

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资
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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安沪深 300ETF
场内简称	HS300(扩位简称:沪深 300ETF 指数基金)
基金主代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 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	474,683,016.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、组合复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期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。

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@huanan.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	深圳市深南大道 7088 号招商银

	纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	13,719,726.51
本期利润	7,319,043.41
加权平均基金份额本期利润	0.0121
本期加权平均净值利润率	1.10%
本期基金份额净值增长率	1.23%
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	51,524,410.07
期末可供分配基金份额利润	0.1085
期末基金资产净值	535,654,938.59
期末基金份额净值	1.1284
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	12.84%

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）。

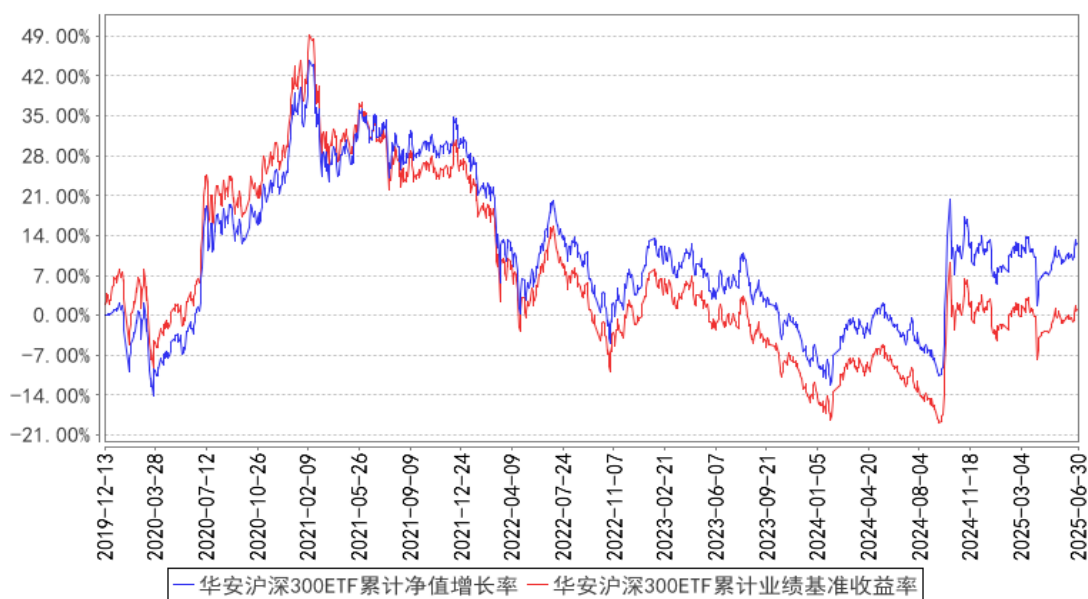
3.2 基金净值表现

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

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	3.30%	0.58%	2.50%	0.58%	0.80%	0.00%
过去三个月	2.31%	1.10%	1.25%	1.10%	1.06%	0.00%
过去六个月	1.23%	1.02%	0.03%	1.02%	1.20%	0.00%
过去一年	16.91%	1.38%	13.71%	1.38%	3.20%	0.00%
过去三年	-5.83%	1.10%	-12.24%	1.10%	6.41%	0.00%
自基金合同生效起至今	12.84%	1.20%	1.16%	1.21%	11.68%	-0.01%

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

华安沪深300ETF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		
顾昕	本基金的基金经理	2024 年 6 月 17 日	-	8 年	硕士研究生，8 年基金行业从业经验。2017 年 3 月应届毕业生加入华安基金，历任指数与量化投资部 ETF 研究员、基金经理助理。2023 年 11 月起，担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起，同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 5 月，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2024 年 8 月起，同时担任华安中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华安北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安中证云计算与大数据主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 上半年国内经济具有较强韧性，GDP 同比增长 5.3%，这一增长态势是在复杂外部环境下取得的，体现了宏观政策逆周期调节的效果。受海内外多重因素交织影响，A 股市场上半年呈现“N 型”震荡走势，沪深 300 指数小幅收涨。报告期内沪深 300 指数上涨 0.03%。

本基金跟踪沪深 300 指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1284 元，本报告期份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准增长率为 0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场有望在流动性充裕与基本面改善等因素的作用下延续向好态势。从流动性来看，市场风险偏好回升，两融资金以及中长期资金有望持续流入资本市场，叠加美联储下半年有望降息，资金层面或得到较强支撑。从基本面来看，短期出口或保持韧性，政策支持下内需得到改善，促使基本面稳中向好。

沪深 300 指数作为 A 股市场的基准宽基指数，是国内核心资产的代表，亦是机构持仓的重点方向，当前具备较高的配置价值。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人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，本基金无需要说明的情形。

§ 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：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,837,628.18	11,913,088.89
结算备付金		3,785,926.42	4,231,640.91
存出保证金		1,587,754.92	2,102,011.44
交易性金融资产	6.4.7.2	521,325,349.84	782,283,185.90
其中：股票投资		521,325,349.84	782,283,185.90
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	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		6,183,709.50	1,720,784.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		542,720,368.86	802,250,711.32
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
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		5,347,055.90	68,790.81
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		69,524.37	103,139.89
应付托管费		23,174.77	34,379.97
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	1,625,675.23	941,313.15
负债合计		7,065,430.27	1,147,623.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	474,683,016.00	718,683,016.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	60,971,922.59	82,420,071.50
净资产合计		535,654,938.59	801,103,087.50
负债和净资产总计		542,720,368.86	802,250,711.32

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1284 元，基金份额总额 474,683,016.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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
一、营业总收入		8,121,377.03	11,249,646.61
1. 利息收入		42,566.32	31,952.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,566.32	31,952.07
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）		14,402,816.34	-1,882,918.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,189,064.75	-6,339,137.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	13,274.90	-
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	-361,020.39	305,213.12
股利收益	6.4.7.13	7,561,497.08	4,151,005.95
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		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-6,400,683.10	12,983,362.98
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	76,677.47	117,249.64
减：二、营业总支出		802,333.62	536,575.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	496,179.23	280,831.58
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	165,393.06	93,610.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		0.02	1,100.13
8. 其他费用	6.4.7.17	140,761.31	161,033.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,319,043.41	10,713,071.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,319,043.41	10,713,071.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,319,043.41	10,713,071.31

6.3 净资产变动表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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	718,683,016.00	-	82,420,071.50	801,103,087.50

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	718,683,016.00	-	82,420,071.50	801,103,087.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-21,448,148.91	-265,448,148.91
244,000,000.00				
(一)、综合收益总额	-	-	7,319,043.41	7,319,043.41
(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)	-	-	-28,767,192.32	-272,767,192.32
244,000,000.00				
其中：1. 基金申购款	44,000,000.00	-	3,127,925.27	47,127,925.27
2. 基金赎回款	-	-	-31,895,117.59	-319,895,117.59
288,000,000.00				
(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	474,683,016.00	-	60,971,922.59	535,654,938.59
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	374,683,016.00	-	-19,254,645.04	355,428,370.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	374,683,016.00	-	-19,254,645.04	355,428,370.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	40,000,000.00	-	4,831,976.84	44,831,976.84
(一)、综合收益总额	-	-	10,713,071.31	10,713,071.31
(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)	40,000,000.00	-	-5,881,094.47	34,118,905.53
其中：1. 基金申购款	196,000,000.00	-	-9,934,068.13	186,065,931.87
2. 基金赎回款	- 156,000,000.00	-	4,052,973.66	-151,947,026.34
(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	414,683,016.00	-	-14,422,668.20	400,260,347.80

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

基金管理人负责人

朱学华

主管会计工作负责人

陈松一

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1823 号文《关于准予华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2019 年 12 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 442,683,016.00 份基金份额。

本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股（含存托凭证）及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（包括中小板、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）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分、可交换债）、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及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：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金标的指数为沪深 300 指数。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转

让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	9,837,628.18
等于：本金	9,836,571.07
加：应计利息	1,057.11
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	9,837,628.18

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	503,920,822.27	-	521,325,349.84	17,404,527.57
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	503,920,822.27	-	521,325,349.84	17,404,527.57

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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	12,497,244.00	-	-	
其中：股指期货投资	12,497,244.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	12,497,244.00	-	-	

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
IF2509	IF2509	9.00	10,494,900.00	254,016.00
IF2512	IF2512	2.00	2,313,960.00	57,600.00
合计				311,616.00
减：可抵销期货暂收款				311,616.00
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	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,446.10
其中：交易所市场	39,446.10
银行间市场	-
应付利息	-
应付替代款	1,496,968.98
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	1,625,675.23

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

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

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	718,683,016.00	718,683,016.00
本期申购	44,000,000.00	44,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-288,000,000.00	-288,000,000.00
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	474,683,016.00	474,683,016.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,776,149.17	21,643,922.33	82,420,071.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	60,776,149.17	21,643,922.33	82,420,071.50
本期利润	13,719,726.51	-6,400,683.10	7,319,043.41
本期基金份额交易产生的变动数	-22,971,465.61	-5,795,726.71	-28,767,192.32
其中：基金申购款	4,106,430.30	-978,505.03	3,127,925.27
基金赎回款	-27,077,895.91	-4,817,221.68	-31,895,117.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,524,410.07	9,447,512.52	60,971,922.59

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		19,488.86
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		22,878.17
其他		199.29
合计		42,566.32

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		968,348.11
股票投资收益——赎回差价收入		6,220,716.64
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		7,189,064.75

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		147,163,155.23

减：卖出股票成本总额	146,070,892.55
减：交易费用	123,914.57
买卖股票差价收入	968,348.11

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	319,895,117.59
减：现金支付赎回款总额	114,867,371.59
减：赎回股票成本总额	198,807,029.36
减：交易费用	-
赎回差价收入	6,220,716.64

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

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	8.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,266.37
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	13,274.90

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	103,979.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	90,700.00
减：应计利息总额	8.75
减：交易费用	4.22
买卖债券差价收入	13,266.37

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	-361,020.39

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	7,561,497.08
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	7,561,497.08

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	-6,914,739.10
股票投资	-6,914,739.10
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	514,056.00
权证投资	-
期货投资	514,056.00
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	-6,400,683.10

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	-
替代损益收入	76,677.47
合计	76,677.47

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,274.33
指数使用费	49,226.83
合计	140,761.31

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。

根据国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰君安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“国泰君安证券股份有限公司”。

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

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

金额单位：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	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)
国泰君安证券股份有 限公司	-	-	7,795,577.03	4.63
国泰海通证券股份有 限公司	-	-	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安证券股 份有限公司	7,295.78	4.62	7,295.78	4.62

注：(1) 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

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	496,179.23	280,831.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	62,862.74	7,440.67
应支付基金管理人的净管理费	433,316.49	273,390.91

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	165,393.06	93,610.53

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例（%）
国泰海通证 券股份有限 公司	4,764,707.00	1.00	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	8,316,707.00	1.16
招商银行股 份有限公司 — 华安沪深 300交易型开 放式指数证 券投资基金 发起式联接 基金	150,204,900.00	31.64	186,926,300.00	26.01

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	9,837,628.18	19,488.86	10,674,710.68	11,708.68
------	--------------	-----------	---------------	-----------

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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，其预期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（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，从而能够紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持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、结算备付金及存出保证金等。

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	9,837,628.18	-	-	-	9,837,628.18
结算备付金	3,785,926.42	-	-	-	3,785,926.42
存出保证金	50,691.72	-	-	1,537,063.20	1,587,754.92
交易性金融资产	-	-	-	-521,325,349.84	521,325,349.84
应收清算款	-	-	-	6,183,709.50	6,183,709.50
资产总计	13,674,246.32	-	-	-529,046,122.54	542,720,368.86
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	69,524.37	69,524.37
应付托管费	-	-	-	23,174.77	23,174.77
应付清算款	-	-	-	5,347,055.90	5,347,055.90
其他负债	-	-	-	1,625,675.23	1,625,675.23
负债总计	-	-	-	7,065,430.27	7,065,430.27
利率敏感度缺口	13,674,246.32	-	-	-521,980,692.27	535,654,938.59
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	11,913,088.89	-	-	-	11,913,088.89
结算备付金	4,231,640.91	-	-	-	4,231,640.91
存出保证金	130,665.84	-	-	1,971,345.60	2,102,011.44
交易性金融资产	-	-	-	-782,283,185.90	782,283,185.90
应收清算款	-	-	-	1,720,784.18	1,720,784.18
资产总计	16,275,395.64	-	-	-785,975,315.68	802,250,711.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	103,139.89	103,139.89
应付托管费	-	-	-	34,379.97	34,379.97
应付清算款	-	-	-	68,790.81	68,790.81
其他负债	-	-	-	941,313.15	941,313.15
负债总计	-	-	-	1,147,623.82	1,147,623.82
利率敏感度缺口	16,275,395.64	-	-	-784,827,691.86	801,103,087.50

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，本基金未持有交易性债券投资(2024 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(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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 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	521,325,349.84	97.32	782,283,185.90	97.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	521,325,349.84	97.32	782,283,185.90	97.65

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%	26,883,782.46	39,939,691.32
	业绩比较基准下降 5%	-26,883,782.46	-39,939,691.32

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	521,325,349.84	781,009,577.90
第二层次	-	1,273,608.00
第三层次	-	-
合计	521,325,349.84	782,283,185.90

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。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交

易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

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

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	521,325,349.84	96.06
	其中:股票	521,325,349.84	96.06
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	13,623,554.60	2.51
8	其他各项资产	7,771,464.42	1.43
9	合计	542,720,368.86	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	5,140,280.00	0.96
B	采矿业	26,084,115.50	4.87
C	制造业	261,172,729.09	48.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,830,581.00	3.52
E	建筑业	9,782,388.00	1.83
F	批发和零售业	1,255,788.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	18,372,717.08	3.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,876,538.41	4.64
J	金融业	140,164,735.98	26.17
K	房地产业	3,846,648.94	0.72
L	租赁和商务服务业	4,746,160.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	5,600,520.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,452,147.84	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	521,325,349.84	97.32

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600519	贵州茅台	15,900	22,411,368.00	4.18
2	300750	宁德时代	65,971	16,639,205.62	3.11
3	601318	中国平安	269,308	14,941,207.84	2.79
4	600036	招商银行	309,528	14,222,811.60	2.66
5	601166	兴业银行	415,700	9,702,438.00	1.81
6	600900	长江电力	305,800	9,216,812.00	1.72
7	000333	美的集团	122,777	8,864,499.40	1.65
8	601899	紫金矿业	411,600	8,026,200.00	1.50
9	002594	比亚迪	22,600	7,501,166.00	1.40
10	300059	东方财富	316,402	7,318,378.26	1.37
11	600030	中信证券	244,150	6,743,423.00	1.26
12	601398	工商银行	876,500	6,652,635.00	1.24
13	600276	恒瑞医药	111,550	5,789,445.00	1.08
14	000858	五粮液	48,600	5,778,540.00	1.08
15	601211	国泰海通	282,810	5,418,639.60	1.01
16	601328	交通银行	667,200	5,337,600.00	1.00
17	000651	格力电器	112,000	5,031,040.00	0.94
18	601288	农业银行	798,700	4,696,356.00	0.88
19	600887	伊利股份	158,000	4,405,040.00	0.82
20	002475	立讯精密	126,859	4,400,738.71	0.82
21	688981	中芯国际	49,851	4,395,362.67	0.82
22	600919	江苏银行	367,140	4,383,651.60	0.82
23	603259	药明康德	62,820	4,369,131.00	0.82
24	601816	京沪高铁	734,300	4,222,225.00	0.79
25	600000	浦发银行	293,905	4,079,401.40	0.76
26	000725	京东方 A	918,400	3,664,416.00	0.68
27	002371	北方华创	7,900	3,493,459.00	0.65
28	300760	迈瑞医疗	15,400	3,461,150.00	0.65
29	601088	中国神华	82,580	3,347,793.20	0.62
30	688041	海光信息	23,235	3,282,873.15	0.61
31	688256	寒武纪	5,456	3,281,784.00	0.61
32	300308	中际旭创	22,160	3,232,257.60	0.60
33	601601	中国太保	85,800	3,218,358.00	0.60
34	300502	新易盛	24,840	3,155,176.80	0.59
35	300124	汇川技术	47,200	3,047,704.00	0.57

36	601728	中国电信	387,900	3,006,225.00	0.56
37	601668	中国建筑	516,600	2,980,782.00	0.56
38	600016	民生银行	620,200	2,945,950.00	0.55
39	002352	顺丰控股	60,350	2,942,666.00	0.55
40	000001	平安银行	242,800	2,930,596.00	0.55
41	002714	牧原股份	68,316	2,869,955.16	0.54
42	002230	科大讯飞	57,800	2,767,464.00	0.52
43	601127	赛力斯	20,300	2,726,696.00	0.51
44	603501	豪威集团	21,238	2,711,030.70	0.51
45	600031	三一重工	148,300	2,661,985.00	0.50
46	601229	上海银行	248,700	2,638,707.00	0.49
47	000063	中兴通讯	80,600	2,618,694.00	0.49
48	603019	中科曙光	36,680	2,582,272.00	0.48
49	002415	海康威视	92,300	2,559,479.00	0.48
50	600309	万华化学	47,086	2,554,886.36	0.48
51	600941	中国移动	22,600	2,543,630.00	0.47
52	601169	北京银行	369,900	2,526,417.00	0.47
53	300274	阳光电源	36,420	2,468,183.40	0.46
54	601857	中国石油	283,500	2,423,925.00	0.45
55	601919	中远海控	157,552	2,369,582.08	0.44
56	688008	澜起科技	28,803	2,361,846.00	0.44
57	600690	海尔智家	93,800	2,324,364.00	0.43
58	600660	福耀玻璃	40,300	2,297,503.00	0.43
59	601688	华泰证券	127,900	2,277,899.00	0.43
60	601012	隆基绿能	151,572	2,276,611.44	0.43
61	300498	温氏股份	132,923	2,270,324.84	0.42
62	002142	宁波银行	82,760	2,264,313.60	0.42
63	600406	国电南瑞	100,251	2,246,624.91	0.42
64	600809	山西汾酒	12,200	2,151,958.00	0.40
65	601766	中国中车	304,400	2,142,976.00	0.40
66	603986	兆易创新	16,844	2,131,271.32	0.40
67	601138	工业富联	99,100	2,118,758.00	0.40
68	600050	中国联通	390,800	2,086,872.00	0.39
69	000338	潍柴动力	135,300	2,080,914.00	0.39
70	000568	泸州老窖	18,142	2,057,302.80	0.38
71	600028	中国石化	364,600	2,056,344.00	0.38
72	000100	TCL 科技	469,590	2,033,324.70	0.38
73	601988	中国银行	358,300	2,013,646.00	0.38
74	601006	大秦铁路	302,700	1,997,820.00	0.37
75	600926	杭州银行	114,900	1,932,618.00	0.36
76	601818	光大银行	464,900	1,929,335.00	0.36
77	601985	中国核电	205,900	1,918,988.00	0.36
78	688012	中微公司	10,372	1,890,815.60	0.35

79	601225	陕西煤业	97,100	1,868,204.00	0.35
80	600104	上汽集团	115,800	1,858,590.00	0.35
81	002027	分众传媒	252,600	1,843,980.00	0.34
82	600150	中国船舶	55,800	1,815,732.00	0.34
83	601628	中国人寿	41,500	1,709,385.00	0.32
84	601009	南京银行	147,000	1,708,140.00	0.32
85	688111	金山办公	6,098	1,707,744.90	0.32
86	600999	招商证券	92,890	1,633,935.10	0.31
87	600760	中航沈飞	27,743	1,626,294.66	0.30
88	603288	海天味业	41,472	1,613,675.52	0.30
89	000425	徐工机械	205,710	1,598,366.70	0.30
90	601939	建设银行	167,800	1,584,032.00	0.30
91	000792	盐湖股份	92,700	1,583,316.00	0.30
92	000625	长安汽车	123,990	1,582,112.40	0.30
93	600111	北方稀土	63,500	1,581,150.00	0.30
94	600938	中国海油	59,900	1,563,989.00	0.29
95	605499	东鹏饮料	4,970	1,560,828.50	0.29
96	600905	三峡能源	358,300	1,526,358.00	0.28
97	688271	联影医疗	11,921	1,522,788.54	0.28
98	600089	特变电工	126,530	1,509,502.90	0.28
99	601658	邮储银行	275,800	1,508,626.00	0.28
100	601888	中国中免	24,400	1,487,668.00	0.28
101	600436	片仔癀	7,406	1,481,274.06	0.28
102	603993	洛阳钼业	175,900	1,481,078.00	0.28
103	002050	三花智控	55,920	1,475,169.60	0.28
104	600048	保利发展	179,700	1,455,570.00	0.27
105	300015	爱尔眼科	116,358	1,452,147.84	0.27
106	600019	宝钢股份	219,200	1,444,528.00	0.27
107	600547	山东黄金	45,100	1,440,043.00	0.27
108	601390	中国中铁	256,500	1,438,965.00	0.27
109	002463	沪电股份	33,700	1,434,946.00	0.27
110	002241	歌尔股份	61,300	1,429,516.00	0.27
111	600415	小商品城	68,400	1,414,512.00	0.26
112	601825	沪农商行	144,500	1,401,650.00	0.26
113	601600	中国铝业	198,600	1,398,144.00	0.26
114	300014	亿纬锂能	30,500	1,397,205.00	0.26
115	300033	同花顺	5,100	1,392,351.00	0.26
116	601989	中国重工	285,100	1,322,864.00	0.25
117	000977	浪潮信息	25,900	1,317,792.00	0.25
118	600585	海螺水泥	60,000	1,288,200.00	0.24
119	600893	航发动力	33,300	1,283,382.00	0.24
120	601916	浙商银行	376,600	1,276,674.00	0.24
121	600570	恒生电子	38,061	1,276,565.94	0.24

122	002179	中航光电	31,618	1,276,102.48	0.24
123	601838	成都银行	63,235	1,271,023.50	0.24
124	600958	东方证券	131,100	1,269,048.00	0.24
125	600015	华夏银行	159,400	1,260,854.00	0.24
126	603799	华友钴业	34,040	1,260,160.80	0.24
127	000776	广发证券	74,000	1,243,940.00	0.23
128	000538	云南白药	22,280	1,243,001.20	0.23
129	601336	新华保险	20,800	1,216,800.00	0.23
130	002311	海大集团	20,739	1,215,098.01	0.23
131	600584	长电科技	35,800	1,206,102.00	0.23
132	000938	紫光股份	50,140	1,202,858.60	0.22
133	002028	思源电气	15,800	1,151,978.00	0.22
134	002049	紫光国微	17,280	1,138,060.80	0.21
135	600438	通威股份	67,600	1,132,300.00	0.21
136	000166	申万宏源	224,800	1,128,496.00	0.21
137	601998	中信银行	132,500	1,126,250.00	0.21
138	300408	三环集团	33,500	1,118,900.00	0.21
139	300433	蓝思科技	50,000	1,115,000.00	0.21
140	601077	渝农商行	155,100	1,107,414.00	0.21
141	000002	万科 A	169,857	1,090,481.94	0.20
142	600795	国电电力	223,500	1,081,740.00	0.20
143	601377	兴业证券	172,290	1,066,475.10	0.20
144	600489	中金黄金	72,800	1,065,064.00	0.20
145	601669	中国电建	215,300	1,048,511.00	0.20
146	601995	中金公司	29,100	1,028,976.00	0.19
147	601689	拓普集团	21,670	1,023,907.50	0.19
148	600010	包钢股份	566,400	1,013,856.00	0.19
149	002422	科伦药业	28,100	1,009,352.00	0.19
150	002304	洋河股份	15,300	987,615.00	0.18
151	600009	上海机场	30,900	981,693.00	0.18
152	601100	恒立液压	13,504	972,288.00	0.18
153	600160	巨化股份	33,800	969,384.00	0.18
154	002460	赣锋锂业	28,500	962,445.00	0.18
155	000768	中航西飞	34,900	954,166.00	0.18
156	300394	天孚通信	11,700	934,128.00	0.17
157	601881	中国银河	54,100	927,815.00	0.17
158	601186	中国铁建	115,100	921,951.00	0.17
159	600183	生益科技	30,300	913,545.00	0.17
160	002252	上海莱士	132,800	912,336.00	0.17
161	000157	中联重科	124,400	899,412.00	0.17
162	601360	三六零	87,300	890,460.00	0.17
163	600989	宝丰能源	55,000	887,700.00	0.17
164	600886	国投电力	60,000	884,400.00	0.17

165	000963	华东医药	21,900	883,884.00	0.17
166	002074	国轩高科	27,200	882,912.00	0.16
167	601788	光大证券	49,000	881,020.00	0.16
168	688036	传音控股	10,981	875,185.70	0.16
169	300442	润泽科技	17,500	866,775.00	0.16
170	600115	中国东航	214,000	862,420.00	0.16
171	601058	赛轮轮胎	65,500	859,360.00	0.16
172	688169	石头科技	5,379	842,082.45	0.16
173	002466	天齐锂业	26,000	833,040.00	0.16
174	000408	藏格矿业	19,500	832,065.00	0.16
175	002736	国信证券	72,200	831,744.00	0.16
176	000807	云铝股份	51,900	829,362.00	0.15
177	600066	宇通客车	33,200	825,352.00	0.15
178	002001	新 和 成	38,556	820,086.12	0.15
179	601901	方正证券	102,900	813,939.00	0.15
180	600426	华鲁恒升	37,300	808,291.00	0.15
181	001979	招商蛇口	90,700	795,439.00	0.15
182	600029	南方航空	134,600	794,140.00	0.15
183	600196	复星医药	31,600	792,844.00	0.15
184	601800	中国交建	88,900	790,321.00	0.15
185	002236	大华股份	49,600	787,648.00	0.15
186	301236	软通动力	14,400	786,816.00	0.15
187	000975	山金国际	41,500	786,010.00	0.15
188	000661	长春高新	7,900	783,522.00	0.15
189	600674	川投能源	48,800	782,752.00	0.15
190	600011	华能国际	109,600	782,544.00	0.15
191	300661	圣邦股份	10,707	779,148.39	0.15
192	601066	中信建投	32,346	777,921.30	0.15
193	688126	沪硅产业	40,941	766,415.52	0.14
194	601878	浙商证券	68,600	748,426.00	0.14
195	600346	恒力石化	52,400	747,224.00	0.14
196	601111	中国国航	93,800	740,082.00	0.14
197	300418	昆仑万维	22,000	739,860.00	0.14
198	600372	中航机载	60,500	729,630.00	0.14
199	601868	中国能建	325,500	725,865.00	0.14
200	002648	卫星化学	41,860	725,433.80	0.14
201	603369	今世缘	18,600	724,098.00	0.14
202	003816	中国广核	197,300	718,172.00	0.13
203	600460	士兰微	28,700	712,334.00	0.13
204	002916	深南电路	6,521	703,029.01	0.13
205	600741	华域汽车	39,700	700,705.00	0.13
206	601117	中国化学	91,300	700,271.00	0.13
207	601319	中国人保	80,000	696,800.00	0.13

208	300896	爱美客	3,980	695,743.80	0.13
209	300347	泰格医药	12,900	687,828.00	0.13
210	600588	用友网络	51,380	686,950.60	0.13
211	600176	中国巨石	60,120	685,368.00	0.13
212	601021	春秋航空	12,300	684,495.00	0.13
213	002920	德赛西威	6,700	684,271.00	0.13
214	002601	龙佰集团	41,500	672,715.00	0.13
215	000786	北新建材	25,400	672,592.00	0.13
216	600219	南山铝业	175,051	670,445.33	0.13
217	601633	长城汽车	31,201	670,197.48	0.13
218	300782	卓胜微	9,220	658,031.40	0.12
219	600482	中国动力	28,400	655,188.00	0.12
220	688506	百利天恒	2,200	651,464.00	0.12
221	600039	四川路桥	65,180	645,282.00	0.12
222	301269	华大九天	5,200	644,176.00	0.12
223	000895	双汇发展	26,162	638,614.42	0.12
224	000630	铜陵有色	191,100	638,274.00	0.12
225	302132	中航成飞	7,200	633,168.00	0.12
226	600085	同仁堂	17,500	631,050.00	0.12
227	002493	荣盛石化	75,950	628,866.00	0.12
228	002129	TCL 中环	80,675	619,584.00	0.12
229	001965	招商公路	51,500	618,000.00	0.12
230	601877	正泰电器	27,100	614,357.00	0.11
231	600600	青岛啤酒	8,800	611,248.00	0.11
232	600362	江西铜业	26,000	609,180.00	0.11
233	002709	天赐材料	33,400	605,208.00	0.11
234	688396	华润微	12,786	602,987.76	0.11
235	002600	领益智造	69,900	600,441.00	0.11
236	603296	华勤技术	7,400	597,032.00	0.11
237	300122	智飞生物	29,650	580,843.50	0.11
238	688047	龙芯中科	4,300	573,577.00	0.11
239	002180	纳思达	25,000	573,500.00	0.11
240	000596	古井贡酒	4,300	572,545.00	0.11
241	603392	万泰生物	9,383	572,363.00	0.11
242	600161	天坛生物	29,540	566,872.60	0.11
243	600233	圆通速递	43,100	555,559.00	0.10
244	000301	东方盛虹	66,200	551,446.00	0.10
245	300832	新产业	9,700	550,184.00	0.10
246	002938	鹏鼎控股	17,100	547,713.00	0.10
247	300759	康龙化成	22,150	543,561.00	0.10
248	600188	兖矿能源	44,490	541,443.30	0.10
249	000999	华润三九	17,009	532,041.52	0.10
250	600023	浙能电力	100,100	530,530.00	0.10

251	601618	中国中冶	178,000	530,440.00	0.10
252	000876	新希望	56,500	529,970.00	0.10
253	688223	晶科能源	99,857	518,257.83	0.10
254	600875	东方电气	30,500	510,570.00	0.10
255	601872	招商轮船	81,000	507,060.00	0.09
256	600845	宝信软件	21,463	506,956.06	0.09
257	600515	海南机场	142,700	505,158.00	0.09
258	601898	中煤能源	45,900	502,146.00	0.09
259	002459	晶澳科技	50,101	500,007.98	0.09
260	600061	国投资本	63,704	479,054.08	0.09
261	688599	天合光能	32,810	476,729.30	0.09
262	601799	星宇股份	3,800	475,000.00	0.09
263	605117	德业股份	8,932	470,359.12	0.09
264	600027	华电国际	84,600	462,762.00	0.09
265	000617	中油资本	63,300	462,090.00	0.09
266	600332	白云山	17,400	458,664.00	0.09
267	000983	山西焦煤	71,500	457,600.00	0.09
268	300316	晶盛机电	16,600	450,690.00	0.08
269	600918	中泰证券	69,900	449,457.00	0.08
270	300999	金龙鱼	15,100	445,903.00	0.08
271	300628	亿联网络	12,710	441,799.60	0.08
272	600803	新奥股份	23,200	438,480.00	0.08
273	601698	中国卫通	21,200	433,964.00	0.08
274	600025	华能水电	44,900	428,795.00	0.08
275	603260	合盛硅业	8,800	417,120.00	0.08
276	601059	信达证券	24,300	415,530.00	0.08
277	601238	广汽集团	55,000	411,950.00	0.08
278	300413	芒果超媒	18,500	403,670.00	0.08
279	600018	上港集团	70,000	399,700.00	0.07
280	601607	上海医药	20,800	371,904.00	0.07
281	600026	中远海能	34,800	359,484.00	0.07
282	603195	公牛集团	7,065	340,886.25	0.06
283	688472	阿特斯	37,200	340,380.00	0.06
284	603806	福斯特	26,118	338,489.28	0.06
285	688303	大全能源	15,717	335,086.44	0.06
286	688009	中国通号	64,975	333,971.50	0.06
287	601699	潞安环能	30,000	316,500.00	0.06
288	601236	红塔证券	35,200	298,144.00	0.06
289	000708	中信特钢	25,300	297,528.00	0.06
290	688187	时代电气	6,799	289,977.35	0.05
291	601865	福莱特	18,800	285,948.00	0.05
292	601136	首创证券	13,800	274,344.00	0.05
293	688082	盛美上海	2,265	258,074.10	0.05

294	603833	欧派家居	4,280	241,606.00	0.05
295	601808	中海油服	15,100	207,776.00	0.04
296	600377	宁沪高速	12,500	191,750.00	0.04
297	300979	华利集团	3,400	178,738.00	0.03
298	000800	一汽解放	24,600	168,756.00	0.03
299	001391	国货航	21,700	146,041.00	0.03
300	001289	龙源电力	3,600	58,248.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601211	国泰海通	4,357,512.44	0.54
2	300750	宁德时代	2,373,826.00	0.30
3	688169	石头科技	2,311,275.13	0.29
4	601825	沪农商行	1,538,401.00	0.19
5	601166	兴业银行	1,519,742.00	0.19
6	601058	赛轮轮胎	1,460,992.00	0.18
7	688012	中微公司	1,298,592.80	0.16
8	002371	北方华创	1,296,255.00	0.16
9	000333	美的集团	1,248,314.99	0.16
10	300033	同花顺	1,225,745.00	0.15
11	601077	渝农商行	1,208,189.00	0.15
12	002594	比亚迪	889,837.00	0.11
13	002230	科大讯飞	822,062.00	0.10
14	301236	软通动力	809,263.00	0.10
15	300059	东方财富	792,335.00	0.10
16	601328	交通银行	788,517.00	0.10
17	302132	中航成飞	673,663.00	0.08
18	000651	格力电器	672,259.00	0.08
19	601006	大秦铁路	651,228.00	0.08
20	000858	五粮液	646,807.00	0.08

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	300750	宁德时代	11,262,188.00	1.41
2	000333	美的集团	5,859,338.00	0.73
3	002594	比亚迪	5,165,285.00	0.64
4	300059	东方财富	4,557,848.00	0.57
5	600837	海通证券	4,054,942.80	0.51
6	000858	五粮液	3,898,012.00	0.49
7	000651	格力电器	3,219,451.00	0.40
8	002371	北方华创	3,152,072.00	0.39
9	002475	立讯精密	3,077,759.00	0.38
10	300124	汇川技术	2,948,635.00	0.37
11	600519	贵州茅台	2,879,651.00	0.36
12	000725	京东方 A	2,506,381.00	0.31
13	300033	同花顺	2,118,872.00	0.26
14	300760	迈瑞医疗	2,107,690.00	0.26
15	000063	中兴通讯	1,858,737.00	0.23
16	002415	海康威视	1,808,517.00	0.23
17	000568	泸州老窖	1,808,127.00	0.23
18	000001	平安银行	1,797,999.00	0.22
19	688256	寒武纪	1,751,099.00	0.22
20	002714	牧原股份	1,701,444.00	0.21

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	62,294,450.56
卖出股票收入（成交）总额	147,163,155.23

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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，兴业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福建监管局的处罚。

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	1,587,754.92
2	应收清算款	6,183,709.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,771,464.42

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

本基金本报告期末指数投资前十名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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
7,403	64,120.36	216,137,551.00	45.53	258,545,465.00	54.47

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）。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
招商银行股份有限公司— 华安沪深 300 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	150,204,900.00	31.64

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	招商证券股份有限公司	12,289,445.00	2.59
2	宣忠安	7,000,000.00	1.47
3	中国农业银行股份有限公司—华安平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FO	6,887,900.00	1.45

4	广发证券股份有限公司	6,166,900.00	1.30
5	邓铁军	4,620,900.00	0.97
6	申万菱信基金—申万宏源证券有限公司—申万菱信前沿 1 号 FOF 单一资产管理计划	4,500,000.00	0.95
7	渤海人寿保险股份有限公司—分红保险十一	4,444,100.00	0.94
8	泰康人寿保险有限责任公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 沪	4,385,100.00	0.92
9	吕凡	4,188,800.00	0.88
10	夏文亚	4,000,000.00	0.84
11	招商银行股份有限公司—华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	150,204,900.00	31.64

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 12 月 13 日)基金份额总额	442,683,016.00
本报告期期初基金份额总额	718,683,016.00
本报告期基金总申购份额	44,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	288,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	474,683,016.00

§ 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 (%)	
招商证券	1	130,910,769.19	65.02	25,646.44	65.02	-
华泰证券	1	31,159,069.	15.47	6,104.07	15.47	-

		92				
平安证券	1	22,136,498.16	10.99	4,336.30	10.99	-
中信建投	2	17,147,694.92	8.52	3,359.29	8.52	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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。

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 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	103,979.34	53.41	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
野村东	-	-	-	-	-	-

方证券						
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	90,700.00	46.59	-	-	-	-

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	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 8 日
2	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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
3	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 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 1 月 22 日
4	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 17 日
5	关于华安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	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 19 日
6	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 19 日
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为一级交易商的公告	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 20 日
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	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 20 日
9	华安沪深 300 交易型开放式指数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 3 月 21 日
10	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 21 日
11	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
12	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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

13	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
14	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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
15	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
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 16 日
17	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 16 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

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 (%)
联接基金	1	20250101~20250630	186,926,300.00	8,290,300.00	45,011,700.00	150,204,900.00	31.64
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 交易型开放式指数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