

# 华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
7.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
8.3 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 .....	68
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4 基金投资策略的改变 .....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8 其他重大事件 .....	71
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	71
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
12.1 备查文件目录 .....	72
12.2 存放地点 .....	72
12.3 查阅方式 .....	72

## § 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	59,597,710.64 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	41,010,520.23 份	18,587,190.41 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	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	33,414.11	-150,045.74
本期利润	1,532,845.58	867,857.00
加权平均基金份额本期利润	0.0447	0.0396
本期加权平均净	5.11%	4.59%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	4.76%	4.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-4,315,356.31	-2,162,312.61
期末可供分配基金份额利润	-0.1052	-0.1163
期末基金资产净值	37,064,357.59	16,589,843.08
期末基金份额净值	0.9038	0.8925
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-9.62%	-10.75%

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
过去一个月	3.79%	0.68%	4.09%	0.75%	-0.30%	-0.07%
过去三个月	2.06%	1.43%	0.97%	1.43%	1.09%	0.00%
过去六个月	4.76%	1.28%	3.21%	1.29%	1.55%	-0.01%
过去一年	16.75%	1.55%	18.65%	1.64%	-1.90%	-0.09%
过去三年	-12.70%	1.24%	-7.80%	1.29%	-4.90%	-0.05%

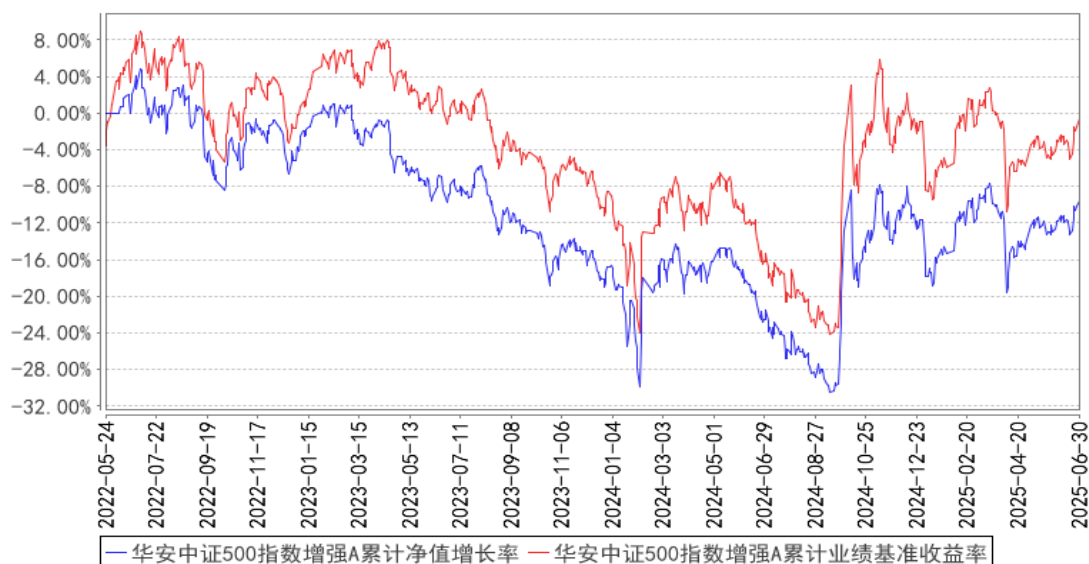
自基金合同生效 起至今	-9.62%	1.22%	-0.63%	1.29%	-8.99%	-0.07%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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
过去一个月	3.74%	0.67%	4.09%	0.75%	-0.35%	-0.08%
过去三个月	1.94%	1.43%	0.97%	1.43%	0.97%	0.00%
过去六个月	4.56%	1.28%	3.21%	1.29%	1.35%	-0.01%
过去一年	16.27%	1.55%	18.65%	1.64%	-2.38%	-0.09%
过去三年	-13.76%	1.24%	-7.80%	1.29%	-5.96%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	-10.75%	1.22%	-0.63%	1.29%	-10.12%	-0.07%

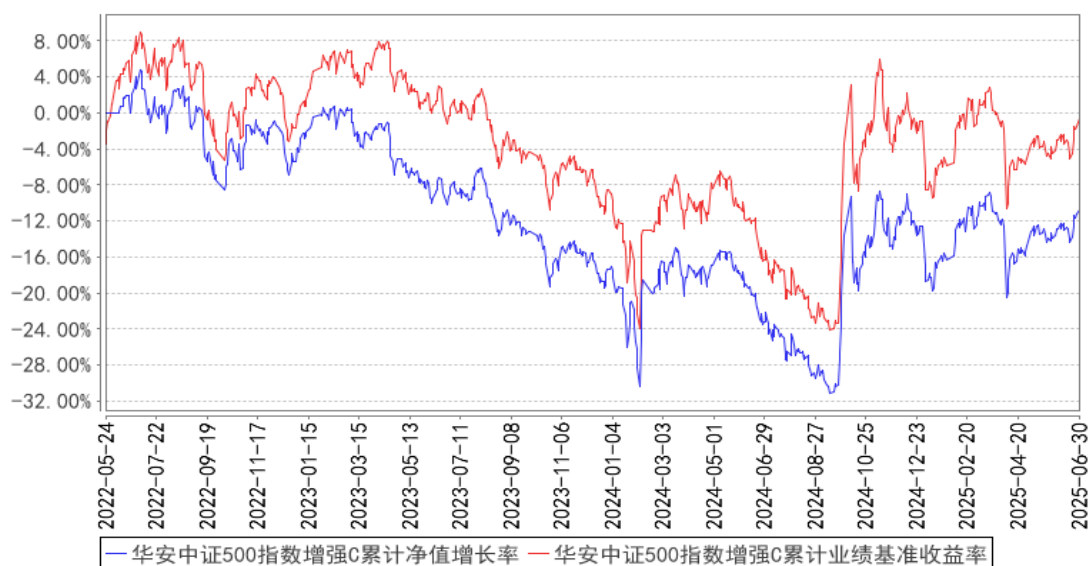
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



## § 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。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、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 2025 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 283 只证券投资基金，管理资产规模达到 7,488.16 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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 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

2025 年上半年权益市场表现较好，资本市场整体较为活跃，热点主题不断表现，继 AI 人工智能、机器人等主题爆发之后，创新药、新消费呈现出接力之势。风格上，以银行为代表的大盘红利及小微盘指数均走出了趋势性行情。量化因子方面，无论是传统基本面因子、量价因子还是深度学习类的高频量价因子表现均较为稳定，尤其是在小盘成分股内超额收益较为显著。

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获取市场短期非理性定价带来的交易性收益。2025 年上半年，策略整体平稳运作，基金净值表现跑赢业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.9038 元，C 类份额净值为 0.8925 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 4.76%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%；C 类份额净值增长率为 4.56%，同期业绩比较基准增长率为 3.21%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，维持经济的平稳过渡和持续发展仍然是宏观政策的主要目标。证券市场稳中向好，在成交持续活跃的背景下各类投资机会纷纷涌现。

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、固定收益部门负责人、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金已出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形，报告期内的具体时间范围如下：

报告期初-2025 年 2 月 6 日、2025 年 3 月 31 日-2025 年 6 月 20 日。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,179,137.67	4,150,886.97
结算备付金		791,270.22	139,265.25
存出保证金		512,610.00	167,526.00
交易性金融资产	6.4.7.2	47,320,458.67	45,490,273.29
其中：股票投资		47,317,931.54	45,490,273.29
基金投资		—	—
债券投资		2,527.13	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
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		9,297.51	130,209.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		53,812,774.07	50,078,160.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		63,615.83	176,278.82
应付管理人报酬		23,864.01	26,511.27
应付托管费		5,966.02	6,627.80
应付销售服务费		5,371.88	8,413.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	59,755.65	12,000.00
负债合计		158,573.40	229,831.36
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	59,597,710.64	58,069,539.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-5,943,509.97	-8,221,209.82
净资产合计		53,654,200.67	49,848,329.38
负债和净资产总计		53,812,774.07	50,078,160.74

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 59,597,710.64 份，其中 A 类基金份额净值 0.9038 元，基金份额总额 41,010,520.23 份；C 类基金份额净值 0.8925 元，基金份额总额 18,587,190.41 份。

## 6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,674,125.21	-4,354,947.60
1. 利息收入		9,344.57	10,781.49

其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,344.57	10,781.49
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）		142,851.17	-2,752,798.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-212,979.41	-3,649,982.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,084.00	-434.71
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-69,994.28	303,185.30
股利收益	6.4.7.13	422,740.86	594,519.46
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）	6.4.7.14	2,517,334.21	-1,629,446.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,595.26	16,515.83
<b>减：二、营业总支出</b>		273,422.63	256,924.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	145,296.63	126,103.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,324.20	31,525.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	37,686.38	40,266.99
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	1,236.21
8. 其他费用	6.4.7.17	54,115.42	57,252.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,400,702.58	-4,611,871.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,400,702.58	-4,611,871.94

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,400,702.58	-4,611,871.94

### 6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	58,069,539.20	-	-8,221,209.82	49,848,329.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	58,069,539.20	-	-8,221,209.82	49,848,329.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,528,171.44	-	2,277,699.85	3,805,871.29
(一)、综合收益总额	-	-	2,400,702.58	2,400,702.58
(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)	1,528,171.44	-	-123,002.73	1,405,168.71
其中：1. 基金申购款	21,163,933.00	-	-2,714,370.86	18,449,562.14
2. 基金赎回款	-19,635,761.56	-	2,591,368.13	-17,044,393.43
(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	59,597,710.64	-	-5,943,509.97	53,654,200.67
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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)	-2,921,039.11	-	-3,015,365.00	-5,936,404.11
(一)、综合收益总额	-	-	-4,611,871.94	-4,611,871.94
(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)	-2,921,039.11	-	1,596,506.94	-1,324,532.17
其中：1. 基金申购款	37,756,994.22	-	-6,135,650.18	31,621,344.04
2. 基金赎回款	-40,678,033.33	-	7,732,157.12	-32,945,876.21
(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	62,603,618.31	-	-14,270,863.82	48,332,754.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

朱学华

陈松一

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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，基金管理人可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%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,668,491.97
等于：本金	2,668,251.40
加：应计利息	240.57
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	2,510,645.70
等于：本金	2,510,613.64
加：应计利息	32.06
减：坏账准备	-
合计	5,179,137.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		46,105,836.63	-	47,317,931.54	1,212,094.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,000.00	0.59	2,527.13	526.54
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,000.00	0.59	2,527.13	526.54
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		46,107,836.63	0.59	47,320,458.67	1,212,621.45

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	3,269,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,269,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,269,160.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 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
IC2509	IC2509	1.00	1,155,160.00	35,200.00
IC2512	IC2512	2.00	2,262,240.00	113,040.00
合计				148,240.00
减：可抵销期货暂收款				148,240.00
净额				0.00

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	6,695.50
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	13,388.57
预提信息披露费	39,671.58
合计	59,755.65

#### 6.4.7.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,836,787.07	30,836,787.07
本期申购	15,679,792.81	15,679,792.81
本期赎回（以“-”号填列）	-5,506,059.65	-5,506,059.65
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	41,010,520.23	41,010,520.23

华安中证 500 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,232,752.13	27,232,752.13
本期申购	5,484,140.19	5,484,140.19
本期赎回（以“-”号填列）	-14,129,701.91	-14,129,701.91
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	18,587,190.41	18,587,190.41

#### 6.4.7.8 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	-3,249,818.08	-985,543.83	-4,235,361.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-



本期期初	-3,249,818.08	-985,543.83	-4,235,361.91
本期利润	33,414.11	1,499,431.47	1,532,845.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,098,952.34	-144,693.97	-1,243,646.31
其中：基金申购款	-1,711,714.54	-186,710.54	-1,898,425.08
基金赎回款	612,762.20	42,016.57	654,778.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,315,356.31	369,193.67	-3,946,162.64

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	-3,124,912.81	-860,935.10	-3,985,847.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,124,912.81	-860,935.10	-3,985,847.91
本期利润	-150,045.74	1,017,902.74	867,857.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,112,645.94	7,997.64	1,120,643.58
其中：基金申购款	-658,322.65	-157,623.13	-815,945.78
基金赎回款	1,770,968.59	165,620.77	1,936,589.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,162,312.61	164,965.28	-1,997,347.33

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,368.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,732.95
结算备付金利息收入	2,243.25
其他	-
合计	9,344.57

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-212,979.41
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	-212,979.41

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	428,293,260.74
减：卖出股票成本总额	428,078,845.24
减：交易费用	427,394.91
买卖股票差价收入	-212,979.41

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,080.45
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	3,084.00

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,984.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,900.00
减：应计利息总额	3.06
减：交易费用	1.20
买卖债券差价收入	3,080.45

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-69,994.28
合计	-69,994.28

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	422,740.86
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	422,740.86

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,272,494.21
股票投资	2,271,967.67
债券投资	526.54
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	244,840.00
权证投资	-
期货投资	244,840.00
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	2,517,334.21

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,493.70
基金转换费收入	101.56
合计	4,595.26

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	13,388.57
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,043.46
其他	11.81
合计	54,115.42

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。

根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	145,296.63	126,103.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	55,599.57	58,027.19
应支付基金管理人的净管理费	89,697.06	68,076.17

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

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	36,324.20	31,525.81

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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
国泰海通证券股份有限公司	—	193.17	193.17
国泰君安证券股份有限公司	—	165.65	165.65
华安基金管理有限公司	—	2,275.49	2,275.49
招商银行股份有限公司	—	3,924.95	3,924.95
合计	—	6,559.26	6,559.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	—	218.38	218.38
华安基金管理有限公司	—	1,991.92	1,991.92
招商银行股份有限公司	—	1,170.30	1,170.30
合计	—	3,380.60	3,380.60

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

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,668,491.97	4,368.37	2,411,097.28	4,103.07

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025 年 6 月 16 日	1 个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	6	600.00	600.04	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6	重大事项停牌	38.05	2025 年 7	39.98	200	7,238.00	7,610.00	-

		月 30 日			月 11 日					
603863	松炆 资源	2025 年 6 月 27 日	重大事 项停牌	14.65	2025 年 7 月 4 日	13.45	300	4,311.00	4,395.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金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。本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

##### 6.4.13.1 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之内。



#### 6.4.13.2 信用风险

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

本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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 6.4.12。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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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的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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,179,137.67	-	-	-	5,179,137.67
结算备付金	791,270.22	-	-	-	791,270.22
存出保证金	-	-	-	512,610.00	512,610.00
交易性金融资产	2,527.13	-	-	47,317,931.54	47,320,458.67
应收申购款	-	-	-	9,297.51	9,297.51
资产总计	5,972,935.02	-	-	47,839,839.05	53,812,774.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	63,615.83	63,615.83
应付管理人报酬	-	-	-	23,864.01	23,864.01
应付托管费	-	-	-	5,966.02	5,966.02
应付销售服务费	-	-	-	5,371.88	5,371.88
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	59,755.65	59,755.65
负债总计	-	-	-	158,573.40	158,573.40
利率敏感度缺口	5,972,935.02	-	-	47,681,265.65	53,654,200.67
上年度末 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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.005%(2024 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年

12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型指数产品，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	47,317,931.54	88.19	45,490,273.29	91.26
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,527.13	0.00	—	—

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	47,320,458.67	88.20	45,490,273.29	91.26

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,639,259.53	2,328,546.31
	业绩比较基准下降 5%	-2,639,259.53	-2,328,546.31

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	47,307,853.63	45,435,800.29

第二层次	12,605.04	54,473.00
第三层次	—	—
合计	47,320,458.67	45,490,273.29

#### 6.4.14.2.2 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业等情况，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。

#### 6.4.14.3 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。

#### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 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。

##### 6.4.15.2 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。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,317,931.54	87.93
	其中：股票	47,317,931.54	87.93

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,527.13	0.00
	其中：债券	2,527.13	0.00
	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	5,970,407.89	11.09
8	其他各项资产	521,907.51	0.97
9	合计	53,812,774.07	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	286,016.00	0.53
B	采矿业	1,073,499.00	2.00
C	制造业	24,021,246.93	44.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,245,447.00	2.32
E	建筑业	959,835.00	1.79
F	批发和零售业	1,221,622.24	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	574,268.00	1.07
H	住宿和餐饮业	4,488.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,118,589.29	7.68
J	金融业	5,989,982.40	11.16
K	房地产业	820,290.00	1.53
L	租赁和商务服务业	529,174.60	0.99
M	科学研究和技术服务业	317,629.94	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	207,928.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	125,371.00	0.23
R	文化、体育和娱乐	344,002.00	0.64

	乐业		
S	综合	125,604.00	0.23
	合计	41,964,993.40	78.21

### 7.2.2 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	9,271.00	0.02
B	采矿业	32,784.00	0.06
C	制造业	3,665,468.25	6.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,973.00	0.16
E	建筑业	113,489.00	0.21
F	批发和零售业	163,883.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	82,811.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	510,041.88	0.95
J	金融业	152,722.00	0.28
K	房地产业	132,766.00	0.25
L	租赁和商务服务业	62,317.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	128,397.50	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	156,458.51	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,775.00	0.01
Q	卫生和社会工作	42,033.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	10,748.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	5,352,938.14	9.98

### 7.2.3 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300476	胜宏科技	3,400	456,892.00	0.85
2	002558	巨人网络	13,600	320,280.00	0.60
3	600153	建发股份	30,700	318,359.00	0.59
4	688017	绿的谐波	2,413	301,359.57	0.56
5	600839	四川长虹	29,600	287,712.00	0.54
6	000932	华菱钢铁	65,300	287,320.00	0.54
7	601577	长沙银行	28,900	287,266.00	0.54
8	002966	苏州银行	31,700	278,326.00	0.52
9	000988	华工科技	5,900	277,359.00	0.52
10	601128	常熟银行	36,620	269,889.40	0.50
11	000783	长江证券	38,100	264,033.00	0.49
12	600737	中粮糖业	27,100	256,095.00	0.48
13	000563	陕国投 A	71,100	253,827.00	0.47
14	600970	中材国际	29,100	249,678.00	0.47
15	002065	东华软件	26,000	249,600.00	0.47
16	600885	宏发股份	10,880	242,732.80	0.45
17	600998	九州通	46,966	241,405.24	0.45
18	600517	国网英大	47,200	240,720.00	0.45
19	002958	青农商行	65,700	237,177.00	0.44
20	300496	中科创达	4,100	234,602.00	0.44
21	600820	隧道股份	38,300	233,630.00	0.44
22	601997	贵阳银行	37,100	231,504.00	0.43
23	688295	中复神鹰	11,042	229,673.60	0.43
24	600928	西安银行	58,500	229,320.00	0.43
25	600909	华安证券	39,300	229,119.00	0.43
26	688469	芯联集成	47,801	228,010.77	0.42
27	600925	苏能股份	43,500	227,505.00	0.42
28	000728	国元证券	28,500	224,865.00	0.42
29	688538	和辉光电	95,531	223,542.54	0.42
30	002025	航天电器	4,300	221,063.00	0.41
31	600498	烽火通信	10,500	220,815.00	0.41
32	600170	上海建工	92,300	220,597.00	0.41
33	300383	光环新网	15,200	217,360.00	0.41
34	600208	衢州发展	73,200	216,672.00	0.40
35	600988	赤峰黄金	8,600	213,968.00	0.40
36	300024	机器人	12,400	213,032.00	0.40
37	601099	太平洋	54,100	212,613.00	0.40
38	688363	华熙生物	4,135	212,332.25	0.40
39	300604	长川科技	4,700	211,077.00	0.39
40	688249	晶合集成	10,352	209,835.04	0.39
41	002797	第一创业	29,500	208,860.00	0.39
42	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.39

43	688072	拓荆科技	1,355	208,277.05	0.39
44	002841	视源股份	6,000	207,600.00	0.39
45	600521	华海药业	11,100	206,793.00	0.39
46	000933	神火股份	12,400	206,336.00	0.38
47	600566	济川药业	7,800	205,374.00	0.38
48	688220	翱捷科技	2,613	204,597.90	0.38
49	300474	景嘉微	2,800	204,400.00	0.38
50	600363	联创光电	3,500	204,155.00	0.38
51	601717	中创智领	12,200	202,764.00	0.38
52	002156	通富微电	7,900	202,398.00	0.38
53	000021	深科技	10,668	199,918.32	0.37
54	688425	铁建重工	48,923	199,605.84	0.37
55	002572	索菲亚	13,600	190,536.00	0.36
56	600895	张江高科	7,400	190,180.00	0.35
57	003022	联泓新科	12,000	189,960.00	0.35
58	603650	彤程新材	5,900	189,685.00	0.35
59	000034	神州数码	5,000	188,200.00	0.35
60	600563	法拉电子	1,700	185,453.00	0.35
61	002465	海格通信	13,300	185,402.00	0.35
62	600143	金发科技	17,700	182,487.00	0.34
63	601118	海南橡胶	38,600	182,192.00	0.34
64	002939	长城证券	21,700	181,846.00	0.34
65	601615	明阳智能	15,800	181,542.00	0.34
66	002078	太阳纸业	13,400	180,364.00	0.34
67	603728	鸣志电器	3,100	178,157.00	0.33
68	000997	新大陆	5,400	174,852.00	0.33
69	600126	杭钢股份	19,400	174,600.00	0.33
70	603129	春风动力	800	173,200.00	0.32
71	300339	润和软件	3,400	172,822.00	0.32
72	300763	锦浪科技	3,000	172,170.00	0.32
73	000062	深圳华强	6,400	171,904.00	0.32
74	002851	麦格米特	3,400	170,476.00	0.32
75	600862	中航高科	6,500	169,520.00	0.32
76	600487	亨通光电	11,000	168,300.00	0.31
77	600816	建元信托	56,900	167,855.00	0.31
78	000898	鞍钢股份	72,300	167,736.00	0.31
79	002185	华天科技	16,500	166,650.00	0.31
80	600060	海信视像	7,200	165,744.00	0.31
81	601665	齐鲁银行	26,200	165,584.00	0.31
82	601933	永辉超市	33,400	163,660.00	0.31
83	600764	中国海防	4,800	163,200.00	0.30
84	000066	中国长城	11,000	162,800.00	0.30
85	001286	陕西能源	18,600	161,820.00	0.30

86	601555	东吴证券	18,400	161,000.00	0.30
87	002244	滨江集团	16,400	159,900.00	0.30
88	601016	节能风电	55,300	159,817.00	0.30
89	300017	网宿科技	14,700	157,584.00	0.29
90	300803	指南针	1,950	157,287.00	0.29
91	600528	中铁工业	21,200	156,456.00	0.29
92	000050	深天马 A	18,300	155,916.00	0.29
93	600516	方大炭素	33,500	155,440.00	0.29
94	600580	卧龙电驱	7,800	154,206.00	0.29
95	000987	越秀资本	22,300	152,978.00	0.29
96	688120	华海清科	886	149,468.20	0.28
97	603160	汇顶科技	2,100	149,163.00	0.28
98	600529	山东药玻	6,700	148,338.00	0.28
99	603885	吉祥航空	11,000	148,170.00	0.28
100	600637	东方明珠	19,800	147,906.00	0.28
101	300115	长盈精密	6,900	147,660.00	0.28
102	600704	物产中大	28,000	147,560.00	0.28
103	002507	涪陵榨菜	11,500	147,085.00	0.27
104	601568	北元集团	35,400	146,910.00	0.27
105	002195	岩山科技	26,000	146,380.00	0.27
106	300765	新诺威	2,800	144,732.00	0.27
107	300699	光威复材	4,500	142,515.00	0.27
108	601958	金钼股份	13,000	142,220.00	0.27
109	000750	国海证券	34,400	141,728.00	0.26
110	300140	节能环境	22,900	141,293.00	0.26
111	002130	沃尔核材	5,900	140,538.00	0.26
112	600536	中国软件	3,000	140,310.00	0.26
113	689009	九号公司	2,348	138,931.16	0.26
114	000598	兴蓉环境	19,000	136,990.00	0.26
115	603893	瑞芯微	900	136,674.00	0.25
116	688578	艾力斯	1,467	136,489.68	0.25
117	601106	中国一重	48,600	136,080.00	0.25
118	600873	梅花生物	12,700	135,763.00	0.25
119	600316	洪都航空	3,600	135,720.00	0.25
120	000032	深桑达 A	6,700	135,541.00	0.25
121	002223	鱼跃医疗	3,800	135,280.00	0.25
122	603658	安图生物	3,600	135,000.00	0.25
123	600959	江苏有线	38,900	133,816.00	0.25
124	600298	安琪酵母	3,800	133,646.00	0.25
125	600109	国金证券	15,200	133,304.00	0.25
126	300395	菲利华	2,600	132,860.00	0.25
127	000400	许继电气	6,100	132,797.00	0.25
128	002423	中粮资本	10,800	132,084.00	0.25

129	600801	华新水泥	11,100	131,424.00	0.24
130	601108	财通证券	16,400	129,724.00	0.24
131	603000	人民网	6,400	129,344.00	0.24
132	688521	芯原股份	1,333	128,634.50	0.24
133	600956	新天绿能	16,400	126,608.00	0.24
134	601991	大唐发电	39,900	126,483.00	0.24
135	300070	碧水源	28,000	126,000.00	0.23
136	600879	航天电子	12,000	125,640.00	0.23
137	600673	东阳光	10,800	125,604.00	0.23
138	600352	浙江龙盛	12,200	123,952.00	0.23
139	000785	居然智家	40,600	123,830.00	0.23
140	002273	水晶光电	6,200	123,814.00	0.23
141	002926	华西证券	13,800	123,372.00	0.23
142	002294	信立泰	2,600	123,058.00	0.23
143	600295	鄂尔多斯	14,000	121,940.00	0.23
144	603927	中科软	6,300	121,842.00	0.23
145	001213	中铁特货	30,000	121,800.00	0.23
146	601611	中国核建	13,100	120,389.00	0.22
147	300212	易华录	5,500	119,680.00	0.22
148	688777	中控技术	2,664	119,640.24	0.22
149	601162	天风证券	24,100	118,813.00	0.22
150	600166	福田汽车	43,600	118,156.00	0.22
151	002340	格林美	18,500	117,475.00	0.22
152	688561	奇安信	3,457	117,468.86	0.22
153	600177	雅戈尔	15,868	115,836.40	0.22
154	002673	西部证券	14,700	115,836.00	0.22
155	300146	汤臣倍健	10,300	115,772.00	0.22
156	002532	天山铝业	13,900	115,509.00	0.22
157	000629	钒钛股份	43,800	112,128.00	0.21
158	002153	石基信息	12,900	111,714.00	0.21
159	600685	中船防务	4,100	111,479.00	0.21
160	002261	拓维信息	3,600	111,420.00	0.21
161	000537	中绿电	13,300	111,188.00	0.21
162	300207	欣旺达	5,500	110,330.00	0.21
163	002517	恺英网络	5,700	110,067.00	0.21
164	002432	九安医疗	3,000	109,290.00	0.20
165	002500	山西证券	18,500	108,040.00	0.20
166	688213	思特威	1,048	107,126.56	0.20
167	000426	兴业银锡	6,700	105,860.00	0.20
168	300735	光弘科技	4,200	105,420.00	0.20
169	000733	振华科技	2,100	105,105.00	0.20
170	688819	天能股份	3,772	104,710.72	0.20
171	000959	首钢股份	30,700	104,380.00	0.19

172	600598	北大荒	7,200	103,824.00	0.19
173	002281	光迅科技	2,100	103,572.00	0.19
174	002312	川发龙蟒	9,000	103,320.00	0.19
175	601965	中国汽研	5,800	102,950.00	0.19
176	600390	五矿资本	17,600	102,608.00	0.19
177	002508	老板电器	5,300	100,753.00	0.19
178	688563	航材股份	1,769	100,178.47	0.19
179	601212	白银有色	31,800	99,534.00	0.19
180	300251	光线传媒	4,900	99,323.00	0.19
181	300888	稳健医疗	2,400	98,640.00	0.18
182	601636	旗滨集团	19,600	98,196.00	0.18
183	600398	海澜之家	14,100	98,136.00	0.18
184	688301	奕瑞科技	1,114	97,597.54	0.18
185	688235	百济神州	416	97,194.24	0.18
186	002624	完美世界	6,400	97,088.00	0.18
187	300223	北京君正	1,400	96,880.00	0.18
188	002429	兆驰股份	22,100	96,798.00	0.18
189	300623	捷捷微电	3,200	95,360.00	0.18
190	300054	鼎龙股份	3,300	94,644.00	0.18
191	688002	睿创微纳	1,333	92,936.76	0.17
192	002138	顺络电子	3,300	92,796.00	0.17
193	600096	云天化	4,200	92,274.00	0.17
194	688702	盛科通信	1,507	92,047.56	0.17
195	002444	巨星科技	3,600	91,836.00	0.17
196	000591	太阳能	20,900	91,751.00	0.17
197	002439	启明星辰	5,700	91,143.00	0.17
198	600906	财达证券	13,300	90,706.00	0.17
199	600707	彩虹股份	13,900	89,794.00	0.17
200	603233	大参林	5,500	89,650.00	0.17
201	600582	天地科技	14,900	89,251.00	0.17
202	000729	燕京啤酒	6,900	89,217.00	0.17
203	600118	中国卫星	3,100	88,567.00	0.17
204	600131	国网信通	5,000	88,500.00	0.16
205	688520	神州细胞	1,478	88,458.30	0.16
206	600483	福能股份	9,100	87,724.00	0.16
207	000893	亚钾国际	2,900	87,406.00	0.16
208	300058	蓝色光标	13,260	86,985.60	0.16
209	300450	先导智能	3,500	86,975.00	0.16
210	600007	中国国贸	4,200	86,436.00	0.16
211	600348	华阳股份	12,900	85,914.00	0.16
212	300346	南大光电	2,700	85,428.00	0.16
213	688172	燕东微	4,333	85,186.78	0.16
214	002414	高德红外	8,300	85,075.00	0.16

215	688099	晶晨股份	1,197	84,998.97	0.16
216	603688	石英股份	2,400	84,528.00	0.16
217	600369	西南证券	19,400	84,390.00	0.16
218	601168	西部矿业	5,000	83,150.00	0.15
219	688248	南网科技	2,639	83,022.94	0.15
220	002266	浙富控股	26,600	81,928.00	0.15
221	688676	金盘科技	2,447	81,852.15	0.15
222	300679	电连技术	1,800	81,684.00	0.15
223	000060	中金岭南	17,700	81,066.00	0.15
224	000831	中国稀土	2,200	79,464.00	0.15
225	301267	华夏眼科	4,100	78,597.00	0.15
226	688297	中无人机	1,471	78,551.40	0.15
227	600271	航天信息	8,500	78,540.00	0.15
228	688385	复旦微电	1,590	78,339.30	0.15
229	002461	珠江啤酒	6,900	77,901.00	0.15
230	002085	万丰奥威	4,900	77,861.00	0.15
231	600901	江苏金租	12,800	77,568.00	0.14
232	300857	协创数据	900	77,454.00	0.14
233	300454	深信服	800	75,344.00	0.14
234	600848	上海临港	8,300	75,281.00	0.14
235	688122	西部超导	1,446	75,018.48	0.14
236	000623	吉林敖东	4,400	74,580.00	0.14
237	600872	中炬高新	3,900	74,100.00	0.14
238	000683	博源化工	15,400	73,766.00	0.14
239	600155	华创云信	10,500	73,080.00	0.14
240	002595	豪迈科技	1,200	71,064.00	0.13
241	002353	杰瑞股份	2,000	70,000.00	0.13
242	300136	信维通信	3,100	69,440.00	0.13
243	603939	益丰药房	2,800	68,516.00	0.13
244	002738	中矿资源	2,100	67,536.00	0.13
245	601216	君正集团	12,200	67,344.00	0.13
246	600720	中交设计	8,700	67,251.00	0.13
247	688349	三一重能	2,673	66,664.62	0.12
248	601179	中国西电	10,800	66,312.00	0.12
249	600808	马钢股份	19,100	65,895.00	0.12
250	002008	大族激光	2,700	65,799.00	0.12
251	301498	乖宝宠物	600	65,622.00	0.12
252	601990	南京证券	8,100	65,448.00	0.12
253	600927	永安期货	4,400	65,164.00	0.12
254	300676	华大基因	1,300	64,701.00	0.12
255	601098	中南传媒	4,900	64,288.00	0.12
256	002064	华峰化学	9,600	63,456.00	0.12
257	688617	惠泰医疗	212	62,964.00	0.12

258	002203	海亮股份	6,100	62,952.00	0.12
259	600079	人福医药	3,000	62,940.00	0.12
260	001696	宗申动力	2,800	62,860.00	0.12
261	000423	东阿阿胶	1,200	62,760.00	0.12
262	603589	口子窖	1,800	62,640.00	0.12
263	601198	东兴证券	5,600	62,440.00	0.12
264	000636	风华高科	4,500	61,830.00	0.12
265	300002	神州泰岳	5,200	61,360.00	0.11
266	688318	财富趋势	530	60,907.60	0.11
267	002670	国盛金控	4,000	60,200.00	0.11
268	688728	格科微	3,885	59,829.00	0.11
269	300458	全志科技	1,500	59,535.00	0.11
270	001389	广合科技	1,000	58,770.00	0.11
271	600098	广州发展	9,300	58,125.00	0.11
272	000429	粤高速 A	4,300	57,319.00	0.11
273	300285	国瓷材料	3,300	57,255.00	0.11
274	002608	江苏国信	7,800	57,174.00	0.11
275	601061	中信金属	7,200	56,952.00	0.11
276	000825	太钢不锈	15,800	56,722.00	0.11
277	688361	中科飞测	665	55,986.35	0.10
278	601228	广州港	17,200	55,556.00	0.10
279	603858	步长制药	3,400	55,216.00	0.10
280	002773	康弘药业	1,900	55,043.00	0.10
281	002410	广联达	4,100	54,981.00	0.10
282	688114	华大智造	844	54,716.52	0.10
283	300144	宋城演艺	6,300	53,865.00	0.10
284	600329	达仁堂	1,600	53,376.00	0.10
285	002007	华兰生物	3,400	53,278.00	0.10
286	603596	伯特利	1,000	52,690.00	0.10
287	300595	欧普康视	3,400	51,918.00	0.10
288	603606	东方电缆	1,000	51,710.00	0.10
289	000709	河钢股份	23,900	51,624.00	0.10
290	688065	凯赛生物	1,075	50,632.50	0.09
291	600038	中直股份	1,300	50,453.00	0.09
292	002472	双环传动	1,500	50,235.00	0.09
293	688032	禾迈股份	501	50,029.86	0.09
294	002436	兴森科技	3,700	48,988.00	0.09
295	600765	中航重机	2,900	48,952.00	0.09
296	601333	广深铁路	16,900	48,841.00	0.09
297	300751	迈为股份	700	48,692.00	0.09
298	688387	信科移动	8,522	48,149.30	0.09
299	000528	柳 工	5,000	48,050.00	0.09
300	002044	美年健康	9,100	46,774.00	0.09

301	600339	中油工程	14,300	46,761.00	0.09
302	300012	华测检测	4,000	46,760.00	0.09
303	601155	新城控股	3,400	46,512.00	0.09
304	600497	驰宏锌锗	8,700	46,023.00	0.09
305	601696	中银证券	4,300	45,967.00	0.09
306	601921	浙版传媒	5,700	45,942.00	0.09
307	300001	特锐德	1,900	45,543.00	0.08
308	002120	韵达股份	6,700	44,890.00	0.08
309	688525	佰维存储	661	44,551.40	0.08
310	002202	金风科技	4,300	44,075.00	0.08
311	002850	科达利	389	44,023.13	0.08
312	600282	南钢股份	10,200	42,840.00	0.08
313	600004	白云机场	4,700	42,770.00	0.08
314	601456	国联民生	4,100	42,435.00	0.08
315	000951	中国重汽	2,400	42,192.00	0.08
316	600549	厦门钨业	2,000	41,840.00	0.08
317	603605	珀莱雅	500	41,395.00	0.08
318	600056	中国医药	4,000	41,360.00	0.08
319	600655	豫园股份	7,400	41,070.00	0.08
320	600562	国睿科技	1,300	40,937.00	0.08
321	600583	海油工程	7,100	38,766.00	0.07
322	603179	新泉股份	800	37,576.00	0.07
323	300003	乐普医疗	2,700	37,206.00	0.07
324	601156	东航物流	2,800	36,652.00	0.07
325	300567	精测电子	600	36,366.00	0.07
326	300373	扬杰科技	700	36,330.00	0.07
327	002155	湖南黄金	2,020	36,057.00	0.07
328	600008	首创环保	11,900	35,938.00	0.07
329	002945	华林证券	2,500	35,925.00	0.07
330	688281	华秦科技	589	35,640.39	0.07
331	688052	纳芯微	200	34,898.00	0.07
332	688778	厦钨新能	618	34,558.56	0.06
333	688180	君实生物	1,015	34,489.70	0.06
334	688475	萤石网络	1,088	34,293.76	0.06
335	603659	璞泰来	1,800	33,804.00	0.06
336	603228	景旺电子	800	33,472.00	0.06
337	603087	甘李药业	600	32,868.00	0.06
338	300724	捷佳伟创	600	32,580.00	0.06
339	600312	平高电气	2,100	32,319.00	0.06
340	603298	杭叉集团	1,500	31,425.00	0.06
341	002056	横店东磁	2,200	31,130.00	0.06
342	600171	上海贝岭	900	30,825.00	0.06
343	600688	上海石化	10,800	30,780.00	0.06



344	000723	美锦能源	7,100	30,672.00	0.06
345	000960	锡业股份	2,000	30,600.00	0.06
346	688183	生益电子	580	29,696.00	0.06
347	600663	陆家嘴	3,300	29,238.00	0.05
348	300627	华测导航	820	28,700.00	0.05
349	300037	新宙邦	800	28,160.00	0.05
350	605589	圣泉集团	1,000	27,750.00	0.05
351	688375	国博电子	458	27,484.58	0.05
352	601858	中国科传	1,400	27,230.00	0.05
353	600361	创新新材	6,800	27,132.00	0.05
354	600095	湘财股份	2,700	27,081.00	0.05
355	601608	中信重工	6,100	26,657.00	0.05
356	002821	凯莱英	300	26,475.00	0.05
357	688188	柏楚电子	200	26,332.00	0.05
358	300073	当升科技	600	26,322.00	0.05
359	002563	森马服饰	5,000	26,300.00	0.05
360	000937	冀中能源	4,500	25,875.00	0.05
361	600392	盛和资源	1,900	25,023.00	0.05
362	600995	南网储能	2,500	24,450.00	0.05
363	601233	桐昆股份	2,300	24,380.00	0.05
364	000027	深圳能源	3,700	23,606.00	0.04
365	002409	雅克科技	400	21,876.00	0.04
366	601928	凤凰传媒	1,900	21,223.00	0.04
367	300142	沃森生物	1,900	20,900.00	0.04
368	601019	山东出版	2,200	20,834.00	0.04
369	002385	大北农	5,100	20,604.00	0.04
370	600535	天士力	1,300	20,345.00	0.04
371	003035	南网能源	4,400	20,196.00	0.04
372	000703	恒逸石化	3,400	19,992.00	0.04
373	603826	坤彩科技	1,000	19,570.00	0.04
374	000878	云南铜业	1,500	19,080.00	0.04
375	300677	英科医疗	800	18,944.00	0.04
376	002372	伟星新材	1,800	18,648.00	0.03
377	605358	立昂微	800	18,640.00	0.03
378	603979	金诚信	400	18,576.00	0.03
379	601000	唐山港	4,500	18,270.00	0.03
380	603868	飞科电器	500	17,935.00	0.03
381	601666	平煤股份	2,300	17,043.00	0.03
382	603290	斯达半导	200	16,254.00	0.03
383	002152	广电运通	1,200	16,128.00	0.03
384	600325	华发股份	3,300	16,071.00	0.03
385	600699	均胜电子	900	15,696.00	0.03
386	601966	玲珑轮胎	1,000	14,670.00	0.03

387	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.03
388	300957	贝泰妮	300	13,266.00	0.02
389	600021	上海电力	1,500	13,185.00	0.02
390	000543	皖能电力	1,800	12,600.00	0.02
391	002837	英维克	400	11,884.00	0.02
392	002831	裕同科技	500	11,710.00	0.02
393	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.02
394	600373	中文传媒	1,100	11,297.00	0.02
395	600546	山煤国际	1,200	10,476.00	0.02
396	600968	海油发展	1,900	7,752.00	0.01
397	600859	王府井	500	6,945.00	0.01
398	600578	京能电力	1,500	6,735.00	0.01
399	600380	健康元	600	6,618.00	0.01
400	300919	中伟股份	200	6,576.00	0.01
401	600863	内蒙华电	1,500	6,165.00	0.01
402	600867	通化东宝	700	5,740.00	0.01
403	601139	深圳燃气	800	5,088.00	0.01
404	600499	科达制造	500	4,900.00	0.01
405	600884	杉杉股份	500	4,730.00	0.01
406	000039	中集集团	600	4,716.00	0.01
407	600754	锦江酒店	200	4,488.00	0.01
408	600739	辽宁成大	400	4,400.00	0.01
409	002603	以岭药业	300	4,230.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	001234	泰慕士	2,500	53,575.00	0.10
2	301017	漱玉平民	3,400	43,622.00	0.08
3	300583	赛托生物	2,500	43,100.00	0.08
4	301112	信邦智能	1,000	36,300.00	0.07
5	601778	晶科科技	12,100	35,937.00	0.07
6	601388	怡球资源	13,900	35,028.00	0.07
7	300982	苏文电能	1,800	32,382.00	0.06
8	301168	通灵股份	900	31,419.00	0.06
9	002915	中欣氟材	1,600	28,608.00	0.05
10	000402	金融街	9,800	27,636.00	0.05
11	002084	海鸥住工	7,700	27,335.00	0.05
12	003038	鑫铂股份	1,400	27,286.00	0.05
13	301103	何氏眼科	1,200	26,640.00	0.05
14	300393	中来股份	4,600	26,496.00	0.05
15	688203	海正生材	2,076	26,282.16	0.05
16	600665	天地源	7,800	26,130.00	0.05

17	002136	安 纳 达	2,400	25,752.00	0.05
18	603610	麒盛科技	2,000	24,980.00	0.05
19	002671	龙泉股份	5,400	24,840.00	0.05
20	300631	久吾高科	1,000	24,560.00	0.05
21	603876	鼎胜新材	2,700	24,543.00	0.05
22	002727	一心堂	1,500	24,510.00	0.05
23	002669	康达新材	2,100	24,360.00	0.05
23	300371	汇中股份	2,100	24,360.00	0.05
24	002585	双星新材	4,400	24,024.00	0.04
25	603282	亚光股份	1,400	23,842.00	0.04
26	001326	联域股份	700	23,828.00	0.04
27	301122	采纳股份	1,100	23,496.00	0.04
28	688317	之江生物	1,283	23,119.66	0.04
29	002250	联化科技	2,100	23,100.00	0.04
30	300920	润阳科技	500	22,915.00	0.04
31	603216	梦天家居	1,800	22,788.00	0.04
32	600790	轻纺城	6,100	22,753.00	0.04
33	301220	亚香股份	500	22,450.00	0.04
34	688237	超卓航科	764	22,331.72	0.04
35	002859	洁美科技	1,117	22,239.47	0.04
36	301129	瑞纳智能	800	21,728.00	0.04
37	003021	兆威机电	200	21,630.00	0.04
38	301369	联动科技	400	21,484.00	0.04
39	300829	金丹科技	1,200	20,856.00	0.04
40	000529	广弘控股	3,400	20,774.00	0.04
41	002314	南山控股	7,800	20,514.00	0.04
42	603396	金辰股份	800	20,400.00	0.04
43	603915	国茂股份	1,400	20,356.00	0.04
44	002876	三利谱	800	20,152.00	0.04
45	603987	康德莱	2,600	20,020.00	0.04
46	688121	卓然股份	1,642	19,835.36	0.04
47	301181	标榜股份	800	19,824.00	0.04
48	002839	张家港行	4,400	19,800.00	0.04
49	688061	灿瑞科技	600	19,680.00	0.04
50	605189	富春染织	1,570	19,499.40	0.04
51	688396	华润微	413	19,477.08	0.04
52	002297	博云新材	2,400	19,200.00	0.04
53	688658	悦康药业	1,007	19,173.28	0.04
54	002672	东江环保	4,200	19,110.00	0.04
55	300667	必创科技	1,200	18,948.00	0.04
56	301529	福赛科技	600	18,798.00	0.04
57	600717	天津港	4,100	18,696.00	0.03
58	003010	若羽臣	300	18,180.00	0.03

59	601015	陕西黑猫	5,500	18,040.00	0.03
60	301096	百诚医药	400	17,960.00	0.03
61	001332	锡装股份	500	17,920.00	0.03
62	688631	莱斯信息	200	17,840.00	0.03
63	603520	司太立	1,800	17,640.00	0.03
64	302132	中航成飞	200	17,588.00	0.03
65	600502	安徽建工	3,700	17,390.00	0.03
66	688201	信安世纪	1,333	17,262.35	0.03
67	688348	昱能科技	400	17,188.00	0.03
68	000420	吉林化纤	4,400	17,160.00	0.03
69	600346	恒力石化	1,200	17,112.00	0.03
70	301088	戎美股份	1,200	16,500.00	0.03
71	300428	立中集团	900	16,398.00	0.03
72	300977	深圳瑞捷	900	16,272.00	0.03
72	688489	三未信安	400	16,272.00	0.03
73	603136	天目湖	1,200	16,164.00	0.03
74	605136	丽人丽妆	1,500	16,125.00	0.03
75	002573	清新环境	4,100	16,113.00	0.03
76	603380	易德龙	600	15,960.00	0.03
77	300958	建工修复	1,200	15,804.00	0.03
78	301153	中科江南	600	15,720.00	0.03
79	688225	亚信安全	770	15,700.30	0.03
80	300955	嘉亨家化	800	15,600.00	0.03
81	603955	大千生态	500	15,520.00	0.03
82	002574	明牌珠宝	2,500	15,500.00	0.03
83	688136	科兴制药	404	15,440.88	0.03
84	603768	常青股份	1,200	15,432.00	0.03
85	002687	乔治白	3,300	15,312.00	0.03
86	002391	长青股份	2,600	15,236.00	0.03
87	002988	豪美新材	400	15,200.00	0.03
88	301003	江苏博云	500	15,175.00	0.03
89	688020	方邦股份	400	15,148.00	0.03
90	002567	唐人神	3,100	14,756.00	0.03
91	300305	裕兴股份	2,300	14,674.00	0.03
92	300513	恒实科技	1,600	14,672.00	0.03
93	300510	金冠股份	3,200	14,656.00	0.03
94	688391	钜泉科技	493	14,637.17	0.03
95	603182	嘉华股份	1,100	14,630.00	0.03
96	000589	贵州轮胎	3,200	14,624.00	0.03
97	601996	丰林集团	6,700	14,539.00	0.03
98	688579	山大地纬	1,297	14,513.43	0.03
99	002631	德尔未来	3,100	14,508.00	0.03
100	300737	科顺股份	3,000	14,460.00	0.03

101	301360	荣旗科技	300	14,418.00	0.03
102	301319	唯特偶	400	14,400.00	0.03
103	002272	川润股份	1,300	14,378.00	0.03
104	002135	东南网架	3,400	14,348.00	0.03
105	300068	南都电源	900	14,328.00	0.03
106	301195	北路智控	400	14,320.00	0.03
107	003012	东鹏控股	2,500	14,300.00	0.03
108	300179	四方达	1,400	14,294.00	0.03
109	603289	泰瑞机器	1,500	14,280.00	0.03
110	001215	千味央厨	500	14,245.00	0.03
111	000789	万年青	2,600	14,196.00	0.03
112	600990	四创电子	500	14,020.00	0.03
113	301006	迈拓股份	900	13,986.00	0.03
114	301115	联检科技	900	13,941.00	0.03
115	603890	春秋电子	1,200	13,920.00	0.03
116	301045	天禄科技	600	13,740.00	0.03
117	002743	富煌钢构	2,300	13,639.00	0.03
118	688117	圣诺生物	400	13,460.00	0.03
119	605099	共创草坪	400	13,436.00	0.03
120	301198	喜悦智行	1,200	13,428.00	0.03
121	300745	欣锐科技	700	13,363.00	0.02
122	002174	游族网络	1,100	13,343.00	0.02
123	605180	华生科技	900	13,320.00	0.02
124	300800	力合科技	1,200	13,308.00	0.02
125	603808	歌力思	1,600	13,280.00	0.02
126	002042	华孚时尚	2,900	13,224.00	0.02
127	300902	国安达	700	13,174.00	0.02
128	688559	海目星	400	13,160.00	0.02
129	301386	未来电器	600	13,038.00	0.02
130	601828	美凯龙	4,500	13,005.00	0.02
131	301316	慧博云通	300	12,924.00	0.02
132	688206	概伦电子	444	12,911.52	0.02
133	600987	航民股份	1,800	12,726.00	0.02
134	300870	欧陆通	100	12,650.00	0.02
135	688252	天德钰	515	12,555.70	0.02
136	603192	汇得科技	600	12,540.00	0.02
137	001360	南矿集团	900	12,528.00	0.02
138	688668	鼎通科技	200	12,492.00	0.02
139	688283	坤恒顺维	449	12,325.05	0.02
140	688501	青达环保	442	12,309.70	0.02
141	001366	播恩集团	1,000	12,210.00	0.02
142	603898	好莱客	1,100	12,089.00	0.02
143	301314	科瑞思	300	12,057.00	0.02

144	601952	苏垦农发	1,200	11,844.00	0.02
145	688799	华纳药厂	281	11,605.30	0.02
146	688560	明冠新材	761	11,544.37	0.02
147	605599	莱百股份	700	11,445.00	0.02
148	603968	醋化股份	1,000	11,370.00	0.02
149	002864	盘龙药业	400	11,308.00	0.02
150	688195	腾景科技	250	11,250.00	0.02
151	603039	泛微网络	200	11,140.00	0.02
152	301310	鑫宏业	300	11,022.00	0.02
153	688321	微芯生物	463	11,010.14	0.02
154	301236	软通动力	200	10,928.00	0.02
155	688386	泛亚微透	200	10,862.00	0.02
156	301345	涛涛车业	100	10,810.00	0.02
157	300850	新强联	300	10,746.00	0.02
158	603018	华设集团	1,300	10,673.00	0.02
159	300614	百川畅银	800	10,648.00	0.02
160	603600	永艺股份	1,000	10,640.00	0.02
161	688550	瑞联新材	246	10,580.46	0.02
162	601003	柳钢股份	3,000	10,560.00	0.02
163	300365	恒华科技	1,600	10,544.00	0.02
163	603668	天马科技	800	10,544.00	0.02
164	002981	朝阳科技	400	10,512.00	0.02
165	688156	路德环境	621	10,501.11	0.02
166	600576	祥源文旅	1,300	10,491.00	0.02
167	688767	博拓生物	292	10,453.60	0.02
168	002807	江阴银行	2,200	10,450.00	0.02
169	605288	凯迪股份	200	10,422.00	0.02
170	300026	红日药业	2,800	10,332.00	0.02
171	002103	广博股份	900	10,323.00	0.02
172	002873	新天药业	1,100	10,274.00	0.02
173	002345	潮宏基	700	10,241.00	0.02
174	002790	瑞尔特	1,400	10,178.00	0.02
175	688598	金博股份	400	10,168.00	0.02
176	300314	戴维医疗	800	10,160.00	0.02
177	688620	安凯微	811	10,145.61	0.02
178	688433	华曙高科	276	10,143.00	0.02
179	300369	绿盟科技	1,300	10,101.00	0.02
180	603667	五洲新春	300	10,053.00	0.02
181	300168	万达信息	1,300	9,971.00	0.02
182	301108	洁雅股份	300	9,921.00	0.02
183	300520	科大国创	400	9,920.00	0.02
184	000661	长春高新	100	9,918.00	0.02
185	600782	新钢股份	2,800	9,912.00	0.02

186	600284	浦东建设	1,500	9,900.00	0.02
187	001914	招商积余	800	9,896.00	0.02
188	688343	云天励飞	200	9,884.00	0.02
189	300664	鹏鹞环保	1,800	9,864.00	0.02
189	603059	倍加洁	400	9,864.00	0.02
190	301388	欣灵电气	400	9,844.00	0.02
191	603086	先达股份	1,000	9,800.00	0.02
192	301456	盘古智能	400	9,784.00	0.02
193	603818	曲美家居	1,900	9,766.00	0.02
194	003016	欣贺股份	1,300	9,750.00	0.02
195	300388	节能国祯	1,400	9,744.00	0.02
196	300707	威唐工业	700	9,667.00	0.02
197	002163	海南发展	1,000	9,540.00	0.02
198	002382	蓝帆医疗	1,700	9,520.00	0.02
199	688480	赛恩斯	296	9,516.40	0.02
200	601187	厦门银行	1,400	9,506.00	0.02
201	000672	上峰水泥	1,200	9,480.00	0.02
202	605366	宏柏新材	1,500	9,390.00	0.02
203	300994	久祺股份	600	9,384.00	0.02
203	600785	新华百货	800	9,384.00	0.02
204	688577	浙海德曼	200	9,378.00	0.02
205	603569	长久物流	1,200	9,360.00	0.02
206	300858	科拓生物	600	9,354.00	0.02
207	600684	珠江股份	2,100	9,303.00	0.02
208	688081	兴图新科	447	9,302.07	0.02
209	600389	江山股份	500	9,300.00	0.02
210	300639	凯普生物	1,600	9,280.00	0.02
211	300389	艾比森	800	9,264.00	0.02
212	300059	东方财富	400	9,252.00	0.02
213	688178	万德斯	400	9,208.00	0.02
214	002196	方正电机	1,000	9,170.00	0.02
215	603856	东宏股份	800	9,160.00	0.02
216	600057	厦门象屿	1,300	9,139.00	0.02
217	601818	光大银行	2,200	9,130.00	0.02
218	300594	朗进科技	500	9,100.00	0.02
219	600383	金地集团	2,400	9,096.00	0.02
220	603916	苏博特	1,000	9,060.00	0.02
221	300837	浙矿股份	400	9,016.00	0.02
222	600729	重庆百货	300	8,949.00	0.02
223	301071	力量钻石	300	8,943.00	0.02
224	603093	南华期货	400	8,932.00	0.02
225	688657	浩辰软件	210	8,918.70	0.02
226	600075	新疆天业	2,100	8,883.00	0.02

227	002843	泰嘉股份	400	8,876.00	0.02
228	300660	江苏雷利	200	8,848.00	0.02
229	688680	海优新材	200	8,840.00	0.02
230	001256	炜冈科技	400	8,808.00	0.02
231	301373	凌玮科技	300	8,781.00	0.02
232	600897	厦门空港	600	8,754.00	0.02
233	003043	华亚智能	200	8,730.00	0.02
234	300413	芒果超媒	400	8,728.00	0.02
235	600015	华夏银行	1,100	8,701.00	0.02
236	688137	近岸蛋白	227	8,694.10	0.02
237	603138	海量数据	600	8,652.00	0.02
238	301520	万邦医药	200	8,622.00	0.02
239	300196	长海股份	700	8,540.00	0.02
240	603061	金海通	100	8,455.00	0.02
241	605186	健麾信息	400	8,376.00	0.02
242	600000	浦发银行	600	8,328.00	0.02
243	603733	仙鹤股份	400	8,296.00	0.02
244	000089	深圳机场	1,200	8,280.00	0.02
244	300188	国投智能	600	8,280.00	0.02
245	688345	博力威	300	8,265.00	0.02
246	301383	天键股份	200	8,256.00	0.02
247	001387	雪祺电气	600	8,244.00	0.02
248	603917	合力科技	600	8,124.00	0.02
249	000681	视觉中国	400	8,056.00	0.02
250	301160	翔楼新材	100	8,008.00	0.01
251	603075	热威股份	400	7,996.00	0.01
252	688552	航天南湖	200	7,982.00	0.01
253	000031	大悦城	3,000	7,950.00	0.01
254	300556	丝路视觉	400	7,948.00	0.01
255	688299	长阳科技	400	7,908.00	0.01
256	601033	永兴股份	500	7,905.00	0.01
257	300695	兆丰股份	100	7,799.00	0.01
258	603180	金牌家居	400	7,788.00	0.01
259	301387	光大同创	200	7,780.00	0.01
260	002240	盛新锂能	600	7,728.00	0.01
261	600377	宁沪高速	500	7,670.00	0.01
262	301102	兆讯传媒	700	7,644.00	0.01
263	300491	通合科技	400	7,640.00	0.01
264	688313	仕佳光子	200	7,610.00	0.01
265	001306	夏厦精密	100	7,594.00	0.01
266	688435	英方软件	230	7,576.20	0.01
267	300792	壹网壹创	300	7,512.00	0.01
268	600439	瑞贝卡	2,100	7,497.00	0.01



269	688419	耐科装备	200	7,456.00	0.01
270	002373	千方科技	800	7,440.00	0.01
271	603201	常润股份	400	7,380.00	0.01
272	605138	盛泰集团	1,100	7,370.00	0.01
273	688125	安达智能	200	7,340.00	0.01
274	600573	惠泉啤酒	600	7,332.00	0.01
275	000935	四川双马	400	7,288.00	0.01
276	301276	嘉曼服饰	400	7,276.00	0.01
277	688512	慧智微	656	7,156.96	0.01
278	301080	百普赛斯	100	7,153.00	0.01
279	301488	豪恩汽电	100	7,080.00	0.01
280	002588	史丹利	800	7,048.00	0.01
281	300766	每日互动	200	6,988.00	0.01
282	300636	同和药业	900	6,912.00	0.01
283	688418	震有科技	261	6,906.06	0.01
284	000761	本钢板材	1,900	6,840.00	0.01
285	301196	唯科科技	100	6,767.00	0.01
286	688636	智明达	200	6,758.00	0.01
287	688161	威高骨科	252	6,751.08	0.01
288	688393	安必平	234	6,725.16	0.01
289	301266	宇邦新材	200	6,686.00	0.01
290	688618	三旺通信	274	6,685.60	0.01
291	300609	汇纳科技	200	6,684.00	0.01
292	688232	新点软件	222	6,668.88	0.01
293	688793	倍轻松	200	6,658.00	0.01
294	300332	天壕能源	1,300	6,578.00	0.01
295	002326	永太科技	500	6,435.00	0.01
296	688310	迈得医疗	432	6,367.68	0.01
297	603712	七一二	300	6,303.00	0.01
298	301257	普蕊斯	200	6,160.00	0.01
299	300827	上能电气	200	6,110.00	0.01
300	605289	罗曼股份	200	6,010.00	0.01
301	300617	安靠智电	200	5,994.00	0.01
302	300999	金龙鱼	200	5,906.00	0.01
303	688551	科威尔	200	5,878.00	0.01
304	002753	永东股份	800	5,728.00	0.01
305	603661	恒林股份	200	5,720.00	0.01
306	603882	金域医学	200	5,712.00	0.01
307	002605	姚记科技	200	5,580.00	0.01
308	688338	赛科希德	220	5,539.60	0.01
309	002658	雪迪龙	700	5,481.00	0.01
310	001210	金房能源	400	5,476.00	0.01
311	601169	北京银行	800	5,464.00	0.01

312	300166	东方国信	500	5,450.00	0.01
313	300094	国联水产	1,500	5,445.00	0.01
314	603919	金徽酒	300	5,430.00	0.01
315	688132	邦彦技术	267	5,420.10	0.01
316	002949	华阳国际	400	5,392.00	0.01
317	605068	明新旭腾	300	5,391.00	0.01
318	002212	天融信	700	5,390.00	0.01
319	688030	山石网科	337	5,388.63	0.01
320	600416	湘电股份	400	5,376.00	0.01
321	688033	天宜新材	837	5,365.17	0.01
322	002419	天虹股份	1,000	5,360.00	0.01
323	300075	数字政通	300	5,346.00	0.01
324	605086	龙高股份	200	5,324.00	0.01
325	600172	黄河旋风	1,200	5,316.00	0.01
326	601229	上海银行	500	5,305.00	0.01
327	600966	博汇纸业	1,200	5,304.00	0.01
328	000503	国新健康	500	5,285.00	0.01
329	600230	沧州大化	500	5,265.00	0.01
330	001979	招商蛇口	600	5,262.00	0.01
331	002279	久其软件	800	5,240.00	0.01
332	002033	丽江股份	600	5,232.00	0.01
333	301100	风光股份	300	5,226.00	0.01
334	002291	遥望科技	800	5,224.00	0.01
335	002344	海宁皮城	1,200	5,208.00	0.01
336	301221	光庭信息	100	5,197.00	0.01
337	002019	亿帆医药	400	5,196.00	0.01
338	600571	信雅达	300	5,178.00	0.01
339	002446	盛路通信	700	5,166.00	0.01
340	300170	汉得信息	300	5,163.00	0.01
341	002824	和胜股份	300	5,160.00	0.01
341	600335	国机汽车	800	5,160.00	0.01
341	600642	申能股份	600	5,160.00	0.01
342	000715	中兴商业	900	5,157.00	0.01
343	600918	中泰证券	800	5,144.00	0.01
344	300894	火星人	400	5,132.00	0.01
345	301127	武汉天源	300	5,127.00	0.01
346	600425	青松建化	1,400	5,124.00	0.01
347	603867	新化股份	200	5,116.00	0.01
348	601686	友发集团	900	5,112.00	0.01
349	000617	中油资本	700	5,110.00	0.01
349	603881	数据港	200	5,110.00	0.01
350	000877	天山股份	1,100	5,104.00	0.01
351	300355	蒙草生态	1,200	5,100.00	0.01

351	601360	三六零	500	5,100.00	0.01
352	301526	国际复材	1,400	5,096.00	0.01
353	002494	华斯股份	1,000	5,090.00	0.01
354	600273	嘉化能源	600	5,076.00	0.01
355	601988	中国银行	900	5,058.00	0.01
356	603626	科森科技	600	5,052.00	0.01
357	603191	望变电气	400	5,048.00	0.01
358	603267	鸿远电子	100	5,027.00	0.01
359	600438	通威股份	300	5,025.00	0.01
360	000928	中钢国际	800	5,024.00	0.01
361	000690	宝新能源	1,100	5,005.00	0.01
362	002046	国机精工	300	5,004.00	0.01
362	002101	广东鸿图	400	5,004.00	0.01
363	600266	城建发展	1,100	4,994.00	0.01
364	300015	爱尔眼科	400	4,992.00	0.01
365	002637	赞宇科技	500	4,990.00	0.01
366	002918	蒙娜丽莎	600	4,980.00	0.01
367	601121	宝地矿业	800	4,976.00	0.01
368	000404	长虹华意	700	4,970.00	0.01
369	002493	荣盛石化	600	4,968.00	0.01
370	603112	华翔股份	300	4,962.00	0.01
371	002100	天康生物	800	4,952.00	0.01
371	603908	牧高笛	200	4,952.00	0.01
372	002225	濮耐股份	1,000	4,950.00	0.01
373	002546	新联电子	900	4,941.00	0.01
374	002398	垒知集团	1,000	4,940.00	0.01
375	002583	海能达	400	4,924.00	0.01
376	000531	穗恒运 A	800	4,920.00	0.01
376	601886	江河集团	800	4,920.00	0.01
377	300271	华宇软件	600	4,896.00	0.01
378	300190	维尔利	1,400	4,886.00	0.01
379	001328	登康口腔	100	4,884.00	0.01
380	301273	瑞晨环保	200	4,880.00	0.01
380	301289	国缆检测	100	4,880.00	0.01
381	301039	中集车辆	600	4,878.00	0.01
381	603878	武进不锈	900	4,878.00	0.01
382	603909	建发合诚	500	4,870.00	0.01
383	002452	长高电新	700	4,865.00	0.01
384	603866	桃李面包	900	4,860.00	0.01
385	000059	华锦股份	900	4,851.00	0.01
386	301306	西测测试	100	4,850.00	0.01
387	001339	智微智能	100	4,833.00	0.01
388	300295	三六五网	300	4,824.00	0.01

389	301296	新巨丰	500	4,805.00	0.01
390	601328	交通银行	600	4,800.00	0.01
391	603906	龙蟠科技	300	4,797.00	0.01
392	688223	晶科能源	923	4,790.37	0.01
393	001358	兴欣新材	200	4,786.00	0.01
394	603066	音飞储存	400	4,784.00	0.01
395	301333	诺思格	100	4,781.00	0.01
396	000526	学大教育	100	4,775.00	0.01
397	300088	长信科技	800	4,768.00	0.01
398	301270	汉仪股份	100	4,766.00	0.01
399	301303	真兰仪表	300	4,764.00	0.01
399	601200	上海环境	600	4,764.00	0.01
400	600016	民生银行	1,000	4,750.00	0.01
401	603260	合盛硅业	100	4,740.00	0.01
402	000055	方大集团	1,100	4,730.00	0.01
402	600395	盘江股份	1,000	4,730.00	0.01
403	002929	润建股份	100	4,726.00	0.01
404	001203	大中矿业	500	4,725.00	0.01
404	605008	长鸿高科	300	4,725.00	0.01
405	601939	建设银行	500	4,720.00	0.01
406	000810	创维数字	400	4,712.00	0.01
406	600997	开滦股份	800	4,712.00	0.01
407	603536	惠发食品	500	4,700.00	0.01
408	002544	普天科技	200	4,690.00	0.01
409	000516	国际医学	900	4,689.00	0.01
410	002772	众兴菌业	600	4,686.00	0.01
411	002368	太极股份	200	4,684.00	0.01
412	600508	上海能源	400	4,680.00	0.01
413	301193	家联科技	300	4,671.00	0.01
414	603190	亚通精工	200	4,652.00	0.01
415	002454	松芝股份	600	4,632.00	0.01
416	603989	艾华集团	300	4,620.00	0.01
417	600675	中华企业	1,600	4,608.00	0.01
418	002205	国统股份	400	4,600.00	0.01
419	300575	中旗股份	700	4,592.00	0.01
420	600371	万向德农	500	4,585.00	0.01
421	600063	皖维高新	1,000	4,580.00	0.01
422	002315	焦点科技	100	4,569.00	0.01
423	300226	上海钢联	200	4,568.00	0.01
424	002145	中核钛白	1,100	4,565.00	0.01
425	002548	金新农	1,200	4,560.00	0.01
425	300610	晨化股份	400	4,560.00	0.01
425	600176	中国巨石	400	4,560.00	0.01

425	688210	统联精密	200	4,560.00	0.01
426	603757	大元泵业	200	4,556.00	0.01
427	603558	健盛集团	500	4,555.00	0.01
428	601398	工商银行	600	4,554.00	0.01
429	603088	宁波精达	500	4,545.00	0.01
430	301161	唯万密封	200	4,538.00	0.01
431	002286	保龄宝	400	4,532.00	0.01
431	300106	西部牧业	400	4,532.00	0.01
432	600125	铁龙物流	800	4,528.00	0.01
433	300101	振芯科技	200	4,526.00	0.01
434	001308	康冠科技	200	4,524.00	0.01
434	002060	广东建工	1,300	4,524.00	0.01
435	300996	普联软件	300	4,509.00	0.01
436	600167	联美控股	800	4,496.00	0.01
437	002396	星网锐捷	200	4,490.00	0.01
438	002723	小崧股份	600	4,482.00	0.01
439	688335	复洁环保	367	4,477.40	0.01
440	603601	再升科技	1,100	4,466.00	0.01
441	003020	立方制药	200	4,464.00	0.01
441	300978	东箭科技	400	4,464.00	0.01
441	600577	精达股份	600	4,464.00	0.01
442	688553	汇宇制药	274	4,463.46	0.01
443	002296	辉煌科技	400	4,460.00	0.01
443	002606	大连电瓷	500	4,460.00	0.01
444	603185	弘元绿能	300	4,455.00	0.01
445	000726	鲁泰 A	700	4,438.00	0.01
446	600216	浙江医药	300	4,437.00	0.01
447	600115	中国东航	1,100	4,433.00	0.01
448	300562	乐心医疗	300	4,425.00	0.01
449	600908	无锡银行	700	4,417.00	0.01
450	300912	凯龙高科	300	4,407.00	0.01
451	603062	麦加芯彩	100	4,397.00	0.01
452	603863	松炆资源	300	4,395.00	0.01
453	603727	博迈科	300	4,389.00	0.01
454	601658	邮储银行	800	4,376.00	0.01
455	600409	三友化工	900	4,374.00	0.01
456	688599	天合光能	301	4,373.53	0.01
457	603057	紫燕食品	200	4,372.00	0.01
458	300659	中孚信息	300	4,362.00	0.01
459	600821	金开新能	800	4,344.00	0.01
460	300825	阿尔特	400	4,324.00	0.01
461	000920	沃顿科技	400	4,320.00	0.01
462	600585	海螺水泥	200	4,294.00	0.01

463	600649	城投控股	1,000	4,290.00	0.01
464	002803	吉宏股份	300	4,278.00	0.01
465	000828	东莞控股	400	4,276.00	0.01
466	605598	上海港湾	200	4,274.00	0.01
467	600071	凤凰光学	200	4,272.00	0.01
468	603896	寿仙谷	200	4,266.00	0.01
469	688303	大全能源	200	4,264.00	0.01
470	601998	中信银行	500	4,250.00	0.01
471	603383	顶点软件	100	4,240.00	0.01
472	300880	迦南智能	200	4,236.00	0.01
473	300514	友讯达	300	4,224.00	0.01
474	603639	海利尔	300	4,215.00	0.01
475	603689	皖天然气	500	4,210.00	0.01
476	600337	美克家居	1,900	4,199.00	0.01
477	300790	宇瞳光学	200	4,182.00	0.01
478	688015	交控科技	200	4,168.00	0.01
479	603970	中农立华	300	4,155.00	0.01
480	301210	金杨股份	100	4,154.00	0.01
481	688398	赛特新材	200	4,142.00	0.01
482	300861	美畅股份	200	4,066.00	0.01
483	603466	风语筑	400	4,036.00	0.01
484	300859	西域旅游	100	4,027.00	0.01
485	601186	中国铁建	500	4,005.00	0.01
486	600971	恒源煤电	600	3,960.00	0.01
487	603518	锦泓集团	400	3,952.00	0.01
488	603886	元祖股份	300	3,921.00	0.01
489	688006	杭可科技	200	3,900.00	0.01
490	300354	东华测试	100	3,888.00	0.01
491	002099	海翔药业	700	3,850.00	0.01
492	688085	三友医疗	200	3,846.00	0.01
493	605399	晨光新材	300	3,834.00	0.01
494	605376	博迁新材	100	3,833.00	0.01
495	600020	中原高速	800	3,824.00	0.01
496	300303	聚飞光电	600	3,804.00	0.01
497	603678	火炬电子	100	3,803.00	0.01
498	600446	金证股份	200	3,794.00	0.01
499	002384	东山精密	100	3,777.00	0.01
500	601601	中国太保	100	3,751.00	0.01
501	603429	集友股份	400	3,748.00	0.01
502	600168	武汉控股	800	3,720.00	0.01
503	003011	海象新材	200	3,674.00	0.01
504	002014	永新股份	300	3,636.00	0.01
505	001965	招商公路	300	3,600.00	0.01

506	300497	富祥药业	400	3,596.00	0.01
507	301272	英华特	100	3,590.00	0.01
508	600551	时代出版	400	3,568.00	0.01
509	601688	华泰证券	200	3,562.00	0.01
510	300130	新国都	100	3,553.00	0.01
511	600033	福建高速	1,000	3,540.00	0.01
512	301263	泰恩康	100	3,539.00	0.01
513	688355	明志科技	200	3,514.00	0.01
514	301076	新瀚新材	100	3,478.00	0.01
515	688315	诺禾致源	245	3,459.40	0.01
516	603068	博通集成	100	3,450.00	0.01
517	301230	泓博医药	100	3,442.00	0.01
518	300768	迪普科技	200	3,430.00	0.01
519	600584	长电科技	100	3,369.00	0.01
520	000776	广发证券	200	3,362.00	0.01
521	688371	菲沃泰	203	3,361.68	0.01
522	600740	山西焦化	900	3,339.00	0.01
523	688403	汇成股份	321	3,335.19	0.01
524	300109	新开源	200	3,318.00	0.01
525	300868	杰美特	100	3,312.00	0.01
526	603050	科林电气	200	3,292.00	0.01
527	603798	康普顿	300	3,264.00	0.01
528	000063	中兴通讯	100	3,249.00	0.01
529	002074	国轩高科	100	3,246.00	0.01
530	688448	磁谷科技	110	3,221.90	0.01
531	002264	新华都	500	3,175.00	0.01
532	300654	世纪天鸿	300	3,144.00	0.01
532	603590	康辰药业	100	3,144.00	0.01
533	600708	光明地产	900	3,087.00	0.01
534	002985	北摩高科	100	3,025.00	0.01
535	300547	川环科技	100	3,022.00	0.01
536	603279	景津装备	200	2,986.00	0.01
537	600557	康缘药业	200	2,956.00	0.01
538	301091	深城交	100	2,924.00	0.01
539	603566	普莱柯	200	2,722.00	0.01
540	601956	东贝集团	400	2,600.00	0.00
541	605089	味知香	100	2,484.00	0.00
542	002096	易普力	200	2,482.00	0.00
543	601339	百隆东方	500	2,360.00	0.00
544	600475	华光环能	200	2,084.00	0.00
545	002734	利民股份	100	1,830.00	0.00
546	300993	玉马科技	100	1,516.00	0.00
547	603101	汇嘉时代	200	1,500.00	0.00

548	600350	山东高速	100	1,066.00	0.00
549	000612	焦作万方	100	774.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601665	齐鲁银行	1,243,746.00	2.50
2	000785	居然智家	1,174,849.00	2.36
3	300373	扬杰科技	1,117,848.00	2.24
4	300251	光线传媒	1,115,928.00	2.24
5	688469	芯联集成	1,098,478.16	2.20
6	002966	苏州银行	1,088,679.00	2.18
7	000959	首钢股份	1,076,455.00	2.16
8	601577	长沙银行	1,075,657.00	2.16
9	603129	春风动力	1,069,475.00	2.15
10	000683	博源化工	1,065,068.00	2.14
11	688017	绿的谐波	1,060,706.98	2.13
12	002065	东华软件	1,059,567.00	2.13
13	603885	吉祥航空	1,052,819.00	2.11
14	300207	欣旺达	1,051,698.00	2.11
15	600208	衢州发展	1,044,602.00	2.10
16	002958	青农商行	1,032,609.00	2.07
17	000060	中金岭南	1,025,372.00	2.06
18	002558	巨人网络	1,021,236.00	2.05
19	600737	中粮糖业	1,016,394.00	2.04
20	600820	隧道股份	1,009,338.00	2.02
21	688297	中无人机	1,004,785.51	2.02
22	300136	信维通信	1,003,754.00	2.01
23	000050	深天马 A	999,789.00	2.01

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601665	齐鲁银行	1,326,033.00	2.66
2	300373	扬杰科技	1,139,151.00	2.29
3	688469	芯联集成	1,137,137.25	2.28
4	002966	苏州银行	1,126,465.00	2.26
5	300207	欣旺达	1,123,512.00	2.25



6	002625	光启技术	1, 107, 317. 00	2. 22
7	000729	燕京啤酒	1, 101, 585. 00	2. 21
8	600350	山东高速	1, 074, 880. 00	2. 16
9	000050	深天马 A	1, 055, 664. 00	2. 12
10	000683	博源化工	1, 046, 182. 00	2. 10
11	002532	天山铝业	1, 042, 742. 00	2. 09
12	300251	光线传媒	1, 040, 297. 00	2. 09
13	000959	首钢股份	1, 038, 470. 00	2. 08
14	300676	华大基因	1, 038, 244. 00	2. 08
15	000785	居然智家	1, 032, 781. 00	2. 07
16	603156	养元饮品	1, 029, 375. 00	2. 07
17	601577	长沙银行	1, 023, 824. 00	2. 05
18	002958	青农商行	1, 015, 857. 00	2. 04
19	600704	物产中大	1, 006, 331. 00	2. 02
20	002683	广东宏大	1, 002, 895. 00	2. 01
21	300476	胜宏科技	1, 002, 531. 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。

### 7.4.3 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	427, 634, 535. 82
卖出股票收入（成交）总额	428, 293, 260. 74

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2, 527. 13	0. 00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2, 527. 13	0. 00

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123255	鼎龙转债	14	1,927.09	0.00
2	123257	安克转债	6	600.04	0.00

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 7.10 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 and 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 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，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行的处罚；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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	512,610.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,297.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	521,907.51

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	565	72,584.99	11,778,937.15	28.72	29,231,583.08	71.28
华安中证 500 指数增强 C	789	23,557.91	3,128,617.45	16.83	15,458,572.96	83.17
合计	1,354	44,016.03	14,907,554.60	25.01	44,690,156.04	74.99

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）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安中证 500 指数增强 A	2,717,924.95	6.63
	华安中证 500 指数增强 C	353,410.18	1.90
	合计	3,071,335.13	5.15

## 8.3 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

## § 9 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	30,836,787.07	27,232,752.13
本报告期基金总申购份额	15,679,792.81	5,484,140.19
减：本报告期基金总赎回份额	5,506,059.65	14,129,701.91
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金	41,010,520.23	18,587,190.41

份额总额		
------	--	--

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	2	855,927,796	100.00	158,345.13	100.00	-

		. 56				
--	--	------	--	--	--	--

注：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。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
广发证 券	56,884.71	100.00	—	—	—	—

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2025 年 1 月 22 日
2	华安中证 500 指数增强型证券投资基金（华安中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 28 日
3	华安中证 500 指数增强型证券投资基金（华安中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 28 日
4	华安中证 500 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2025 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	2025 年 2 月 28 日
5	华安基金管理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）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
6	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
7	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
8	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
9	华安中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 22 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。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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；

### 12.2 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>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日