381.00	0.14
226	300223	北京君正	1,000	68,200.00	0.14
227	688180	君实生物	2,480	67,778.40	0.14
228	000750	国海证券	15,800	67,624.00	0.14
229	300803	指南针	700	67,165.00	0.13
230	688114	华大智造	1,409	65,927.11	0.13
231	600361	创新新材	17,000	65,620.00	0.13
232	002439	启明星辰	4,100	64,862.00	0.13
233	600867	通化东宝	8,000	64,480.00	0.13
234	600909	华安证券	10,600	64,236.00	0.13
235	601158	重庆水务	13,100	64,190.00	0.13
236	600739	辽宁成大	6,200	64,170.00	0.13
237	002465	海格通信	5,800	63,684.00	0.13
238	600378	昊华科技	2,200	63,602.00	0.13
239	300058	蓝色光标	6,800	63,104.00	0.13
240	002120	韵达股份	8,300	62,416.00	0.13

241	688072	拓荆科技	400	61,468.00	0.12
242	002432	九安医疗	1,500	61,170.00	0.12
243	002821	凯莱英	800	60,872.00	0.12
244	689009	九号公司	1,274	60,515.00	0.12
245	688563	航材股份	1,070	59,748.80	0.12
246	688561	奇安信	2,200	59,026.00	0.12
247	300866	安克创新	600	58,584.00	0.12
248	600859	王府井	3,800	58,558.00	0.12
249	002268	电科网安	3,600	58,500.00	0.12
250	600098	广州发展	9,100	58,422.00	0.12
251	002608	江苏国信	7,600	58,292.00	0.12
252	603939	益丰药房	2,400	57,912.00	0.12
253	002508	老板电器	2,700	57,861.00	0.12
254	603345	安井食品	700	57,036.00	0.11
255	601966	玲珑轮胎	3,100	55,924.00	0.11
256	603786	科博达	900	55,620.00	0.11
257	002683	广东宏大	2,100	55,608.00	0.11
258	300383	光环新网	3,800	55,442.00	0.11
259	603893	瑞芯微	500	55,030.00	0.11
260	600155	华创云信	7,400	54,760.00	0.11
261	688249	晶合集成	2,344	54,708.96	0.11
262	688047	龙芯中科	406	53,705.68	0.11
263	300496	中科创达	900	53,604.00	0.11
264	300012	华测检测	4,300	53,449.00	0.11
265	603606	东方电缆	1,000	52,550.00	0.11
266	605358	立昂微	2,100	52,017.00	0.10
267	300009	安科生物	6,000	51,840.00	0.10
268	601198	东兴证券	4,700	51,747.00	0.10
269	600549	厦门钨业	2,600	50,102.00	0.10
270	300595	欧普康视	2,600	49,270.00	0.10
271	603688	石英股份	1,700	48,841.00	0.10
272	600977	中国电影	4,200	48,762.00	0.10
273	300699	光威复材	1,400	48,510.00	0.10
274	688213	思特威	624	48,497.28	0.10
275	600872	中炬高新	2,200	48,444.00	0.10
276	600131	国网信通	2,500	47,275.00	0.09
277	300251	光线传媒	5,000	47,200.00	0.09
278	603129	春风动力	300	47,121.00	0.09
279	600998	九州通	9,166	46,929.92	0.09
280	000400	许继电气	1,700	46,801.00	0.09
281	000959	首钢股份	15,200	46,360.00	0.09
282	002064	华峰化学	5,600	45,808.00	0.09
283	600895	张江高科	1,700	45,560.00	0.09

284	300118	东方日升	3,800	45,524.00	0.09
285	601958	金钼股份	4,500	45,270.00	0.09
286	601928	凤凰传媒	3,900	45,006.00	0.09
287	300073	当升科技	1,100	44,308.00	0.09
288	300604	长川科技	1,000	44,130.00	0.09
289	688521	芯原股份	836	43,831.48	0.09
290	002262	恩华药业	1,800	43,830.00	0.09
291	301165	锐捷网络	600	43,320.00	0.09
292	688017	绿的谐波	400	43,224.00	0.09
293	002368	太极股份	1,800	42,624.00	0.09
294	603605	珀莱雅	500	42,350.00	0.08
295	300212	易华录	1,800	42,120.00	0.08
296	002690	美亚光电	2,800	41,496.00	0.08
297	601061	中信金属	5,700	41,382.00	0.08
298	300037	新宙邦	1,100	41,184.00	0.08
299	600348	华阳股份	5,800	41,122.00	0.08
300	600170	上海建工	15,500	41,075.00	0.08
301	002409	雅克科技	700	40,565.00	0.08
302	600095	湘财股份	5,600	40,320.00	0.08
303	601139	深圳燃气	5,700	40,242.00	0.08
304	000027	深圳能源	6,200	40,176.00	0.08
305	603596	伯特利	900	40,131.00	0.08
306	601212	白银有色	14,300	39,754.00	0.08
307	600062	华润双鹤	2,000	39,600.00	0.08
308	002372	伟星新材	3,100	39,153.00	0.08
309	300054	鼎龙股份	1,500	39,030.00	0.08
310	603228	景旺电子	1,400	38,976.00	0.08
311	603338	浙江鼎力	600	38,712.00	0.08
312	002203	海亮股份	3,600	38,700.00	0.08
313	603885	吉祥航空	2,800	38,360.00	0.08
314	002850	科达利	389	37,997.52	0.08
315	600612	老凤祥	700	37,989.00	0.08
316	300142	沃森生物	3,100	37,448.00	0.08
317	300390	天华新能	1,600	36,880.00	0.07
318	601636	旗滨集团	6,500	36,465.00	0.07
319	688525	佰维存储	586	36,314.42	0.07
320	600563	法拉电子	300	35,676.00	0.07
321	603000	人民网	1,600	35,264.00	0.07
322	600295	鄂尔多斯	3,600	35,136.00	0.07
323	000987	越秀资本	5,000	35,100.00	0.07
324	600606	绿地控股	16,700	35,070.00	0.07
325	603712	七一二	1,800	35,046.00	0.07
326	600511	国药股份	1,000	34,220.00	0.07

327	000021	深科技	1,768	33,698.08	0.07
328	600816	建元信托	9,600	33,600.00	0.07
329	600497	驰宏锌锗	6,000	33,420.00	0.07
330	603882	金域医学	1,200	33,036.00	0.07
331	002558	巨人网络	2,600	32,994.00	0.07
332	603707	健友股份	2,485	32,975.95	0.07
333	603486	科沃斯	700	32,900.00	0.07
334	000039	中集集团	4,200	32,634.00	0.07
335	603927	中科软	1,500	32,550.00	0.07
336	000960	锡业股份	2,300	32,269.00	0.06
337	300724	捷佳伟创	500	31,605.00	0.06
338	603650	彤程新材	900	31,473.00	0.06
339	002429	兆驰股份	5,400	31,212.00	0.06
340	000878	云南铜业	2,500	30,475.00	0.06
341	601156	东航物流	1,800	30,366.00	0.06
342	688349	三一重能	982	30,324.16	0.06
343	300888	稳健医疗	700	29,456.00	0.06
344	000539	粤电力 A	6,500	29,445.00	0.06
345	688819	天能股份	1,029	28,009.38	0.06
346	000623	吉林敖东	1,600	27,632.00	0.06
347	600498	烽火通信	1,400	27,244.00	0.05
348	002410	广联达	2,300	27,048.00	0.05
349	002407	多氟多	2,200	26,400.00	0.05
350	600416	湘电股份	2,200	24,838.00	0.05
351	002385	大北农	5,600	24,248.00	0.05
352	688002	睿创微纳	514	24,163.14	0.05
353	000898	鞍钢股份	9,900	23,760.00	0.05
354	688032	禾迈股份	209	23,541.76	0.05
355	300529	健帆生物	800	23,472.00	0.05
356	002557	洽洽食品	800	23,240.00	0.05
357	000997	新大陆	1,100	21,945.00	0.04
358	603444	吉比特	100	21,884.00	0.04
359	688475	萤石网络	722	21,797.18	0.04
360	002299	圣农发展	1,500	21,720.00	0.04
361	300919	中伟股份	600	21,672.00	0.04
362	002294	信立泰	700	21,651.00	0.04
363	603298	杭叉集团	1,200	21,468.00	0.04
364	000733	振华科技	500	21,085.00	0.04
365	002152	广电运通	1,800	20,988.00	0.04
366	002065	东华软件	2,800	20,328.00	0.04
367	600126	杭钢股份	4,200	20,076.00	0.04
368	688578	艾力斯	334	20,006.60	0.04
369	600060	海信视像	1,000	19,940.00	0.04

370	688220	翱捷科技	359	19,418.31	0.04
371	002155	湖南黄金	1,200	18,876.00	0.04
372	688363	华熙生物	369	18,833.76	0.04
373	603056	德邦股份	1,300	18,629.00	0.04
374	002624	完美世界	1,800	18,594.00	0.04
375	603556	海兴电力	500	18,495.00	0.04
376	002670	国盛金控	1,400	18,326.00	0.04
377	300763	锦浪科技	300	18,321.00	0.04
378	002056	横店东磁	1,400	18,144.00	0.04
379	688361	中科飞测	200	17,510.00	0.04
380	688052	纳芯微	133	17,329.90	0.03
381	600906	财达证券	2,300	16,330.00	0.03
382	300558	贝达药业	300	16,179.00	0.03
383	300765	新诺威	600	15,954.00	0.03
384	300285	国瓷材料	900	15,336.00	0.03
385	301267	华夏眼科	800	15,232.00	0.03
386	600166	福田汽车	6,000	15,060.00	0.03
387	600673	东阳光	1,300	14,677.00	0.03
388	600208	衢州发展	4,900	14,504.00	0.03
389	000921	海信家电	500	14,450.00	0.03
390	000034	神州数码	400	14,020.00	0.03
391	600483	福能股份	1,400	13,958.00	0.03
392	601608	中信重工	3,300	13,860.00	0.03
393	600808	马钢股份	4,300	13,287.00	0.03
394	600848	上海临港	1,300	13,130.00	0.03
395	300373	扬杰科技	300	13,056.00	0.03
396	002044	美年健康	2,800	12,852.00	0.03
397	600316	洪都航空	400	12,848.00	0.03
398	688297	中无人机	307	12,365.96	0.02
399	603529	爱玛科技	300	12,306.00	0.02
400	600764	中国海防	400	11,328.00	0.02
401	600956	新天绿能	1,500	11,310.00	0.02
402	600720	中交设计	1,200	10,632.00	0.02
403	003031	中瓷电子	200	10,478.00	0.02
404	600970	中材国际	1,100	10,428.00	0.02
405	002653	海思科	300	9,975.00	0.02
406	688375	国博电子	200	9,872.00	0.02
407	688387	信科移动	1,603	9,553.88	0.02
408	000818	航锦科技	500	9,550.00	0.02
409	600685	中船防务	400	9,480.00	0.02
409	603858	步长制药	600	9,480.00	0.02
410	688065	凯赛生物	242	9,389.60	0.02
411	600499	科达制造	1,200	9,360.00	0.02

412	001286	陕西能源	1,000	9,280.00	0.02
413	600329	达仁堂	300	9,240.00	0.02
414	600995	南网储能	900	9,108.00	0.02
415	000958	电投产融	1,400	8,722.00	0.02
416	600580	卧龙电驱	500	8,595.00	0.02
417	688295	中复神鹰	427	8,510.11	0.02
418	000401	冀东水泥	1,600	8,368.00	0.02
419	002487	大金重工	400	8,196.00	0.02
420	600927	永安期货	600	7,914.00	0.02
421	600435	北方导航	700	6,832.00	0.01
422	600032	浙江新能	900	6,660.00	0.01
423	688772	珠海冠宇	408	6,560.64	0.01
424	688234	天岳先进	123	6,297.60	0.01
425	688188	柏楚电子	28	5,439.00	0.01
426	601456	国联民生	400	5,408.00	0.01
427	300748	金力永磁	300	5,364.00	0.01
428	001203	大中矿业	600	5,196.00	0.01
429	600663	陆家嘴	500	4,920.00	0.01
430	300146	汤臣倍健	400	4,820.00	0.01
431	000537	中绿电	500	4,560.00	0.01
432	601019	山东出版	400	4,540.00	0.01
433	603179	新泉股份	100	4,270.00	0.01
434	603456	九洲药业	300	4,104.00	0.01
435	603225	新凤鸣	364	4,051.32	0.01
436	600312	平高电气	200	3,840.00	0.01
437	002756	永兴材料	100	3,772.00	0.01
438	688567	孚能科技	259	3,004.40	0.01
439	600325	华发股份	500	2,880.00	0.01
440	003022	联泓新科	200	2,754.00	0.01
441	002531	天顺风能	300	2,373.00	0.00
442	002430	杭氧股份	100	2,180.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688132	邦彦技术	3,888	66,018.24	0.13
2	301263	泰恩康	4,300	64,457.00	0.13
3	688009	中国通号	8,969	56,145.94	0.11
4	300513	恒实科技	5,700	52,041.00	0.10
5	301302	华如科技	2,100	50,505.00	0.10
6	000725	京东方 A	11,500	50,485.00	0.10
7	301212	联盛化学	2,300	47,541.00	0.10
8	002494	华斯股份	11,300	45,087.00	0.09

9	603968	醋化股份	4,800	44,496.00	0.09
10	000089	深圳机场	6,300	43,407.00	0.09
11	300707	威唐工业	2,800	43,036.00	0.09
12	300774	倍杰特	4,800	42,144.00	0.08
13	601816	京沪高铁	6,800	41,888.00	0.08
14	300911	亿田智能	1,600	41,728.00	0.08
15	001202	炬申股份	3,000	41,670.00	0.08
16	300423	昇辉科技	5,900	40,828.00	0.08
17	002671	龙泉股份	9,000	40,770.00	0.08
18	002149	西部材料	2,300	40,710.00	0.08
19	000026	飞亚达	3,900	40,443.00	0.08
20	600897	厦门空港	2,600	39,598.00	0.08
21	600439	瑞贝卡	11,700	39,429.00	0.08
22	601398	工商银行	5,600	38,752.00	0.08
23	300371	汇中股份	4,000	38,360.00	0.08
24	300021	大禹节水	9,400	38,258.00	0.08
25	601956	东贝集团	7,900	38,157.00	0.08
26	600551	时代出版	4,400	37,884.00	0.08
27	300510	金冠股份	8,900	37,736.00	0.08
28	002574	明牌珠宝	8,000	36,880.00	0.07
29	600138	中青旅	3,600	36,504.00	0.07
30	301026	浩通科技	1,300	35,620.00	0.07
31	002345	潮宏基	6,100	35,441.00	0.07
32	688611	杭州柯林	1,044	34,911.36	0.07
33	002732	燕塘乳业	2,200	34,562.00	0.07
34	002446	盛路通信	5,100	33,405.00	0.07
35	002986	宇新股份	2,800	33,264.00	0.07
36	002526	山东矿机	9,400	33,182.00	0.07
37	601288	农业银行	6,200	33,108.00	0.07
38	000529	广弘控股	5,600	33,040.00	0.07
39	301273	瑞晨环保	1,800	32,922.00	0.07
40	002014	永新股份	3,000	32,880.00	0.07
41	002636	金安国纪	4,200	32,508.00	0.07
42	300515	三德科技	2,700	32,157.00	0.06
43	600706	曲江文旅	3,300	31,680.00	0.06
44	301100	风光股份	1,900	31,540.00	0.06
45	002852	道道全	3,800	31,388.00	0.06
46	300296	利亚德	4,800	30,912.00	0.06
47	002948	青岛银行	7,900	30,652.00	0.06
48	603199	九华旅游	900	30,375.00	0.06
49	300745	欣锐科技	1,900	30,248.00	0.06
50	002461	珠江啤酒	3,000	29,670.00	0.06
51	002772	众兴菌业	4,000	29,480.00	0.06



52	600918	中泰证券	4,400	28,908.00	0.06
53	002228	合兴包装	9,600	28,800.00	0.06
54	605259	绿田机械	1,900	28,785.00	0.06
55	603681	永冠新材	2,200	28,358.00	0.06
56	605133	嵘泰股份	1,200	28,236.00	0.06
57	002398	垒知集团	6,400	28,096.00	0.06
58	301092	争光股份	1,200	27,996.00	0.06
59	603676	卫信康	2,800	27,860.00	0.06
60	600346	恒力石化	1,800	27,630.00	0.06
61	301387	光大同创	800	27,440.00	0.06
62	601939	建设银行	3,100	27,249.00	0.05
63	688053	思科瑞	960	27,168.00	0.05
64	002753	永东股份	4,300	26,961.00	0.05
65	002554	惠博普	10,700	26,857.00	0.05
66	300232	洲明科技	3,900	26,793.00	0.05
67	002949	华阳国际	1,500	26,730.00	0.05
68	601658	邮储银行	4,700	26,696.00	0.05
69	300639	凯普生物	4,500	26,685.00	0.05
70	000726	鲁 泰 A	4,000	26,080.00	0.05
71	603757	大元泵业	1,300	26,065.00	0.05
72	301313	凡拓数创	1,000	25,880.00	0.05
73	603059	倍加洁	1,100	25,663.00	0.05
74	300614	百川畅银	2,700	25,596.00	0.05
75	600798	宁波海运	8,400	25,452.00	0.05
76	301115	建科股份	1,800	25,182.00	0.05
77	601766	中国中车	3,000	25,140.00	0.05
78	002669	康达新材	2,600	25,038.00	0.05
79	600071	凤凰光学	1,200	25,020.00	0.05
80	002489	浙江永强	7,700	24,948.00	0.05
81	001299	美能能源	2,000	24,880.00	0.05
82	603323	苏农银行	4,600	24,334.00	0.05
83	600572	康恩贝	5,200	24,232.00	0.05
84	000055	方大集团	6,100	24,034.00	0.05
85	000538	云南白药	400	23,980.00	0.05
86	300977	深圳瑞捷	1,300	23,959.00	0.05
87	002454	松芝股份	3,600	23,940.00	0.05
88	300185	通裕重工	9,300	23,901.00	0.05
89	603909	建发合诚	2,600	23,816.00	0.05
90	002286	保龄宝	3,200	23,616.00	0.05
91	002391	长青股份	4,700	23,547.00	0.05
92	301439	泓淋电力	1,700	23,375.00	0.05
93	300420	五洋自控	7,400	23,014.00	0.05
94	301303	真兰仪表	1,500	22,980.00	0.05

95	603987	康德莱	3,200	22,976.00	0.05
96	688656	浩欧博	240	22,920.00	0.05
97	002858	力盛体育	2,000	22,880.00	0.05
98	603239	浙江仙通	1,700	22,865.00	0.05
99	003011	海象新材	1,500	22,800.00	0.05
100	002108	沧州明珠	6,300	22,617.00	0.05
101	600054	黄山旅游	2,000	22,600.00	0.05
102	603065	宿迁联盛	3,100	22,537.00	0.05
103	301335	天元宠物	1,000	22,500.00	0.05
104	688126	沪硅产业	1,195	22,489.90	0.05
105	300190	维尔利	6,400	22,464.00	0.05
106	600410	华胜天成	3,100	22,444.00	0.05
107	300481	濮阳惠成	1,500	22,230.00	0.04
108	002478	常宝股份	4,200	22,218.00	0.04
109	603177	德创环保	3,000	22,080.00	0.04
110	688156	路德环境	1,611	21,796.83	0.04
111	688566	吉贝尔	973	21,795.20	0.04
112	688011	新光光电	1,419	21,739.08	0.04
113	301389	隆扬电子	1,300	21,736.00	0.04
114	300818	耐普矿机	800	21,728.00	0.04
115	300132	青松股份	4,400	21,692.00	0.04
116	300868	杰美特	800	21,664.00	0.04
117	000715	中兴商业	3,100	21,545.00	0.04
118	301270	汉仪股份	600	21,444.00	0.04
119	002839	张家港行	4,900	21,413.00	0.04
120	300305	裕兴股份	3,900	21,255.00	0.04
121	300556	丝路视觉	1,100	20,955.00	0.04
122	000581	威孚高科	1,100	20,768.00	0.04
122	000895	双汇发展	800	20,768.00	0.04
123	002687	乔治白	4,700	20,586.00	0.04
124	002815	崇达技术	2,000	20,400.00	0.04
125	601328	交通银行	2,600	20,202.00	0.04
126	300828	锐新科技	1,200	20,184.00	0.04
127	002440	闰土股份	3,000	20,130.00	0.04
128	601015	陕西黑猫	6,000	20,040.00	0.04
129	688137	近岸蛋白	601	19,953.20	0.04
130	601868	中国能建	8,700	19,923.00	0.04
131	601808	中海油服	1,300	19,825.00	0.04
132	300958	建工修复	1,700	19,584.00	0.04
133	002903	宇环数控	1,200	19,500.00	0.04
134	603209	兴通股份	1,200	19,176.00	0.04
135	300559	佳发教育	1,600	19,136.00	0.04
136	601330	绿色动力	2,900	19,024.00	0.04

137	600237	铜峰电子	2,900	18,995.00	0.04
138	600353	旭光电子	2,600	18,772.00	0.04
139	002807	江阴银行	4,300	18,705.00	0.04
140	688148	芳源股份	3,775	18,686.25	0.04
141	603138	海量数据	1,300	18,681.00	0.04
142	300193	佳士科技	2,100	18,669.00	0.04
143	000599	青岛双星	4,200	18,648.00	0.04
144	002033	丽江股份	2,100	18,627.00	0.04
145	603966	法兰泰克	2,400	18,528.00	0.04
146	003030	祖名股份	1,200	18,456.00	0.04
147	300718	长盛轴承	600	18,414.00	0.04
148	301388	欣灵电气	800	18,392.00	0.04
149	301117	佳缘科技	600	18,378.00	0.04
150	001213	中铁特货	4,400	18,348.00	0.04
151	601702	华峰铝业	1,000	18,320.00	0.04
152	300180	华峰超纤	2,900	18,270.00	0.04
153	300994	久祺股份	1,600	18,048.00	0.04
154	603626	科森科技	2,300	17,940.00	0.04
155	300652	雷迪克	600	17,832.00	0.04
156	603192	汇得科技	1,200	17,808.00	0.04
157	002026	山东威达	1,800	17,712.00	0.04
158	300583	赛托生物	900	17,595.00	0.04
159	688496	清越科技	2,050	17,568.50	0.04
160	600894	广日股份	1,200	17,520.00	0.04
161	301319	唯特偶	600	17,496.00	0.04
162	001256	炜冈科技	1,100	17,490.00	0.04
163	688466	金科环境	1,289	17,465.95	0.04
164	688306	均普智能	2,241	17,367.75	0.03
165	605377	华旺科技	1,300	17,355.00	0.03
166	301006	迈拓股份	1,300	17,134.00	0.03
167	600123	兰花科创	2,000	17,120.00	0.03
168	688223	晶科能源	2,388	16,978.68	0.03
169	000920	沃顿科技	1,900	16,948.00	0.03
170	002279	久其软件	2,700	16,929.00	0.03
171	300877	金春股份	1,200	16,860.00	0.03
172	301073	君亭酒店	800	16,696.00	0.03
173	300164	通源石油	3,900	16,614.00	0.03
174	000417	合百集团	2,600	16,588.00	0.03
175	600236	桂冠电力	2,400	16,320.00	0.03
176	000404	长虹华意	2,200	16,280.00	0.03
177	300326	凯利泰	2,500	16,250.00	0.03
178	300767	震安科技	1,800	16,236.00	0.03
179	688677	海泰新光	425	16,005.50	0.03

180	301062	上海艾录	1,200	15,720.00	0.03
181	688371	菲沃泰	1,004	15,582.08	0.03
182	605138	盛泰集团	2,800	15,456.00	0.03
183	603595	东尼电子	900	15,381.00	0.03
184	000553	安道麦 A	2,300	15,364.00	0.03
185	603566	普莱柯	1,200	15,312.00	0.03
186	688600	皖仪科技	1,137	15,292.65	0.03
187	301373	凌玮科技	600	15,228.00	0.03
188	600075	新疆天业	3,500	15,225.00	0.03
189	002726	龙大美食	1,900	15,048.00	0.03
190	601018	宁波港	3,900	15,015.00	0.03
191	002126	银轮股份	800	14,976.00	0.03
192	300912	凯龙高科	1,300	14,950.00	0.03
193	600740	山西焦化	3,700	14,911.00	0.03
194	000541	佛山照明	2,400	14,880.00	0.03
195	605116	奥锐特	700	14,784.00	0.03
196	600366	宁波韵升	2,000	14,720.00	0.03
197	002631	德尔未来	3,300	14,619.00	0.03
198	600821	金开新能	2,700	14,580.00	0.03
199	603200	上海洗霸	600	14,562.00	0.03
200	688179	阿拉丁	1,051	14,503.80	0.03
201	002556	辉隆股份	2,600	14,482.00	0.03
202	600000	浦发银行	1,400	14,406.00	0.03
203	002029	七匹狼	2,200	14,388.00	0.03
204	603585	苏利股份	1,200	14,364.00	0.03
205	300388	节能国祯	1,900	14,345.00	0.03
206	300491	通合科技	900	14,328.00	0.03
207	002546	新联电子	3,300	14,289.00	0.03
208	301055	张小泉	900	14,247.00	0.03
209	002212	天融信	2,200	14,190.00	0.03
210	603601	再升科技	4,200	14,112.00	0.03
211	002036	联创电子	1,500	14,100.00	0.03
211	300228	富瑞特装	2,000	14,100.00	0.03
211	603898	好莱客	1,500	14,100.00	0.03
212	000761	本钢板材	4,400	14,080.00	0.03
212	002658	雪迪龙	2,200	14,080.00	0.03
213	301028	东亚机械	1,300	14,027.00	0.03
214	300865	大宏立	600	14,004.00	0.03
215	300735	光弘科技	500	13,995.00	0.03
216	603808	歌力思	2,000	13,980.00	0.03
217	002034	旺能环境	900	13,950.00	0.03
218	002457	青龙管业	1,200	13,920.00	0.03
219	002990	盛视科技	600	13,902.00	0.03

220	605208	永茂泰	1,800	13,878.00	0.03
221	300355	蒙草生态	2,700	13,851.00	0.03
222	600705	中航产融	3,800	13,794.00	0.03
223	300945	曼卡龙	1,200	13,788.00	0.03
224	002039	黔源电力	900	13,734.00	0.03
225	600459	贵研铂业	1,000	13,730.00	0.03
226	301256	华融化学	1,800	13,698.00	0.03
227	603086	先达股份	3,200	13,696.00	0.03
228	600967	内蒙一机	1,600	13,600.00	0.03
229	605288	凯迪股份	400	13,588.00	0.03
230	002275	桂林三金	900	13,581.00	0.03
231	300095	华伍股份	2,000	13,580.00	0.03
232	300636	同和药业	1,700	13,549.00	0.03
233	300993	玉马科技	1,200	13,548.00	0.03
234	002559	亚威股份	1,500	13,455.00	0.03
235	300360	炬华科技	800	13,416.00	0.03
236	002255	海陆重工	2,400	13,344.00	0.03
237	600168	武汉控股	3,000	13,290.00	0.03
238	002103	广博股份	1,400	13,230.00	0.03
239	301017	漱玉平民	1,100	13,145.00	0.03
240	002790	瑞尔特	1,800	13,140.00	0.03
241	300065	海兰信	1,600	13,120.00	0.03
242	301198	喜悦智行	1,200	13,104.00	0.03
243	300404	博济医药	1,500	13,095.00	0.03
244	301292	海科新源	1,000	13,080.00	0.03
245	300819	聚杰微纤	1,000	13,000.00	0.03
246	300514	友讯达	900	12,996.00	0.03
247	301227	森鹰窗业	800	12,960.00	0.03
248	605136	丽人丽妆	1,500	12,945.00	0.03
249	600425	青松建化	3,300	12,936.00	0.03
250	603609	禾丰股份	1,500	12,930.00	0.03
251	688373	盟科药业	2,599	12,839.06	0.03
252	301161	唯万密封	600	12,822.00	0.03
253	002088	鲁阳节能	1,000	12,790.00	0.03
254	002187	广百股份	1,800	12,744.00	0.03
255	002573	清新环境	3,200	12,736.00	0.03
256	600111	北方稀土	600	12,732.00	0.03
257	003025	思进智能	900	12,681.00	0.03
258	601988	中国银行	2,300	12,673.00	0.03
259	601007	金陵饭店	1,800	12,618.00	0.03
260	002916	深南电路	100	12,500.00	0.03
261	688398	赛特新材	927	12,495.96	0.03
262	002206	海利得	2,900	12,441.00	0.02

263	002189	中光学	600	12,348.00	0.02
264	300512	中亚股份	1,800	12,258.00	0.02
265	301419	阿莱德	400	12,076.00	0.02
266	603151	邦基科技	1,200	12,012.00	0.02
267	601818	光大银行	3,100	11,997.00	0.02
268	600230	沧州大化	1,100	11,792.00	0.02
269	002825	纳尔股份	1,500	11,730.00	0.02
270	300352	北信源	2,200	11,616.00	0.02
271	300628	亿联网络	300	11,580.00	0.02
272	605003	众望布艺	600	11,340.00	0.02
273	300659	中孚信息	700	11,333.00	0.02
274	001965	招商公路	800	11,160.00	0.02
275	000100	TCL 科技	2,200	11,066.00	0.02
276	600790	轻纺城	2,900	10,875.00	0.02
277	002533	金杯电工	1,100	10,824.00	0.02
278	688283	坤恒顺维	438	10,783.56	0.02
279	605123	派克新材	200	10,752.00	0.02
280	301168	通灵股份	400	10,732.00	0.02
281	601187	厦门银行	1,900	10,716.00	0.02
282	688073	毕得医药	216	10,618.56	0.02
283	603102	百合股份	300	10,530.00	0.02
284	600057	厦门象屿	1,600	10,384.00	0.02
285	002297	博云新材	1,500	10,320.00	0.02
286	300759	康龙化成	400	10,280.00	0.02
287	300816	艾可蓝	400	10,260.00	0.02
288	600662	外服控股	2,000	10,140.00	0.02
289	688418	震有科技	347	10,118.52	0.02
290	002911	佛燃能源	800	10,112.00	0.02
291	002007	华兰生物	600	10,110.00	0.02
292	603103	横店影视	700	10,073.00	0.02
293	001234	泰慕士	600	10,062.00	0.02
294	688560	明冠新材	785	10,040.15	0.02
295	605289	罗曼股份	400	10,024.00	0.02
296	600510	黑牡丹	2,100	10,017.00	0.02
297	300610	晨化股份	1,000	10,000.00	0.02
298	000968	蓝焰控股	1,500	9,975.00	0.02
299	002233	塔牌集团	1,300	9,971.00	0.02
300	601333	广深铁路	2,900	9,947.00	0.02
301	002225	濮耐股份	2,000	9,940.00	0.02
302	002550	千红制药	1,600	9,920.00	0.02
303	000713	丰乐种业	1,400	9,870.00	0.02
304	301152	天力锂能	300	9,855.00	0.02
305	688168	安博通	252	9,853.20	0.02

306	601169	北京银行	1,600	9,840.00	0.02
307	600019	宝钢股份	1,400	9,800.00	0.02
307	603565	中谷物流	1,000	9,800.00	0.02
308	688176	亚虹医药	1,442	9,791.18	0.02
309	603216	梦天家居	900	9,774.00	0.02
310	300115	长盈精密	600	9,744.00	0.02
311	688480	赛恩斯	358	9,716.12	0.02
312	301221	光庭信息	200	9,716.00	0.02
313	603158	腾龙股份	1,200	9,696.00	0.02
314	600429	三元股份	2,200	9,680.00	0.02
315	688101	三达膜	738	9,660.42	0.02
316	000166	申万宏源	1,800	9,630.00	0.02
316	601828	美凯龙	3,000	9,630.00	0.02
317	603309	维力医疗	800	9,584.00	0.02
318	688626	翔宇医疗	326	9,581.14	0.02
319	605166	聚合顺	800	9,576.00	0.02
320	603066	音飞储存	900	9,567.00	0.02
321	600269	赣粤高速	1,700	9,537.00	0.02
322	300168	万达信息	1,200	9,528.00	0.02
322	300389	艾比森	800	9,528.00	0.02
323	300910	瑞丰新材	200	9,518.00	0.02
324	001222	源飞宠物	600	9,498.00	0.02
325	603505	金石资源	400	9,496.00	0.02
326	603096	新经典	500	9,475.00	0.02
327	300451	创业慧康	2,100	9,408.00	0.02
327	300664	鹏鹞环保	1,600	9,408.00	0.02
328	688580	伟思医疗	337	9,405.67	0.02
329	600284	浦东建设	1,500	9,405.00	0.02
330	688133	泰坦科技	515	9,393.60	0.02
331	601377	兴业证券	1,500	9,390.00	0.02
332	002252	上海莱士	1,300	9,386.00	0.02
332	601728	中国电信	1,300	9,386.00	0.02
333	002163	海南发展	1,000	9,350.00	0.02
334	301112	信邦智能	400	9,348.00	0.02
335	300369	绿盟科技	1,300	9,347.00	0.02
336	600200	江苏吴中	1,000	9,320.00	0.02
337	000676	智度股份	1,100	9,306.00	0.02
337	002672	东江环保	2,200	9,306.00	0.02
338	300772	运达股份	700	9,268.00	0.02
339	300092	科新机电	800	9,232.00	0.02
340	603182	嘉华股份	800	9,208.00	0.02
341	688663	新风光	424	9,205.04	0.02
342	601996	丰林集团	4,300	9,202.00	0.02

343	300041	回天新材	1,000	9,200.00	0.02
344	300887	谱尼测试	1,200	9,168.00	0.02
345	688228	开普云	205	9,134.80	0.02
346	002799	环球印务	1,200	9,096.00	0.02
347	605599	莱百股份	800	9,080.00	0.02
348	600229	城市传媒	1,300	9,061.00	0.02
349	603232	格尔软件	700	9,016.00	0.02
350	002810	山东赫达	700	8,995.00	0.02
351	300494	盛天网络	800	8,992.00	0.02
352	688125	安达智能	230	8,986.10	0.02
353	000848	承德露露	1,000	8,970.00	0.02
354	300719	安达维尔	500	8,955.00	0.02
355	600037	歌华有线	1,200	8,952.00	0.02
356	688292	浩瀚深度	452	8,949.60	0.02
357	601857	中国石油	1,000	8,940.00	0.02
358	002599	盛通股份	1,200	8,916.00	0.02
359	688435	英方软件	295	8,903.10	0.02
360	002167	东方锆业	1,200	8,808.00	0.02
361	002793	罗欣药业	2,300	8,786.00	0.02
362	600641	万业企业	600	8,772.00	0.02
363	301102	兆讯传媒	800	8,744.00	0.02
364	300329	海伦钢琴	1,700	8,738.00	0.02
365	600803	新奥股份	400	8,672.00	0.02
366	688382	益方生物	651	8,658.30	0.02
367	300365	恒华科技	1,400	8,596.00	0.02
368	002196	方正电机	1,600	8,576.00	0.02
369	000828	东莞控股	800	8,552.00	0.02
370	002301	齐心集团	1,200	8,532.00	0.02
371	002583	海能达	600	8,526.00	0.02
372	300920	润阳科技	500	8,460.00	0.02
373	300438	鹏辉能源	300	8,433.00	0.02
374	688021	奥福环保	805	8,404.20	0.02
375	002229	鸿博股份	700	8,393.00	0.02
376	300643	万通智控	700	8,372.00	0.02
377	002084	海鸥住工	2,900	8,352.00	0.02
377	603280	南方路机	400	8,352.00	0.02
378	300800	力合科技	800	8,344.00	0.02
379	300952	恒辉安防	400	8,332.00	0.02
380	002110	三钢闽光	2,500	8,300.00	0.02
380	002859	洁美科技	400	8,300.00	0.02
381	301066	万事利	600	8,286.00	0.02
382	003043	华亚智能	200	8,280.00	0.02
383	603916	苏博特	1,100	8,206.00	0.02



384	002645	华宏科技	1,200	8,184.00	0.02
385	301276	嘉曼服饰	400	8,140.00	0.02
386	300638	广和通	400	8,060.00	0.02
387	603863	松炆资源	400	8,044.00	0.02
388	002469	三维化学	1,100	8,030.00	0.02
389	600308	华泰股份	2,200	8,008.00	0.02
390	002305	南国置业	4,000	7,960.00	0.02
391	603258	电魂网络	400	7,956.00	0.02
392	001360	南矿集团	600	7,920.00	0.02
393	601077	渝农商行	1,300	7,865.00	0.02
394	002194	武汉凡谷	700	7,854.00	0.02
395	001236	弘业期货	800	7,712.00	0.02
396	002912	中新赛克	300	7,677.00	0.02
397	003019	宸展光电	300	7,674.00	0.02
397	605007	五洲特纸	600	7,674.00	0.02
398	603825	华扬联众	500	7,545.00	0.02
399	300571	平治信息	300	7,524.00	0.02
400	301220	亚香股份	200	7,404.00	0.01
401	002657	中科金财	400	7,328.00	0.01
402	688244	永信至诚	285	7,296.00	0.01
403	002483	润邦股份	1,400	7,294.00	0.01
404	688716	中研股份	200	7,270.00	0.01
405	603186	华正新材	300	7,227.00	0.01
406	601003	柳钢股份	2,600	7,176.00	0.01
407	600908	无锡银行	1,200	7,092.00	0.01
408	300832	新产业	100	7,085.00	0.01
409	301314	科瑞思	200	7,050.00	0.01
410	600016	民生银行	1,700	7,021.00	0.01
411	000789	万年青	1,400	7,014.00	0.01
412	000531	穗恒运 A	1,200	6,912.00	0.01
413	002448	中原内配	1,100	6,886.00	0.01
414	002136	安纳达	700	6,825.00	0.01
415	603136	天目湖	600	6,780.00	0.01
416	688001	华兴源创	250	6,775.00	0.01
417	001326	联域股份	200	6,756.00	0.01
418	300725	药石科技	200	6,720.00	0.01
419	002314	南山控股	2,800	6,664.00	0.01
420	301193	家联科技	400	6,612.00	0.01
421	688323	瑞华泰	532	6,538.28	0.01
422	300848	美瑞新材	400	6,500.00	0.01
423	603558	健盛集团	600	6,456.00	0.01
424	603982	泉峰汽车	800	6,368.00	0.01
425	002824	和胜股份	400	6,280.00	0.01

426	688056	莱伯泰科	214	6,240.24	0.01
427	688551	科威尔	219	6,129.81	0.01
428	300596	利安隆	200	6,100.00	0.01
429	600371	万向德农	700	6,041.00	0.01
430	600887	伊利股份	200	6,036.00	0.01
431	688206	概伦电子	313	5,918.83	0.01
432	002983	芯瑞达	300	5,892.00	0.01
433	603799	华友钴业	200	5,852.00	0.01
434	300230	永利股份	1,300	5,785.00	0.01
435	688136	科兴制药	264	5,771.04	0.01
436	001368	通达创智	300	5,658.00	0.01
437	600573	惠泉啤酒	500	5,630.00	0.01
438	600684	珠江股份	1,700	5,610.00	0.01
439	600259	广晟有色	200	5,562.00	0.01
440	000930	中粮科技	1,000	5,550.00	0.01
441	603788	宁波高发	400	5,532.00	0.01
442	603068	博通集成	200	5,530.00	0.01
443	000503	国新健康	500	5,490.00	0.01
444	300347	泰格医药	100	5,462.00	0.01
445	603755	日辰股份	200	5,420.00	0.01
446	300413	芒果超媒	200	5,378.00	0.01
447	301155	海力风电	100	5,331.00	0.01
448	002127	南极电商	1,200	5,280.00	0.01
449	002302	西部建设	800	5,264.00	0.01
450	001366	播恩集团	500	5,235.00	0.01
451	300332	天壕能源	900	5,211.00	0.01
452	600006	东风股份	700	5,159.00	0.01
453	002915	中欣氟材	400	5,112.00	0.01
454	601825	沪农商行	600	5,106.00	0.01
455	001389	广合科技	100	5,030.00	0.01
456	603229	奥翔药业	500	4,995.00	0.01
457	600461	洪城环境	500	4,975.00	0.01
458	601117	中国化学	600	4,974.00	0.01
459	688586	江航装备	519	4,966.83	0.01
460	001206	依依股份	300	4,959.00	0.01
461	601916	浙商银行	1,700	4,947.00	0.01
462	688033	天宜上佳	859	4,939.25	0.01
463	000690	宝新能源	1,100	4,928.00	0.01
464	601200	上海环境	600	4,902.00	0.01
465	601121	宝地矿业	700	4,900.00	0.01
466	600018	上港集团	800	4,896.00	0.01
467	601998	中信银行	700	4,886.00	0.01
468	688659	元琛科技	723	4,880.25	0.01

469	600717	天津港	1,000	4,870.00	0.01
470	600409	三友化工	900	4,860.00	0.01
470	600507	方大特钢	1,200	4,860.00	0.01
470	603365	水星家纺	300	4,860.00	0.01
471	600810	神马股份	600	4,854.00	0.01
472	688345	博力威	267	4,851.39	0.01
473	600160	巨化股份	200	4,824.00	0.01
474	603051	鹿山新材	200	4,822.00	0.01
475	600183	生益科技	200	4,810.00	0.01
476	600984	建设机械	1,500	4,785.00	0.01
477	600273	嘉化能源	600	4,782.00	0.01
478	002917	金奥博	500	4,780.00	0.01
479	600050	中国联通	900	4,779.00	0.01
480	605008	长鸿高科	400	4,776.00	0.01
481	688737	中自科技	268	4,773.08	0.01
482	002401	中远海科	300	4,764.00	0.01
483	301093	华兰股份	200	4,760.00	0.01
484	002060	广东建工	1,300	4,758.00	0.01
485	603508	思维列控	200	4,756.00	0.01
486	601811	新华文轩	300	4,755.00	0.01
487	601006	大秦铁路	700	4,746.00	0.01
488	002873	新天药业	500	4,735.00	0.01
489	600997	开滦股份	700	4,732.00	0.01
490	603313	梦百合	700	4,725.00	0.01
491	600323	瀚蓝环境	200	4,724.00	0.01
492	603588	高能环境	900	4,716.00	0.01
493	600320	振华重工	1,200	4,704.00	0.01
494	000420	吉林化纤	1,300	4,693.00	0.01
495	000550	江铃汽车	200	4,690.00	0.01
496	601877	正泰电器	200	4,682.00	0.01
497	300034	钢研高纳	300	4,680.00	0.01
497	600728	佳都科技	1,000	4,680.00	0.01
498	603536	惠发食品	400	4,672.00	0.01
499	000735	罗牛山	700	4,662.00	0.01
500	300696	爱乐达	300	4,659.00	0.01
501	002284	亚太股份	600	4,644.00	0.01
502	603277	银都股份	200	4,634.00	0.01
503	002536	飞龙股份	400	4,632.00	0.01
504	002382	蓝帆医疗	900	4,617.00	0.01
505	002768	国恩股份	200	4,614.00	0.01
506	002606	大连电瓷	500	4,610.00	0.01
507	000650	仁和药业	800	4,608.00	0.01
507	002063	远光软件	800	4,608.00	0.01

508	600377	宁沪高速	300	4,593.00	0.01
509	601028	玉龙股份	400	4,584.00	0.01
510	605368	蓝天燃气	400	4,572.00	0.01
511	600552	凯盛科技	400	4,564.00	0.01
512	002516	旷达科技	900	4,563.00	0.01
513	300063	天龙集团	500	4,560.00	0.01
514	601298	青岛港	500	4,555.00	0.01
515	300094	国联水产	1,200	4,548.00	0.01
516	000822	山东海化	800	4,544.00	0.01
517	000589	贵州轮胎	900	4,527.00	0.01
518	002493	荣盛石化	500	4,525.00	0.01
518	603088	宁波精达	500	4,525.00	0.01
519	605337	李子园	400	4,516.00	0.01
520	600475	华光环能	500	4,505.00	0.01
520	603105	芯能科技	500	4,505.00	0.01
521	603128	华贸物流	700	4,501.00	0.01
522	688178	万德斯	360	4,496.40	0.01
523	000612	焦作万方	700	4,494.00	0.01
524	002219	新里程	1,700	4,488.00	0.01
524	600027	华电国际	800	4,488.00	0.01
525	000877	天山股份	792	4,482.72	0.01
526	600787	中储股份	700	4,466.00	0.01
527	600105	永鼎股份	900	4,464.00	0.01
528	002752	昇兴股份	700	4,445.00	0.01
529	301526	国际复材	1,200	4,440.00	0.01
530	601579	会稽山	400	4,424.00	0.01
531	603908	牧高笛	200	4,420.00	0.01
532	002291	遥望科技	700	4,417.00	0.01
533	002154	报喜鸟	1,000	4,410.00	0.01
534	300315	掌趣科技	800	4,400.00	0.01
534	601136	首创证券	200	4,400.00	0.01
535	300397	天和防务	400	4,396.00	0.01
535	301322	绿通科技	200	4,396.00	0.01
536	002001	新和成	200	4,394.00	0.01
537	300587	天铁科技	1,000	4,390.00	0.01
538	300299	富春股份	800	4,376.00	0.01
539	300393	中来股份	700	4,375.00	0.01
540	301003	江苏博云	200	4,366.00	0.01
541	002106	莱宝高科	400	4,364.00	0.01
542	601886	江河集团	800	4,320.00	0.01
543	601699	潞安环能	300	4,308.00	0.01
544	600756	浪潮软件	300	4,299.00	0.01
544	601058	赛轮轮胎	300	4,299.00	0.01

545	601827	三峰环境	500	4,290.00	0.01
546	688558	国盛智科	200	4,270.00	0.01
547	600338	西藏珠峰	400	4,268.00	0.01
548	002208	合肥城建	600	4,266.00	0.01
548	002749	国光股份	300	4,266.00	0.01
549	002695	煌上煌	500	4,265.00	0.01
550	300653	正海生物	200	4,260.00	0.01
551	002003	伟星股份	300	4,251.00	0.01
552	301386	未来电器	200	4,218.00	0.01
552	600686	金龙汽车	300	4,218.00	0.01
553	605099	共创草坪	200	4,196.00	0.01
554	001210	金房能源	300	4,191.00	0.01
555	000923	河钢资源	300	4,170.00	0.01
556	300918	南山智尚	400	4,124.00	0.01
557	000962	东方钨业	300	4,110.00	0.01
557	603011	合锻智能	600	4,110.00	0.01
558	000301	东方盛虹	500	4,105.00	0.01
558	603018	华设集团	500	4,105.00	0.01
559	600161	天坛生物	200	4,100.00	0.01
560	300007	汉威科技	200	4,090.00	0.01
561	688369	致远互联	200	4,014.00	0.01
562	300406	九强生物	300	4,008.00	0.01
563	300795	米奥会展	200	4,002.00	0.01
564	002400	省广集团	500	3,995.00	0.01
565	301323	新莱福	100	3,987.00	0.01
566	300443	金雷股份	200	3,984.00	0.01
567	000888	峨眉山 A	300	3,969.00	0.01
568	002943	宇晶股份	200	3,968.00	0.01
569	603619	中曼石油	200	3,872.00	0.01
570	688599	天合光能	200	3,860.00	0.01
571	300408	三环集团	100	3,851.00	0.01
572	300085	银之杰	100	3,825.00	0.01
573	603538	美诺华	300	3,813.00	0.01
574	603033	三维股份	300	3,807.00	0.01
575	002428	云南锗业	200	3,780.00	0.01
576	301391	卡莱特	100	3,701.00	0.01
577	300572	安车检测	200	3,614.00	0.01
578	002389	航天彩虹	200	3,610.00	0.01
579	002234	民和股份	400	3,556.00	0.01
580	600741	华域汽车	200	3,522.00	0.01
581	001332	锡装股份	100	3,492.00	0.01
582	600433	冠豪高新	1,100	3,487.00	0.01
583	601968	宝钢包装	700	3,465.00	0.01

584	300552	万集科技	100	3,435.00	0.01
585	300594	朗进科技	200	3,428.00	0.01
586	600009	上海机场	100	3,415.00	0.01
587	603215	比依股份	200	3,404.00	0.01
588	600315	上海家化	200	3,382.00	0.01
588	603201	常润股份	200	3,382.00	0.01
589	601226	华电科工	500	3,380.00	0.01
590	688355	明志科技	200	3,350.00	0.01
591	603358	华达科技	100	3,340.00	0.01
592	603127	昭衍新药	200	3,326.00	0.01
593	600267	海正药业	400	3,320.00	0.01
594	603289	泰瑞机器	400	3,300.00	0.01
595	688472	阿特斯	262	3,290.72	0.01
596	300978	东箭科技	300	3,267.00	0.01
597	000402	金融街	1,000	3,260.00	0.01
597	300468	四方精创	200	3,260.00	0.01
598	300445	康斯特	200	3,254.00	0.01
599	300068	南都电源	200	3,228.00	0.01
600	603983	丸美生物	100	3,226.00	0.01
601	688203	海正生材	327	3,184.98	0.01
602	688022	瀚川智能	289	3,167.44	0.01
603	688030	山石网科	200	3,100.00	0.01
604	002387	维信诺	300	3,084.00	0.01
605	002540	亚太科技	500	3,080.00	0.01
605	002641	公元股份	700	3,080.00	0.01
606	688658	悦康药业	204	2,939.64	0.01
607	000028	国药一致	100	2,925.00	0.01
608	603282	亚光股份	200	2,924.00	0.01
609	688395	正弦电气	168	2,854.32	0.01
610	002978	安宁股份	100	2,842.00	0.01
610	600332	白云山	100	2,842.00	0.01
611	605305	中际联合	100	2,833.00	0.01
612	601229	上海银行	300	2,745.00	0.01
613	301108	洁雅股份	100	2,575.00	0.01
614	605088	冠盛股份	100	2,508.00	0.01
615	688767	博拓生物	75	2,477.25	0.00
616	000560	我爱我家	800	2,440.00	0.00
617	002334	英威腾	300	2,256.00	0.00
618	600708	光明地产	500	1,860.00	0.00
619	603798	康普顿	200	1,766.00	0.00
620	600597	光明乳业	200	1,708.00	0.00
621	601163	三角轮胎	100	1,507.00	0.00
622	002616	长青集团	300	1,434.00	0.00

623	688143	长盈通	58	1,277.16	0.00
624	600388	龙净环保	100	1,265.00	0.00
625	000501	武商集团	100	1,046.00	0.00
626	603518	锦泓集团	100	980.00	0.00
627	002651	利君股份	100	733.00	0.00
628	003012	东鹏控股	100	661.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002532	天山铝业	3,304,624.00	6.09
2	600282	南钢股份	3,152,182.00	5.81
3	000723	美锦能源	3,070,204.00	5.66
4	603786	科博达	3,012,263.00	5.55
5	603156	养元饮品	2,963,624.80	5.46
6	601168	西部矿业	2,830,935.00	5.22
7	000629	钒钛股份	2,743,020.00	5.05
8	601666	平煤股份	2,741,600.00	5.05
9	002273	水晶光电	2,730,579.00	5.03
10	002064	华峰化学	2,725,942.00	5.02
11	688276	百克生物	2,705,959.43	4.99
12	002028	思源电气	2,700,537.00	4.98
13	600968	海油发展	2,696,082.00	4.97
14	600885	宏发股份	2,661,062.80	4.90
15	600516	方大炭素	2,631,218.46	4.85
16	002966	苏州银行	2,613,913.00	4.82
17	601611	中国核建	2,544,970.00	4.69
18	600901	江苏金租	2,516,402.20	4.64
19	603160	汇顶科技	2,474,967.00	4.56
20	002128	电投能源	2,462,847.00	4.54
21	600998	九州通	2,440,575.60	4.50
22	300383	光环新网	2,434,488.00	4.49
23	600062	华润双鹤	2,422,306.00	4.46
24	601000	唐山港	2,420,314.90	4.46
25	600737	中粮糖业	2,418,795.00	4.46
26	002408	齐翔腾达	2,386,767.40	4.40
27	000636	风华高科	2,351,087.00	4.33
28	002683	广东宏大	2,351,074.76	4.33
29	600153	建发股份	2,347,460.00	4.33
30	600863	内蒙华电	2,342,781.00	4.32
31	002185	华天科技	2,281,631.00	4.20
32	600848	上海临港	2,275,240.00	4.19

33	600655	豫园股份	2,274,115.01	4.19
34	601991	大唐发电	2,272,368.00	4.19
35	601958	金钼股份	2,262,312.00	4.17
36	002429	兆驰股份	2,259,745.00	4.16
37	688063	派能科技	2,247,406.98	4.14
38	600546	山煤国际	2,235,904.00	4.12
39	601577	长沙银行	2,227,739.00	4.10
40	600392	盛和资源	2,226,046.00	4.10
41	600820	隧道股份	2,223,471.00	4.10
42	000423	东阿阿胶	2,217,532.00	4.09
43	002340	格林美	2,203,874.00	4.06
44	002414	高德红外	2,201,394.50	4.06
45	601118	海南橡胶	2,187,890.00	4.03
46	600884	杉杉股份	2,187,319.00	4.03
47	000778	新兴铸管	2,185,927.00	4.03
48	601128	常熟银行	2,177,869.00	4.01
49	000401	冀东水泥	2,170,894.00	4.00
50	000563	陕国投 A	2,169,322.00	4.00
51	600066	宇通客车	2,167,399.00	3.99
52	601568	北元集团	2,166,609.00	3.99
53	600862	中航高科	2,162,785.00	3.99
54	600126	杭钢股份	2,153,318.00	3.97
55	600970	中材国际	2,149,203.00	3.96
56	600755	厦门国贸	2,149,101.99	3.96
57	000703	恒逸石化	2,143,627.00	3.95
58	002595	豪迈科技	2,141,405.00	3.95
59	603568	伟明环保	2,117,026.00	3.90
60	600583	海油工程	2,111,942.00	3.89
61	601098	中南传媒	2,108,117.00	3.88
62	002432	九安医疗	2,102,470.00	3.87
63	002266	浙富控股	2,084,676.00	3.84
64	000591	太阳能	2,075,508.00	3.82
65	601216	君正集团	2,074,757.00	3.82
66	000683	远兴能源	2,072,650.00	3.82
67	000825	太钢不锈	2,069,922.00	3.81
68	600398	海澜之家	2,052,215.99	3.78
69	002497	雅化集团	2,041,004.00	3.76
70	000883	湖北能源	2,040,183.00	3.76
71	600704	物产中大	2,034,146.00	3.75
72	600143	金发科技	2,018,032.00	3.72
73	000933	神火股份	2,005,558.00	3.70
74	600985	淮北矿业	2,002,675.00	3.69
75	600529	山东药玻	1,990,859.00	3.67



76	688107	安路科技	1,986,057.80	3.66
77	000060	中金岭南	1,979,482.00	3.65
78	000785	居然智家	1,979,358.00	3.65
79	601866	中远海发	1,976,744.00	3.64
80	003035	南网能源	1,971,037.00	3.63
81	002152	广电运通	1,967,262.00	3.63
82	600352	浙江龙盛	1,965,340.00	3.62
83	000959	首钢股份	1,958,923.00	3.61
84	002500	山西证券	1,958,302.00	3.61
85	601077	渝农商行	1,955,598.91	3.60
86	601997	贵阳银行	1,955,490.00	3.60
87	600566	济川药业	1,950,808.00	3.59
88	600350	山东高速	1,943,127.00	3.58
89	000039	中集集团	1,932,436.00	3.56
90	600177	雅戈尔	1,929,642.00	3.56
91	688819	天能股份	1,927,463.42	3.55
92	000738	航发控制	1,926,875.00	3.55
93	000932	华菱钢铁	1,920,872.00	3.54
94	688536	思瑞浦	1,916,044.91	3.53
95	000830	鲁西化工	1,914,364.00	3.53
96	002120	韵达股份	1,912,393.00	3.52
97	688153	唯捷创芯	1,894,096.63	3.49
98	600096	云天化	1,890,648.00	3.48
99	601555	东吴证券	1,889,534.00	3.48
100	600170	上海建工	1,888,648.00	3.48
101	688520	神州细胞	1,886,060.59	3.48
102	600299	安迪苏	1,881,607.00	3.47
103	000513	丽珠集团	1,861,478.55	3.43
104	000728	国元证券	1,850,914.00	3.41
105	002558	巨人网络	1,848,090.00	3.41
106	002385	大北农	1,847,472.00	3.40
107	601058	赛轮轮胎	1,847,460.00	3.40
108	300866	安克创新	1,843,449.00	3.40
109	003022	联泓新科	1,843,028.00	3.40
110	600909	华安证券	1,827,728.00	3.37
111	300144	宋城演艺	1,826,163.00	3.37
112	002867	周大生	1,816,921.00	3.35
113	002739	万达电影	1,814,937.00	3.34
114	300296	利亚德	1,814,165.00	3.34
115	600521	华海药业	1,813,831.00	3.34
116	002958	青农商行	1,811,882.00	3.34
117	002831	裕同科技	1,811,772.00	3.34
118	601598	中国外运	1,808,871.00	3.33

119	600109	国金证券	1,803,786.00	3.32
120	600339	中油工程	1,799,302.00	3.32
121	600928	西安银行	1,795,438.00	3.31
122	002008	大族激光	1,793,839.00	3.31
123	600416	湘电股份	1,792,528.00	3.30
124	002797	第一创业	1,783,327.00	3.29
125	002203	海亮股份	1,780,843.00	3.28
126	001203	大中矿业	1,779,454.00	3.28
127	600764	中国海防	1,777,428.00	3.28
128	300251	光线传媒	1,777,286.00	3.27
129	601717	郑煤机	1,770,854.00	3.26
130	000519	中兵红箭	1,770,134.00	3.26
131	601108	财通证券	1,765,958.00	3.25
132	002138	顺络电子	1,764,708.00	3.25
133	000750	国海证券	1,764,576.00	3.25
134	002268	电科网安	1,764,467.00	3.25
135	688538	和辉光电	1,764,293.36	3.25
136	601139	深圳燃气	1,763,173.00	3.25
137	600801	华新水泥	1,757,938.00	3.24
138	601298	青岛港	1,754,434.00	3.23
139	688567	孚能科技	1,753,033.37	3.23
140	603858	步长制药	1,752,937.00	3.23
141	002019	亿帆医药	1,751,873.00	3.23
142	601828	美凯龙	1,750,876.00	3.23
143	002195	岩山科技	1,749,163.00	3.22
144	002563	森马服饰	1,748,186.00	3.22
145	000559	万向钱潮	1,748,082.00	3.22
146	002294	信立泰	1,742,187.00	3.21
147	002155	湖南黄金	1,738,759.00	3.20
148	600827	百联股份	1,729,649.00	3.19
149	601990	南京证券	1,727,667.00	3.18
150	000031	大悦城	1,726,537.00	3.18
151	600642	申能股份	1,725,274.00	3.18
152	000783	长江证券	1,721,413.00	3.17
153	600271	航天信息	1,720,535.00	3.17
154	000937	冀中能源	1,720,354.00	3.17
155	000878	云南铜业	1,717,684.00	3.17
156	601636	旗滨集团	1,717,053.00	3.16
157	600500	中化国际	1,712,434.00	3.16
158	600528	中铁工业	1,711,758.00	3.15
159	000729	燕京啤酒	1,709,953.00	3.15
160	600517	国网英大	1,709,458.00	3.15
161	600707	彩虹股份	1,708,874.00	3.15

162	300003	乐普医疗	1,703,905.00	3.14
163	000739	普洛药业	1,696,566.00	3.13
164	600399	抚顺特钢	1,694,820.00	3.12
165	002690	美亚光电	1,691,587.70	3.12
166	601928	凤凰传媒	1,688,717.00	3.11
167	600839	四川长虹	1,685,555.00	3.11
168	000539	粤电力 A	1,685,441.00	3.11
169	000027	深圳能源	1,679,400.00	3.09
170	000960	锡业股份	1,676,354.00	3.09
171	688169	石头科技	1,669,579.94	3.08
172	000050	深天马 A	1,667,787.16	3.07
173	600871	石化油服	1,663,853.00	3.07
174	002080	中材科技	1,655,396.00	3.05
175	600377	宁沪高速	1,651,686.00	3.04
176	688122	西部超导	1,651,108.90	3.04
177	600535	天士力	1,646,454.00	3.03
178	600867	通化东宝	1,645,802.00	3.03
179	300009	安科生物	1,645,512.00	3.03
180	300390	天华新能	1,636,559.00	3.02
181	601228	广州港	1,634,395.00	3.01
182	002384	东山精密	1,630,864.00	3.01
183	688099	晶晨股份	1,629,422.18	3.00
184	002939	长城证券	1,621,444.00	2.99
185	600497	驰宏锌锗	1,619,135.00	2.98
186	002430	杭氧股份	1,617,099.00	2.98
187	601233	桐昆股份	1,613,800.00	2.97
188	600582	天地科技	1,608,262.00	2.96
189	600166	福田汽车	1,607,368.00	2.96
190	603218	日月股份	1,604,911.60	2.96
191	002202	金风科技	1,598,680.00	2.95
192	601158	重庆水务	1,595,901.00	2.94
193	002926	华西证券	1,576,448.00	2.90
194	600967	内蒙一机	1,569,753.00	2.89
195	601608	中信重工	1,568,729.00	2.89
196	601665	齐鲁银行	1,565,140.00	2.88
197	600598	北大荒	1,564,765.00	2.88
198	601933	永辉超市	1,561,945.00	2.88
199	600008	首创环保	1,554,905.00	2.87
200	603225	新凤鸣	1,554,138.48	2.86
201	605358	立昂微	1,552,751.00	2.86
202	600348	华阳股份	1,549,217.00	2.85
203	002531	天顺风能	1,547,739.00	2.85
204	000623	吉林敖东	1,539,290.28	2.84

205	600959	江苏有线	1,538,080.00	2.83
206	002223	鱼跃医疗	1,537,153.00	2.83
207	000958	电投产融	1,535,329.00	2.83
208	300888	稳健医疗	1,533,827.00	2.83
209	603893	瑞芯微	1,531,269.00	2.82
210	001872	招商港口	1,515,749.00	2.79
211	603317	天味食品	1,505,901.00	2.77
212	002444	巨星科技	1,493,429.00	2.75
213	600988	赤峰黄金	1,492,251.00	2.75
214	600873	梅花生物	1,483,263.00	2.73
215	601106	中国一重	1,480,020.00	2.73
216	600373	中文传媒	1,479,626.00	2.73
217	600663	陆家嘴	1,475,146.00	2.72
218	688425	铁建重工	1,473,606.11	2.72
219	300088	长信科技	1,471,876.00	2.71
220	600637	东方明珠	1,468,611.00	2.71
221	600673	东阳光	1,466,288.00	2.70
222	002608	江苏国信	1,465,219.00	2.70
223	300070	碧水源	1,462,892.00	2.70
224	603927	中科软	1,461,204.20	2.69
225	300212	易华录	1,461,068.00	2.69
226	002065	东华软件	1,459,266.00	2.69
227	600329	达仁堂	1,457,233.00	2.69
228	688295	中复神鹰	1,455,668.41	2.68
229	300474	景嘉微	1,451,893.00	2.68
230	600060	海信视像	1,450,248.00	2.67
231	002465	海格通信	1,448,972.00	2.67
232	002353	杰瑞股份	1,446,148.00	2.66
233	000898	鞍钢股份	1,444,040.00	2.66
234	600369	西南证券	1,443,538.00	2.66
235	600390	五矿资本	1,440,165.00	2.65
236	600879	航天电子	1,434,622.00	2.64
237	600378	昊华科技	1,431,889.00	2.64
238	002044	美年健康	1,428,066.00	2.63
239	000967	盈峰环境	1,427,878.00	2.63
240	603650	彤程新材	1,426,531.00	2.63
241	002078	太阳纸业	1,423,217.00	2.62
242	300601	康泰生物	1,421,281.00	2.62
243	002625	光启技术	1,420,111.00	2.62
244	600511	国药股份	1,418,722.00	2.61
245	000988	华工科技	1,416,410.00	2.61
246	000066	中国长城	1,409,447.00	2.60
247	688188	柏楚电子	1,407,624.84	2.59

248	300146	汤臣倍健	1,398,986.00	2.58
249	002557	洽洽食品	1,393,006.00	2.57
250	600549	厦门钨业	1,390,923.00	2.56
251	603228	景旺电子	1,390,269.00	2.56
252	600925	苏能股份	1,389,814.00	2.56
253	002508	老板电器	1,389,601.00	2.56
254	000021	深科技	1,379,116.00	2.54
255	002153	石基信息	1,376,444.00	2.54
256	600004	白云机场	1,374,663.00	2.53
257	600315	上海家化	1,372,909.00	2.53
258	300394	天孚通信	1,369,907.00	2.52
259	000987	越秀资本	1,369,885.00	2.52
260	002409	雅克科技	1,364,229.00	2.51
261	601198	东兴证券	1,362,618.00	2.51
262	600927	永安期货	1,360,179.00	2.51
263	301236	软通动力	1,356,589.00	2.50
264	601966	玲珑轮胎	1,354,829.00	2.50
265	603589	口子窖	1,352,402.00	2.49
266	000009	中国宝安	1,352,260.00	2.49
267	002507	涪陵榨菜	1,350,398.40	2.49
268	600141	兴发集团	1,347,814.00	2.48
269	002505	鹏都农牧	1,347,734.00	2.48
270	688331	荣昌生物	1,347,573.23	2.48
271	688521	芯原股份	1,342,027.59	2.47
272	000598	兴蓉环境	1,334,836.00	2.46
273	001286	陕西能源	1,329,076.00	2.45
274	601399	国机重装	1,328,487.00	2.45
275	601231	环旭电子	1,323,866.00	2.44
276	300699	光威复材	1,322,445.00	2.44
277	688349	三一重能	1,318,736.32	2.43
278	600498	烽火通信	1,312,473.00	2.42
279	601016	节能风电	1,309,915.00	2.41
280	002373	千方科技	1,309,141.00	2.41
281	603517	绝味食品	1,301,050.00	2.40
282	300677	英科医疗	1,286,252.00	2.37
283	300017	网宿科技	1,279,686.00	2.36
284	600578	京能电力	1,274,460.00	2.35
285	002673	西部证券	1,270,239.00	2.34
286	603606	东方电缆	1,265,638.00	2.33
287	002372	伟星新材	1,262,382.00	2.33
288	688375	国博电子	1,258,779.56	2.32
289	002472	双环传动	1,248,385.98	2.30
290	000630	铜陵有色	1,246,215.00	2.30

291	300207	欣旺达	1,243,154.00	2.29
292	300026	红日药业	1,243,099.00	2.29
293	601179	中国西电	1,242,561.00	2.29
294	603737	三棵树	1,241,882.00	2.29
295	603885	吉祥航空	1,240,555.00	2.29
296	000709	河钢股份	1,233,082.00	2.27
297	603658	安图生物	1,231,963.00	2.27
298	688220	翱捷科技	1,228,670.65	2.26
299	000887	中鼎股份	1,222,166.00	2.25
300	002156	通富微电	1,218,837.00	2.25
301	600765	中航重机	1,218,525.00	2.25
302	601162	天风证券	1,215,284.00	2.24
303	000553	安道麦 A	1,213,446.00	2.24
304	600415	小商品城	1,212,958.00	2.24
305	300595	欧普康视	1,211,640.00	2.23
306	001227	兰州银行	1,210,062.00	2.23
307	603056	德邦股份	1,207,725.00	2.23
308	300502	新易盛	1,207,679.00	2.23
309	601696	中银证券	1,200,705.00	2.21
310	603185	弘元绿能	1,199,015.00	2.21
311	688516	奥特维	1,198,363.31	2.21
312	603939	益丰药房	1,197,804.00	2.21
313	600380	健康元	1,192,124.00	2.20
314	000893	亚钾国际	1,191,720.00	2.20
315	600808	马钢股份	1,183,314.00	2.18
316	600739	辽宁成大	1,182,973.00	2.18
317	002653	海思科	1,173,545.00	2.16
318	002010	传化智联	1,166,482.00	2.15
319	603883	老百姓	1,159,555.00	2.14
320	688778	厦钨新能	1,155,948.59	2.13
321	002439	启明星辰	1,154,014.00	2.13
322	600079	人福医药	1,151,655.00	2.12
323	300373	扬杰科技	1,150,174.00	2.12
324	600258	首旅酒店	1,146,323.00	2.11
325	002299	圣农发展	1,144,381.00	2.11
326	002607	中公教育	1,134,258.00	2.09
327	300529	健帆生物	1,130,237.00	2.08
328	688002	睿创微纳	1,128,041.76	2.08
329	603688	石英股份	1,127,549.00	2.08
330	300861	美畅股份	1,126,982.00	2.08
331	601156	东航物流	1,124,750.00	2.07
332	600486	扬农化工	1,123,372.00	2.07
333	300136	信维通信	1,119,312.00	2.06

334	002738	中矿资源	1, 118, 025. 00	2. 06
335	600161	天坛生物	1, 104, 760. 00	2. 04
336	600906	财达证券	1, 103, 477. 00	2. 03
337	600032	浙江新能	1, 101, 750. 00	2. 03
338	300114	中航电测	1, 097, 474. 00	2. 02
339	688779	五矿新能	1, 094, 737. 79	2. 02
340	300395	菲利华	1, 094, 386. 00	2. 02
341	002056	横店东磁	1, 093, 470. 00	2. 01
342	600418	江淮汽车	1, 088, 628. 00	2. 01
343	603355	莱克电气	1, 087, 353. 00	2. 00
344	603529	爱玛科技	1, 085, 876. 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(%)
1	601168	西部矿业	3, 261, 960. 00	6. 01
2	600282	南钢股份	3, 172, 358. 00	5. 85
3	002532	天山铝业	3, 083, 574. 00	5. 68
4	002028	思源电气	3, 077, 696. 00	5. 67
5	000723	美锦能源	2, 993, 517. 00	5. 52
6	603786	科博达	2, 959, 970. 00	5. 45
7	603156	养元饮品	2, 947, 621. 00	5. 43
8	600998	九州通	2, 757, 049. 00	5. 08
9	688276	百克生物	2, 736, 783. 37	5. 04
10	601000	唐山港	2, 715, 263. 00	5. 00
11	600885	宏发股份	2, 674, 048. 00	4. 93
12	002064	华峰化学	2, 664, 805. 00	4. 91
13	000629	钒钛股份	2, 662, 869. 00	4. 91
14	601611	中国核建	2, 656, 935. 00	4. 90
15	002966	苏州银行	2, 636, 533. 00	4. 86
16	600066	宇通客车	2, 581, 277. 00	4. 76
17	002273	水晶光电	2, 551, 086. 35	4. 70
18	600968	海油发展	2, 543, 116. 00	4. 69
19	600516	方大炭素	2, 530, 710. 00	4. 66
20	600863	内蒙华电	2, 521, 222. 00	4. 65
21	002683	广东宏大	2, 501, 758. 94	4. 61
22	601077	渝农商行	2, 498, 053. 00	4. 60
23	601666	平煤股份	2, 475, 733. 00	4. 56
24	600546	山煤国际	2, 464, 580. 00	4. 54
25	300383	光环新网	2, 405, 368. 00	4. 43

26	600820	隧道股份	2,389,685.00	4.40
27	002595	豪迈科技	2,375,608.00	4.38
28	600901	江苏金租	2,373,353.00	4.37
29	601958	金钼股份	2,372,150.00	4.37
30	002408	齐翔腾达	2,340,384.20	4.31
31	000060	中金岭南	2,316,671.00	4.27
32	603160	汇顶科技	2,302,855.48	4.24
33	601216	君正集团	2,295,866.00	4.23
34	600398	海澜之家	2,295,610.01	4.23
35	688536	思瑞浦	2,294,825.79	4.23
36	000423	东阿阿胶	2,292,964.16	4.23
37	600062	华润双鹤	2,288,001.00	4.22
38	600755	厦门国贸	2,279,422.00	4.20
39	600153	建发股份	2,276,462.00	4.19
40	688107	安路科技	2,274,457.91	4.19
41	601997	贵阳银行	2,266,987.00	4.18
42	600583	海油工程	2,263,632.00	4.17
43	600737	中粮糖业	2,253,019.00	4.15
44	688063	派能科技	2,250,478.48	4.15
45	601555	东吴证券	2,247,009.60	4.14
46	600655	豫园股份	2,239,085.59	4.13
47	600985	淮北矿业	2,230,203.00	4.11
48	000636	风华高科	2,225,140.00	4.10
49	002429	兆驰股份	2,224,674.00	4.10
50	002185	华天科技	2,214,493.00	4.08
51	000785	居然智家	2,212,917.00	4.08
52	000932	华菱钢铁	2,212,265.00	4.08
53	000959	首钢股份	2,208,918.00	4.07
54	600848	上海临港	2,201,718.00	4.06
55	002128	电投能源	2,199,197.00	4.05
56	600884	杉杉股份	2,198,638.92	4.05
57	600177	雅戈尔	2,198,153.76	4.05
58	002414	高德红外	2,197,046.50	4.05
59	601866	中远海发	2,193,265.00	4.04
60	000401	冀东水泥	2,192,646.00	4.04
61	600126	杭钢股份	2,189,276.00	4.03
62	688520	神州细胞	2,185,459.31	4.03
63	601118	海南橡胶	2,152,887.00	3.97
64	600350	山东高速	2,144,036.00	3.95
65	300866	安克创新	2,143,770.00	3.95
66	600970	中材国际	2,139,437.00	3.94
67	601991	大唐发电	2,137,262.00	3.94
68	300296	利亚德	2,129,131.00	3.92



69	000563	陕国投 A	2,126,690.00	3.92
70	601598	中国外运	2,124,775.00	3.92
71	600392	盛和资源	2,124,206.00	3.91
72	000933	神火股份	2,120,784.40	3.91
73	000728	国元证券	2,090,136.00	3.85
74	002558	巨人网络	2,087,713.00	3.85
75	002340	格林美	2,086,108.00	3.84
76	601577	长沙银行	2,074,114.00	3.82
77	600909	华安证券	2,072,876.00	3.82
78	600339	中油工程	2,072,580.00	3.82
79	600862	中航高科	2,068,020.00	3.81
80	300251	光线传媒	2,054,282.00	3.79
81	601128	常熟银行	2,036,527.20	3.75
82	002497	雅化集团	2,033,933.00	3.75
83	000783	长江证券	2,032,702.00	3.75
84	000825	太钢不锈	2,027,495.00	3.74
85	601717	郑煤机	2,018,869.00	3.72
86	000683	远兴能源	2,012,023.00	3.71
87	603568	伟明环保	2,011,908.18	3.71
88	002294	信立泰	2,010,580.00	3.70
89	000591	太阳能	2,006,838.00	3.70
90	600497	驰宏锌锗	2,006,803.00	3.70
91	000750	国海证券	2,004,805.00	3.69
92	000778	新兴铸管	1,998,789.00	3.68
93	000703	恒逸石化	1,997,114.00	3.68
94	002432	九安医疗	1,986,972.99	3.66
95	000031	大悦城	1,979,575.00	3.65
96	601568	北元集团	1,975,992.00	3.64
97	000513	丽珠集团	1,960,780.00	3.61
98	601098	中南传媒	1,955,040.00	3.60
99	688153	唯捷创芯	1,954,224.04	3.60
100	600377	宁沪高速	1,951,646.00	3.60
101	601828	美凯龙	1,945,772.00	3.59
102	002266	浙富控股	1,940,683.00	3.58
103	600348	华阳股份	1,932,664.00	3.56
104	600500	中化国际	1,929,702.00	3.56
105	601298	青岛港	1,927,185.00	3.55
106	600867	通化东宝	1,925,857.00	3.55
107	600642	申能股份	1,925,585.00	3.55
108	002958	青农商行	1,924,686.00	3.55
109	000559	万向钱潮	1,918,054.00	3.53
110	600517	国网英大	1,917,940.00	3.53
111	002797	第一创业	1,916,605.00	3.53

112	601608	中信重工	1,913,858.00	3.53
113	000883	湖北能源	1,906,512.00	3.51
114	002152	广电运通	1,888,122.74	3.48
115	002500	山西证券	1,887,300.00	3.48
116	600143	金发科技	1,884,105.00	3.47
117	003035	南网能源	1,883,390.00	3.47
118	600704	物产中大	1,875,969.00	3.46
119	002430	杭氧股份	1,874,658.00	3.45
120	600373	中文传媒	1,869,898.00	3.45
121	600959	江苏有线	1,868,334.00	3.44
122	600566	济川药业	1,864,720.00	3.44
123	002120	韵达股份	1,856,303.00	3.42
124	600967	内蒙一机	1,855,977.00	3.42
125	003022	联泓新科	1,849,354.00	3.41
126	002563	森马服饰	1,849,203.00	3.41
127	601058	赛轮轮胎	1,848,666.00	3.41
128	002385	大北农	1,847,894.00	3.41
129	601158	重庆水务	1,842,417.00	3.39
130	600170	上海建工	1,842,186.00	3.39
131	000937	冀中能源	1,835,767.00	3.38
132	600598	北大荒	1,833,822.00	3.38
133	000039	中集集团	1,828,891.00	3.37
134	600352	浙江龙盛	1,827,164.00	3.37
135	000830	鲁西化工	1,827,106.00	3.37
136	600416	湘电股份	1,823,159.00	3.36
137	688819	天能股份	1,819,137.04	3.35
138	000958	电投产融	1,813,862.00	3.34
139	600582	天地科技	1,803,397.00	3.32
140	600529	山东药玻	1,796,671.00	3.31
141	002939	长城证券	1,783,152.00	3.29
142	000738	航发控制	1,775,422.00	3.27
143	601665	齐鲁银行	1,772,402.00	3.27
144	000519	中兵红箭	1,765,091.60	3.25
145	603225	新凤鸣	1,753,699.00	3.23
146	600764	中国海防	1,753,634.00	3.23
147	600873	梅花生物	1,748,912.00	3.22
148	002008	大族激光	1,748,651.00	3.22
149	600521	华海药业	1,747,901.00	3.22
150	002203	海亮股份	1,747,845.00	3.22
151	600801	华新水泥	1,747,131.00	3.22
152	601139	深圳燃气	1,741,014.00	3.21
153	600390	五矿资本	1,737,248.00	3.20
154	601228	广州港	1,736,279.00	3.20

155	000898	鞍钢股份	1,732,119.00	3.19
156	001203	大中矿业	1,731,678.00	3.19
157	603858	步长制药	1,729,258.18	3.19
158	000960	锡业股份	1,728,843.00	3.19
159	600663	陆家嘴	1,711,039.00	3.15
160	600299	安迪苏	1,705,458.00	3.14
161	002019	亿帆医药	1,704,899.00	3.14
162	600827	百联股份	1,704,021.00	3.14
163	002608	江苏国信	1,702,187.00	3.14
164	002268	电科网安	1,700,771.00	3.13
165	002155	湖南黄金	1,695,000.00	3.12
166	600928	西安银行	1,689,783.00	3.11
167	688521	芯原股份	1,686,749.80	3.11
168	002867	周大生	1,684,781.00	3.10
169	000878	云南铜业	1,681,370.00	3.10
170	002078	太阳纸业	1,677,397.00	3.09
171	600096	云天化	1,673,927.23	3.08
172	000987	越秀资本	1,672,101.00	3.08
173	000539	粤电力 A	1,670,262.80	3.08
174	000967	盈峰环境	1,666,290.00	3.07
175	002739	万达电影	1,665,868.00	3.07
176	601990	南京证券	1,664,530.00	3.07
177	000027	深圳能源	1,662,474.00	3.06
178	600369	西南证券	1,658,393.00	3.06
179	002138	顺络电子	1,656,539.00	3.05
180	600399	抚顺特钢	1,655,909.00	3.05
181	002195	岩山科技	1,655,255.00	3.05
182	688567	孚能科技	1,651,895.44	3.04
183	601928	凤凰传媒	1,647,726.00	3.04
184	600060	海信视像	1,644,758.00	3.03
185	601966	玲珑轮胎	1,641,933.00	3.03
186	002080	中材科技	1,640,390.00	3.02
187	002690	美亚光电	1,639,620.00	3.02
188	600707	彩虹股份	1,630,478.00	3.00
189	300009	安科生物	1,629,840.60	3.00
190	601636	旗滨集团	1,628,160.00	3.00
191	603218	日月股份	1,621,118.00	2.99
192	300390	天华新能	1,615,219.00	2.98
193	601231	环旭电子	1,615,100.00	2.98
194	601108	财通证券	1,604,005.47	2.96
195	002673	西部证券	1,603,504.00	2.95
196	688169	石头科技	1,602,584.77	2.95
197	600271	航天信息	1,600,444.00	2.95

198	600879	航天电子	1,592,575.00	2.93
199	600839	四川长虹	1,590,659.00	2.93
200	000630	铜陵有色	1,590,142.00	2.93
201	600008	首创环保	1,587,980.00	2.93
202	002831	裕同科技	1,586,054.00	2.92
203	688122	西部超导	1,581,623.84	2.91
204	002153	石基信息	1,581,549.00	2.91
205	000893	亚钾国际	1,576,686.00	2.91
206	000598	兴蓉环境	1,576,255.00	2.90
207	688099	晶晨股份	1,576,166.27	2.90
208	300070	碧水源	1,575,398.00	2.90
209	300888	稳健医疗	1,570,866.60	2.89
210	600109	国金证券	1,569,162.00	2.89
211	603893	瑞芯微	1,564,026.00	2.88
212	002531	天顺风能	1,563,749.00	2.88
213	600871	石化油服	1,559,259.00	2.87
214	000623	吉林敖东	1,556,783.00	2.87
215	600166	福田汽车	1,555,011.00	2.87
216	001872	招商港口	1,549,636.00	2.86
217	601233	桐昆股份	1,538,701.00	2.84
218	688538	和辉光电	1,536,316.93	2.83
219	002926	华西证券	1,531,357.00	2.82
220	300003	乐普医疗	1,526,033.00	2.81
221	002065	东华软件	1,518,800.00	2.80
222	600511	国药股份	1,517,989.00	2.80
223	000739	普洛药业	1,514,898.00	2.79
224	600528	中铁工业	1,512,052.00	2.79
225	300088	长信科技	1,505,540.00	2.77
226	605358	立昂微	1,501,621.00	2.77
227	300144	宋城演艺	1,501,533.00	2.77
228	600535	天士力	1,494,016.00	2.75
229	002202	金风科技	1,487,056.00	2.74
230	601933	永辉超市	1,483,641.00	2.73
231	601179	中国西电	1,481,596.00	2.73
232	600329	达仁堂	1,477,609.00	2.72
233	688295	中复神鹰	1,475,917.93	2.72
234	000729	燕京啤酒	1,474,816.00	2.72
235	688331	荣昌生物	1,474,179.47	2.72
236	603927	中科软	1,469,515.40	2.71
237	300474	景嘉微	1,465,674.00	2.70
238	002653	海思科	1,458,484.00	2.69
239	600739	辽宁成大	1,447,259.00	2.67
240	603688	石英股份	1,443,838.00	2.66

241	002384	东山精密	1,442,832.00	2.66
242	600988	赤峰黄金	1,431,126.00	2.64
243	300395	菲利华	1,428,332.00	2.63
244	002223	鱼跃医疗	1,426,009.00	2.63
245	300212	易华录	1,424,194.00	2.62
246	601106	中国一重	1,417,356.00	2.61
247	600808	马钢股份	1,414,337.00	2.61
248	600673	东阳光	1,413,926.00	2.61
249	002044	美年健康	1,408,734.72	2.60
250	603317	天味食品	1,400,807.80	2.58
251	300146	汤臣倍健	1,397,841.00	2.58
252	000021	深科技	1,395,424.20	2.57
253	600378	昊华科技	1,389,081.00	2.56
254	002465	海格通信	1,386,081.00	2.55
255	603882	金域医学	1,385,288.00	2.55
256	002409	雅克科技	1,384,570.00	2.55
257	603228	景旺电子	1,384,377.00	2.55
258	603650	彤程新材	1,379,668.00	2.54
259	000709	河钢股份	1,379,154.00	2.54
260	688425	铁建重工	1,374,124.54	2.53
261	000553	安道麦 A	1,368,145.00	2.52
262	000050	深天马 A	1,366,653.00	2.52
263	688188	柏楚电子	1,366,070.30	2.52
264	600315	上海家化	1,364,486.00	2.51
265	600637	东方明珠	1,362,124.00	2.51
266	603589	口子窖	1,362,050.00	2.51
267	300394	天孚通信	1,360,399.60	2.51
268	300601	康泰生物	1,358,438.80	2.50
269	600481	双良节能	1,358,303.00	2.50
270	600549	厦门钨业	1,356,571.00	2.50
271	600765	中航重机	1,350,901.00	2.49
272	002557	洽洽食品	1,350,522.00	2.49
273	601162	天风证券	1,346,793.00	2.48
274	688779	五矿新能	1,346,539.24	2.48
275	603355	莱克电气	1,346,297.00	2.48
276	600927	永安期货	1,345,606.00	2.48
277	600498	烽火通信	1,330,678.00	2.45
278	688375	国博电子	1,328,377.93	2.45
279	600155	华创云信	1,327,793.00	2.45
280	601016	节能风电	1,327,684.00	2.45
281	601198	东兴证券	1,326,229.00	2.44
282	002508	老板电器	1,322,860.00	2.44
283	300502	新易盛	1,320,165.00	2.43

284	300699	光威复材	1, 319, 028. 60	2. 43
285	000066	中国长城	1, 318, 602. 00	2. 43
286	001286	陕西能源	1, 307, 930. 00	2. 41
287	002423	中粮资本	1, 299, 236. 00	2. 39
288	600325	华发股份	1, 297, 767. 00	2. 39
289	002505	鹏都农牧	1, 295, 517. 00	2. 39
290	688349	三一重能	1, 285, 365. 08	2. 37
291	601399	国机重装	1, 282, 469. 00	2. 36
292	603517	绝味食品	1, 281, 332. 00	2. 36
293	002444	巨星科技	1, 277, 279. 00	2. 35
294	002507	涪陵榨菜	1, 271, 744. 10	2. 34
295	002373	千方科技	1, 271, 586. 00	2. 34
296	002353	杰瑞股份	1, 270, 738. 00	2. 34
297	600167	联美控股	1, 268, 807. 00	2. 34
298	688220	翱捷科技	1, 259, 080. 22	2. 32
299	600925	苏能股份	1, 251, 062. 00	2. 31
300	600004	白云机场	1, 249, 547. 00	2. 30
301	600032	浙江新能	1, 248, 412. 93	2. 30
302	688200	华峰测控	1, 248, 114. 33	2. 30
303	300017	网宿科技	1, 247, 851. 00	2. 30
304	603000	人民网	1, 246, 216. 00	2. 30
305	000009	中国宝安	1, 243, 263. 00	2. 29
306	000988	华工科技	1, 233, 953. 00	2. 27
307	603885	吉祥航空	1, 233, 061. 00	2. 27
308	603737	三棵树	1, 231, 605. 00	2. 27
309	688297	中无人机	1, 229, 209. 96	2. 27
310	603606	东方电缆	1, 226, 072. 00	2. 26
311	002625	光启技术	1, 216, 313. 00	2. 24
312	300026	红日药业	1, 212, 799. 00	2. 23
313	600141	兴发集团	1, 212, 592. 00	2. 23
314	600415	小商品城	1, 212, 293. 00	2. 23
315	603868	飞科电器	1, 209, 278. 00	2. 23
316	688778	厦钨新能	1, 207, 966. 80	2. 23
317	000887	中鼎股份	1, 197, 422. 97	2. 21
318	301236	软通动力	1, 192, 056. 00	2. 20
319	002156	通富微电	1, 187, 804. 00	2. 19
320	688516	奥特维	1, 186, 353. 26	2. 19
321	603185	弘元绿能	1, 184, 411. 60	2. 18
322	603056	德邦股份	1, 183, 969. 00	2. 18
323	300861	美畅股份	1, 180, 596. 00	2. 18
324	002472	双环传动	1, 175, 039. 00	2. 17
325	600578	京能电力	1, 150, 718. 00	2. 12
326	002326	永太科技	1, 148, 169. 00	2. 12

327	002092	ST 中泰	1, 147, 459. 00	2. 11
328	001227	兰州银行	1, 146, 772. 00	2. 11
329	601992	金隅集团	1, 142, 748. 00	2. 11
330	002372	伟星新材	1, 142, 303. 00	2. 10
331	603658	安图生物	1, 141, 979. 00	2. 10
332	300529	健帆生物	1, 130, 258. 00	2. 08
333	688002	睿创微纳	1, 129, 832. 04	2. 08
334	300207	欣旺达	1, 126, 719. 00	2. 08
335	002299	圣农发展	1, 121, 294. 00	2. 07
336	300677	英科医疗	1, 120, 953. 00	2. 07
337	603456	九洲药业	1, 114, 360. 00	2. 05
338	601187	厦门银行	1, 110, 356. 00	2. 05
339	300373	扬杰科技	1, 110, 102. 45	2. 05
340	603939	益丰药房	1, 106, 696. 00	2. 04
341	002010	传化智联	1, 102, 097. 00	2. 03
342	000089	深圳机场	1, 101, 621. 00	2. 03
343	300595	欧普康视	1, 101, 160. 00	2. 03
344	300682	朗新集团	1, 101, 117. 00	2. 03
345	300024	机器人	1, 099, 493. 00	2. 03
346	600906	财达证券	1, 088, 931. 00	2. 01
347	601696	中银证券	1, 088, 758. 00	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	827, 772, 185. 11
卖出股票收入（成交）总额	836, 792, 182. 22

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行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	167,526.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	130,209.23



6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	297,735.23

#### 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指数投资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	620	49,736.75	0.00	0.00	30,836,787.07	100.00
华安中证 500 指数增强 C	944	28,848.25	2,390,673.58	8.78	24,842,078.55	91.22
合计	1,564	37,128.86	2,390,673.58	4.12	55,678,865.62	95.88

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	华安中证 500 指数增强 A	2,443,677.65	7.92
	华安中证 500 指数增强 C	10.01	0.00

有本基金			
	合计	2,443,687.66	4.21

### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安中证 500 指数增强 A	—
	华安中证 500 指数增强 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	华安中证 500 指数增强 A	>100
	华安中证 500 指数增强 C	—
	合计	>100

## § 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	23,285,283.87	42,239,373.55
本报告期基金总申购份额	36,083,697.60	44,710,208.47
减：本报告期基金总赎回份额	28,532,194.40	59,716,829.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	30,836,787.07	27,232,752.13

## § 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：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公

告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

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

本基金自 2024 年 11 月 9 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。此次变更已经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 12,000.00 元。

目前该审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2024 年 11 月 9 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	1,664,564,367.33	100.00	405,405.51	100.00	-

注：本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华安基金管理有限

公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

#### 1、选择证券公司参与证券交易的标准：

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

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

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

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

#### 2、选择证券公司参与证券交易的程序：

##### （1）候选证券公司的尽职调查

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

##### （2）候选证券公司的准入评估

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

##### （3）候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

##### （4）协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

#### 3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：无。

撤销交易单元的证券公司：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	6,603,180.00	100.00	2,151,000.00	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 2023 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	2024 年 1 月 19 日
2	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	2024 年 3 月 1 日
3	华安中证 500 指数增强更新的招募说明书(2024 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	2024 年 3 月 1 日
4	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	2024 年 3 月 1 日
5	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 12 日
6	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 27 日
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
8	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
9	华安中证 500 指数增强 2024 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	2024 年 4 月 22 日
10	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	2024 年 6 月 28 日
11	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	2024 年 6 月 28 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基	中国证监会基金电子披	2024 年 7 月 19 日

	金 2024 年第 2 季度报告的提示性公告	露网站及基金管理人网站	
13	华安中证 500 指数增强 2024 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	2024 年 7 月 19 日
14	关于终止喜鹊财富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	2024 年 7 月 24 日
15	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
16	华安中证 500 指数增强 2024 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	2024 年 8 月 31 日
17	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2024 年 10 月 25 日
18	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 9 日
20	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	2024 年 12 月 26 日
21	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	2024 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	20240522~20241008	0.00	21,180,277.71	21,180,277.71	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

2025 年 3 月 31 日