

# 上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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
<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	5
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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
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	13
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	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
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	53
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60

<b>8 基金份额持有人信息</b>	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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的情况	63
<b>9 开放式基金份额变动</b>	64
<b>10 重大事件揭示</b>	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	64
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.9 其他重大事件	66
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b>	67
<b>12 备查文件目录</b>	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证 180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006 年 4 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,552,057,679.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2006 年 5 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	采取抽样复制的指数跟踪方法，即根据量化的选股指标，选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合，并通过优化模型确定投资组合中个股的权重，以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	上证 180 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用抽样复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险中等、收益中等的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区闹市口大街1号

	世纪大道8号国金中心二期31 —32层	院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市陆家嘴东路166号中保大厦36楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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（2022年1月1日至2022年6月30日）
本期已实现收益	24,053,672.74
本期利润	-1,413,557,360.00
加权平均基金份额本期利润	-0.2543
本期加权平均净值利润率	-6.82%
本期基金份额净值增长率	-6.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	15,565,683,094.43
期末可供分配基金份额利润	2.8036
期末基金资产净值	21,524,695,883.44
期末基金份额净值	3.8769
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	343.58%

注：1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额，不是当期发生数)。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.86%	0.99%	7.89%	0.99%	0.97%	0.00%
过去三个月	5.98%	1.32%	4.93%	1.31%	1.05%	0.01%
过去六个月	-6.19%	1.36%	-7.09%	1.36%	0.90%	0.00%
过去一年	-8.89%	1.17%	-10.76%	1.17%	1.87%	0.00%
过去三年	16.10%	1.19%	9.71%	1.20%	6.39%	-0.01%
自基金合同生效起至今	343.58%	1.66%	268.85%	1.68%	74.73%	-0.02%

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

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2006 年 4 月 13 日至 2022 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2022 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 206 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,985.16 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2009-09-05	-	18 年	理学博士，18 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师。2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富



				<p>黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金）、华安中证银行指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安中证银行指数型证券投资基金）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月，担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金（2021 年 1 月起转型为华安创业板 50 指数型证券投资基金）的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月起，同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 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发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵

从行业协会《证券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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
许之彦	公募基金	13.00	53,371,790,985.64	2008-04-25
	私募资产管理计划	2.00	264,820,355.84	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	15.00	53,636,611,341.48	

#### 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，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级

市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

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 12 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

回顾上半年经济走势，1-2 月经济数据好于预期，但 3 月以后全国多地疫情反扑，国内经济面临较大压力。5 月以来随着疫情防控向好，生产需求逐步恢复，基建投资增速明显回升，工业增加值普遍改善，消费也在逐步恢复。二季度 GDP 同比实现正增长，上半年 GDP 同比增长 2.5%。

市场方面，一季度市场出现较大调整，主要系外部事件冲击与对于经济增长压力的担忧等，市场风险偏好下行，权益资产波动较大。在稳增长的政策刺激下，4 月末以市场开启上涨，汽车、新能源、煤炭等行业表现突出。上半年上证 50 下跌 6.59%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 500 下跌 12.3%，上证 180 下跌 7.09%。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 3.8769 元，本报告期份额净值增长率为-6.19%，同期业绩比较基准增长率为-7.09%。

#### 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，在稳增长、宽信用和宽货币等政策下，投资、基建、工业生产等将加速修复，中下游的产能与需求将得到明显改善，外部因素对我国货币政策和利率水平的约束有望减弱。

下半年外围市场压力对 A 股的影响有所缓解，投资者对于经济的预期明显好转，风险偏好提升，需求边际改善的盈利高增长板块，受益于政策支持和需求恢复的行业值得关注。预期下半年 A 股盈利增长将逐渐回暖，估值与业绩匹配度高的行业将获得资金青睐。上证 180 指数成分股囊括了各个行业的优质资产，配置价值依然突出。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	101,907,413.97	48,892,471.71
结算备付金		245,156.99	185,716.61

存出保证金		137,060.58	100,023.32
交易性金融资产	6.4.7.2	21,469,544,565.54	22,855,694,874.57
其中：股票投资		21,464,308,175.35	22,824,978,874.57
基金投资		-	-
债券投资		5,236,390.19	30,716,000.00
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	-	-
应收清算款		2,662,262.78	413,566.40
应收股利		2,110,967.82	28,150.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	386,206.13	694,259.62
<b>资产总计</b>		<b>21,576,993,633.81</b>	<b>22,906,009,062.23</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		39,549,073.87	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,421,249.92	9,743,403.25
应付托管费		1,684,249.99	1,948,680.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,643,167.58	7,343,327.93
<b>负债合计</b>		<b>52,297,750.37</b>	<b>19,035,411.82</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	5,959,012,789.01	5,943,986,615.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	15,565,683,094.43	16,942,987,034.42
<b>净资产合计</b>		<b>21,524,695,883.44</b>	<b>22,886,973,650.41</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>21,576,993,633.81</b>	<b>22,906,009,062.23</b>

注：（1）报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.8769 元，基金份额总额 5,552,057,679.00 份。

(2) 以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-1,351,628,412.78</b>	<b>-26,808,512.51</b>
1.利息收入		7,322,091.28	122,969.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	120,151.75	111,030.14
债券利息收入		-	11,939.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		7,201,939.53	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		78,704,045.30	702,283,348.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-165,247,160.62	486,468,550.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	13,111,232.03	4,492,507.60
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	-	-
股利收益	6.4.7.13	230,839,973.89	211,322,290.42
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	-1,437,611,032.74	-729,239,085.88
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	-43,516.62	24,255.60
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>61,928,947.22</b>	<b>78,492,912.24</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	51,486,552.61	59,368,331.85
2. 托管费	6.4.10.2	10,297,310.56	11,873,666.34
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		18.58	11.10
8. 其他费用	6.4.7.16	145,065.47	7,250,902.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,413,557,360.00</b>	<b>-105,301,424.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,413,557,360.00</b>	<b>-105,301,424.75</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,413,557,360.00</b>	<b>-105,301,424.75</b>

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	5,943,986,615.99	-	16,942,987,034.42	22,886,973,650.41
二、本期期初净资产（基金净值）	5,943,986,615.99	-	16,942,987,034.42	22,886,973,650.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,026,173.02	-	1,377,303,939.99	-1,362,277,766.97
（一）、综合收益总额	-	-	1,413,557,360.00	-1,413,557,360.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	15,026,173.02	-	36,253,420.01	51,279,593.03
其中：1. 基金申	102,499,965.55	-	251,087,468.98	353,587,434.53



购款				
2.基金赎回款	-87,473,792.53	-	-214,834,048.97	-302,307,841.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,959,012,789.01	-	15,565,683,094.43	21,524,695,883.44
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	6,000,334,764.67	-	17,904,102,890.94	23,904,437,655.61
二、本期期初净资产(基金净值)	6,000,334,764.67	-	17,904,102,890.94	23,904,437,655.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-61,714,639.05	-	-299,358,798.30	361,073,437.35
(一)、综合收益总额	-	-	-105,301,424.75	105,301,424.75
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-61,714,639.05	-	-194,057,373.55	255,772,012.60
其中：1.基金申购款	109,476,402.89	-	328,059,431.00	437,535,833.89
2.基金赎回款	-171,191,041.94	-	-522,116,804.55	693,307,846.49
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,938,620,125.62	-	17,604,744,092.64	23,543,364,218.26

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：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,072,807,826.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,279.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2022 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资

资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 权益工具

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

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

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

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：(a) 金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 48,892,471.71 元、185,716.61 元、100,023.32 元、694,259.62 元、413,566.40 元和 28,150.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 48,899,917.63 元、185,800.21 元、100,068.32 元、686,011.87 元、413,566.40 元和 28,150.00

元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 22,855,694,874.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 22,855,695,547.80 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,743,403.25 元、1,948,680.64 元、7,044,000.75 元和 12,327.18 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,743,403.25 元、1,948,680.64 元、7,044,000.75 元和 12,327.18 元。(b) 修订后的《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>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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



值税。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	101,907,413.97
等于：本金	101,900,591.80
加：应计利息	6,822.17
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	101,907,413.97

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,189,667,977.58	-	21,464,308,175.35	3,274,640,197.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	390.19	5,236,390.19	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	390.19	5,236,390.19	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,194,903,977.58	390.19	21,469,544,565.54	3,274,640,197.77

#### 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

无余额。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-

其他应收款	386,206.13
待摊费用	-
合计	386,206.13

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	2,331,289.14
其中：交易所市场	2,331,289.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	84,300.75
应付替代款	48,070.32
合计	2,643,167.58

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

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

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,538,057,679.00	5,943,986,615.99
本期申购	95,500,000.00	102,499,965.55
本期赎回（以“-”号填列）	-81,500,000.00	-87,473,792.53
本期末	5,552,057,679.00	5,959,012,789.01

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	21,215,013,966.84	-4,272,026,932.42	16,942,987,034.42
本期利润	24,053,672.74	-1,437,611,032.74	-1,413,557,360.00
本期基金份额交易产生的变动数	53,782,712.07	-17,529,292.06	36,253,420.01
其中：基金申购款	366,076,055.71	-114,988,586.73	251,087,468.98
基金赎回款	-312,293,343.64	97,459,294.67	-214,834,048.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,292,850,351.65	-5,727,167,257.22	15,565,683,094.43

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	97,080.10
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	22,131.08
其他	940.57
合计	120,151.75

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-200,007,572.66
股票投资收益——赎回差价收入	34,760,412.04
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	-165,247,160.62

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,223,977,684.83
减：卖出股票成本总额	1,420,206,295.72
减：交易费用	3,778,961.77
买卖股票差价收入	-200,007,572.66

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	302,307,841.50
减：现金支付赎回款总额	-26,387,708.50
减：赎回股票成本总额	293,935,137.96
减：交易费用	-
赎回差价收入	34,760,412.04

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,511.30
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,102,720.73
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	13,111,232.03

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	81,281,750.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	68,170,000.00
减：应计利息总额	8,949.17
减：交易费用	80.50
买卖债券差价收入	13,102,720.73

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

无。

### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	230,839,973.89
其中：证券出借权益补偿收入	6,477,336.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	230,839,973.89

### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-1,437,611,032.74
——股票投资	-1,437,611,032.74
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,437,611,032.74

### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-43,516.62
合计	-43,516.62

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	84,300.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,257.35
合计	145,065.47

#### 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

根据本基金管理人于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经基金管理人股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2022】469 号文核准，基金管理人股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的本公司 15% 的股权转让给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(“华安基金公司”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	2,246,977,756.21	85.40%	4,712,984,698.42	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总 额的比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	7,558,948.70	6.10%	141,343,214.60	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	2,092,612.58	89.76%	2,092,612.58	89.76%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	4,384,744.34	100.00%	4,155,977.12	100.00%

#### 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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	51,486,552.61	59,368,331.85
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,297,310.56	11,873,666.34

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

单位：人民币

本期 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务 余额	期末应收利息余 额
国泰君安	1,733,461,500.00	2,550,044.48	215,434,300.00	147,616.65

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,650,145.00	0.07%	5,130,500.00	0.09%
中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	42,361,625.00	0.76%	38,881,625.00	0.70%

注：于本报告期末，上证 180ETF 联接基金持有本基金份额为一级市场申购和二级市场买入的份额。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行	101,907,413.97	97,080.10	69,659,211.76	94,639.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759.00	562,375.50
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775.00	7,300.50
国泰君安证	113057	中银转债	老股东配	25,300.00	2,530,000.00

券股份有限 公司			售		
国泰君安证 券股份有限 公司	113059	福莱转债	老股东配 售	18,340.00	1,834,000.00
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单 位: 股/张)	总金额
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安	113042	上银转债	老股东配 售	278,560.00	27,856,000.00
国泰君安	113049	长汽转债	老股东配 售	13,460.00	1,346,000.00
国泰君安	113050	南银转债	老股东配 售	181,550.00	18,155,000.00

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 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：股票										
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: 股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注

688261	东微 半导	2022-01-26	1-6 个月 (含)	新股 限售	130.00	230.70	2,645	343,850.00	610,201.50	-
<b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
113060	浙 22 转债	2022-06-14	1 个月 以内 (含)	配债 未上 市	100.00	100.01	52,360	5,236,000.00	5,236,390.19	-

#### 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

截至报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值总 额
1	600009	上海机场	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	56.70	110,000.00	6,237,000.00
2	600010	包钢股份	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	2.35	7,700,000.00	18,095,000.00
3	600011	华能国际	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 14 日	7.04	1,250,000.00	8,800,000.00
4	600019	宝钢股份	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 8 日	6.02	140,000.00	842,800.00
5	600025	华能水电	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 12 日	6.99	360,000.00	2,516,400.00
6	600028	中国石化	2022 年 7 月 4 日-	4.08	830,000.00	3,386,400.00

			2022 年 7 月 12 日			0
7	600030	中信证券	2022 年 7 月 15 日- 2022 年 7 月 15 日	21.66	20,000.00	433,200.00
8	600031	三一重工	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	19.06	540,000.00	10,292,400.00
9	600038	中直股份	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 27 日	45.20	50,000.00	2,260,000.00
10	600048	保利发展	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 12 日	17.46	390,000.00	6,809,400.00
11	600089	特变电工	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	27.39	990,000.00	27,116,100.00
12	600096	云天化	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 19 日	31.48	400,000.00	12,592,000.00
13	600104	上汽集团	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 20 日	17.81	70,000.00	1,246,700.00
14	600109	国金证券	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 22 日	9.00	600,000.00	5,400,000.00
15	600111	北方稀土	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	35.16	680,000.00	23,908,800.00
16	600132	重庆啤酒	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 7 日	146.60	20,000.00	2,932,000.00
17	600141	兴发集团	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 27 日	43.99	70,000.00	3,079,300.00
18	600143	金发科技	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	9.52	450,000.00	4,284,000.00
19	600150	中国船舶	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 22 日	18.98	240,000.00	4,555,200.00
20	600161	天坛生物	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 12 日	24.28	60,000.00	1,456,800.00
21	600176	中国巨石	2022 年 7 月 21 日- 2022 年 7 月 21 日	17.41	20,000.00	348,200.00
22	600183	生益科技	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	16.99	340,000.00	5,776,600.00
23	600188	兖矿能源	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	39.48	40,000.00	1,579,200.00
24	600196	复星医药	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 14 日	44.09	390,000.00	17,195,100.00
25	600219	南山铝业	2022 年 7 月 13 日- 2022 年 7 月 13 日	3.69	120,000.00	442,800.00
26	600298	安琪酵母	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 26 日	48.75	130,000.00	6,337,500.00
27	600309	万华化学	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 27 日	96.99	90,000.00	8,729,100.00
28	600346	恒力石化	2022 年 7 月 4 日-	22.24	220,000.00	4,892,800.00

			2022 年 7 月 15 日			0
29	600362	江西铜业	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 12 日	17.83	100,000.00	1,783,000.0 0
30	600383	金地集团	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 21 日	13.44	460,000.00	6,182,400.0 0
31	600406	国电南瑞	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 11 日	27.00	72,000.00	1,944,000.0 0
32	600438	通威股份	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 27 日	59.86	680,000.00	40,704,800. 00
33	600460	士兰微	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	52.00	220,000.00	11,440,000. 00
34	600516	方大炭素	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 26 日	7.60	670,000.00	5,092,000.0 0
35	600521	华海药业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 6 日	22.70	140,000.00	3,178,000.0 0
36	600522	中天科技	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	23.10	790,000.00	18,249,000. 00
37	600570	恒生电子	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 11 日	43.54	50,000.00	2,177,000.0 0
38	600584	长电科技	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 13 日	27.00	210,000.00	5,670,000.0 0
39	600585	海螺水泥	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	35.28	30,000.00	1,058,400.0 0
40	600588	用友网络	2022 年 7 月 7 日- 2022 年 7 月 14 日	21.71	440,000.00	9,552,400.0 0
41	600598	北大荒	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	14.76	210,000.00	3,099,600.0 0
42	600600	青岛啤酒	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 8 日	103.9 2	80,000.00	8,313,600.0 0
43	600660	福耀玻璃	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 22 日	41.81	100,000.00	4,181,000.0 0
44	600699	均胜电子	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	15.71	260,000.00	4,084,600.0 0
45	600741	华域汽车	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 12 日	23.00	150,000.00	3,450,000.0 0
46	600745	闻泰科技	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	85.11	130,000.00	11,064,300. 00
47	600760	中航沈飞	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	60.45	130,000.00	7,858,500.0 0
48	600763	通策医疗	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 14 日	174.4 4	60,000.00	10,466,400. 00
49	600779	水井坊	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 13 日	92.54	40,000.00	3,701,600.0 0
50	600809	山西汾酒	2022 年 7 月 4 日-	324.8	30,000.00	9,744,000.0

			2022 年 7 月 22 日	0		0
51	600837	海通证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 11 日	9.81	210,000.00	2,060,100.0 0
52	600862	中航高科	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 12 日	28.10	200,000.00	5,620,000.0 0
53	600872	中炬高新	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 14 日	34.61	130,000.00	4,499,300.0 0
54	600884	杉杉股份	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	29.72	350,000.00	10,402,000. 00
55	600886	国投电力	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	10.50	110,000.00	1,155,000.0 0
56	600887	伊利股份	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 6 日	38.95	200,000.00	7,790,000.0 0
57	600893	航发动力	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 22 日	45.51	60,000.00	2,730,600.0 0
58	600900	长江电力	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 26 日	23.12	150,000.00	3,468,000.0 0
59	600905	三峡能源	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 5 日	6.29	700,000.00	4,403,000.0 0
60	600918	中泰证券	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 13 日	7.65	340,000.00	2,601,000.0 0
61	600919	江苏银行	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 13 日	7.12	40,000.00	284,800.00
62	600926	杭州银行	2022 年 7 月 22 日- 2022 年 7 月 28 日	14.98	30,000.00	449,400.00
63	600958	东方证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 13 日	10.21	580,000.00	5,921,800.0 0
64	600989	宝丰能源	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 11 日	14.65	150,000.00	2,197,500.0 0
65	600999	招商证券	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 13 日	14.41	250,000.00	3,602,500.0 0
66	601012	隆基绿能	2022 年 7 月 22 日- 2022 年 7 月 22 日	66.63	10,000.00	666,300.00
67	601016	节能风电	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 27 日	4.80	1,000,000.0 0	4,800,000.0 0
68	601066	中信建投	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 14 日	28.91	410,000.00	11,853,100. 00
69	601088	中国神华	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 12 日	33.30	250,000.00	8,325,000.0 0
70	601100	恒立液压	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	61.72	100,000.00	6,172,000.0 0
71	601108	财通证券	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 22 日	7.87	610,000.00	4,800,700.0 0
72	601111	中国国航	2022 年 7 月 6 日-	11.61	860,000.00	9,984,600.0

			2022 年 7 月 14 日			0
73	601117	中国化学	2022 年 7 月 12 日- 2022 年 7 月 12 日	9.41	100,000.00	941,000.00
74	601155	新城控股	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	25.43	160,000.00	4,068,800.0 0
75	601166	兴业银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 8 日	19.90	100,000.00	1,990,000.0 0
76	601169	北京银行	2022 年 7 月 11 日- 2022 年 7 月 22 日	4.54	160,000.00	726,400.00
77	601225	陕西煤业	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 25 日	21.18	520,000.00	11,013,600. 00
78	601238	广汽集团	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 26 日	15.24	610,000.00	9,296,400.0 0
79	601288	农业银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	3.02	100,000.00	302,000.00
80	601318	中国平安	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	46.69	60,000.00	2,801,400.0 0
81	601319	中国人保	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 5 日	5.06	10,000.00	50,600.00
82	601328	交通银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	4.98	230,000.00	1,145,400.0 0
83	601336	新华保险	2022 年 7 月 15 日- 2022 年 7 月 15 日	32.19	10,000.00	321,900.00
84	601360	三六零	2022 年 7 月 7 日- 2022 年 7 月 14 日	8.52	430,000.00	3,663,600.0 0
85	601377	兴业证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 14 日	7.05	1,170,000.0 0	8,248,500.0 0
86	601390	中国中铁	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	6.14	80,000.00	491,200.00
87	601398	工商银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 7 日	4.77	110,000.00	524,700.00
88	601456	国联证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	12.27	200,000.00	2,454,000.0 0
89	601555	东吴证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	6.93	120,000.00	831,600.00
90	601600	中国铝业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 26 日	4.75	2,360,000.0 0	11,210,000. 00
91	601601	中国太保	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 18 日	23.53	20,000.00	470,600.00
92	601607	上海医药	2022 年 7 月 11 日- 2022 年 7 月 22 日	18.08	70,000.00	1,265,600.0 0
93	601615	明阳智能	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 27 日	33.80	550,000.00	18,590,000. 00
94	601618	中国中冶	2022 年 7 月 4 日-	3.50	440,000.00	1,540,000.0



			2022 年 7 月 19 日			0
95	601628	中国人寿	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 21 日	31.08	180,000.00	5,594,400.0 0
96	601633	长城汽车	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 13 日	37.04	420,000.00	15,556,800. 00
97	601636	旗滨集团	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 27 日	12.75	140,000.00	1,785,000.0 0
98	601658	邮储银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 7 日	5.39	40,000.00	215,600.00
99	601668	中国建筑	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 8 日	5.32	340,000.00	1,808,800.0 0
100	601669	中国电建	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 26 日	7.87	430,000.00	3,384,100.0 0
101	601688	华泰证券	2022 年 7 月 12 日- 2022 年 7 月 12 日	14.20	110,000.00	1,562,000.0 0
102	601689	拓普集团	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 15 日	68.43	130,000.00	8,895,900.0 0
103	601696	中银证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	13.30	560,000.00	7,448,000.0 0
104	601766	中国中车	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 6 日	5.20	560,000.00	2,912,000.0 0
105	601788	光大证券	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 25 日	15.76	660,000.00	10,401,600. 00
106	601800	中国交建	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 14 日	9.28	1,072,000.0 0	9,948,160.0 0
107	601816	京沪高铁	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 18 日	5.02	3,220,000.0 0	16,164,400. 00
108	601857	中国石油	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	5.30	600,000.00	3,180,000.0 0
109	601865	福莱特	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	38.10	140,000.00	5,334,000.0 0
110	601877	正泰电器	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 15 日	35.78	150,000.00	5,367,000.0 0
111	601878	浙商证券	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 26 日	11.38	500,000.00	5,690,000.0 0
112	601881	中国银河	2022 年 7 月 15 日- 2022 年 7 月 15 日	9.67	40,000.00	386,800.00
113	601888	中国中免	2022 年 7 月 6 日- 2022 年 7 月 14 日	232.9 3	50,000.00	11,646,500. 00
114	601899	紫金矿业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	9.33	70,000.00	653,100.00
115	601901	方正证券	2022 年 7 月 13 日- 2022 年 7 月 13 日	6.71	250,000.00	1,677,500.0 0
116	601919	中远海控	2022 年 7 月 1 日-	13.90	940,000.00	13,066,000.

			2022 年 7 月 28 日			00
117	601939	建设银行	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 12 日	6.06	130,000.00	787,800.00
118	601966	玲珑轮胎	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 28 日	25.37	160,000.00	4,059,200.00
119	601985	中国核电	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 12 日	6.86	190,000.00	1,303,400.00
120	601988	中国银行	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	3.26	220,000.00	717,200.00
121	601989	中国重工	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 14 日	3.71	1,010,000.00	3,747,100.00
122	601990	南京证券	2022 年 7 月 8 日- 2022 年 7 月 26 日	8.34	700,000.00	5,838,000.00
123	601995	中金公司	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 14 日	44.49	90,000.00	4,004,100.00
124	603019	中科曙光	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 13 日	29.02	240,000.00	6,964,800.00
125	603026	石大胜华	2022 年 7 月 13 日- 2022 年 7 月 18 日	145.35	30,000.00	4,360,500.00
126	603185	上机数控	2022 年 7 月 1 日- 2022 年 7 月 11 日	155.99	60,000.00	9,359,400.00
127	603259	药明康德	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	103.99	190,000.00	19,758,100.00
128	603260	合盛硅业	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 12 日	117.96	50,000.00	5,898,000.00
129	603288	海天味业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 4 日	90.36	100,000.00	9,036,000.00
130	603345	安井食品	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 8 日	167.87	40,000.00	6,714,800.00
131	603369	今世缘	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 5 日	51.00	10,000.00	510,000.00
132	603501	韦尔股份	2022 年 7 月 19 日- 2022 年 7 月 28 日	173.03	60,000.00	10,381,800.00
133	603517	绝味食品	2022 年 7 月 5 日- 2022 年 7 月 14 日	57.82	110,000.00	6,360,200.00
134	603589	口子窖	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 27 日	58.61	100,000.00	5,861,000.00
135	603659	璞泰来	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	84.40	90,000.00	7,596,000.00
136	603799	华友钴业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 21 日	95.62	216,000.00	20,653,920.00
137	603806	福斯特	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 28 日	65.52	130,000.00	8,517,600.00
138	603833	欧派家居	2022 年 7 月 4 日-	150.6	40,000.00	6,027,200.00

			2022 年 7 月 12 日	8		0
139	603882	金域医学	2022 年 7 月 12 日- 2022 年 7 月 22 日	82.55	20,000.00	1,651,000.0 0
140	603986	兆易创新	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 22 日	142.2 1	50,000.00	7,110,500.0 0
141	603993	洛阳钼业	2022 年 7 月 4 日- 2022 年 7 月 26 日	5.73	1,170,000.0 0	6,704,100.0 0
142	688036	传音控股	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	89.23	1,000.00	89,230.00
143	688126	沪硅产业	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	22.98	80,000.00	1,838,400.0 0
144	688396	华润微	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	59.07	30,000.00	1,772,100.0 0
145	688599	天合光能	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	65.25	80,000.00	5,220,000.0 0
146	688981	中芯国际	2022 年 7 月 14 日- 2022 年 7 月 14 日	45.17	1,000.00	45,170.00
合计	-	-	-	-	51,722,000. 00	855,837,680 .00

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

##### 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本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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，有效保障基金份额持有人利益。

##### 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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。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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	101,907,413.97	-	-	-	101,907,413.97
结算备付金	245,156.99	-	-	-	245,156.99
存出保证金	137,060.58	-	-	-	137,060.58
交易性金融资产	5,236,390.19	-	-	21,464,308,175.35	21,469,544,565.54
应收清算款	-	-	-	2,662,262.78	2,662,262.78
应收股利	-	-	-	2,110,967.82	2,110,967.82
其他资产	-	-	-	386,206.13	386,206.13
资产总计	107,526,021.73	-	-	21,469,467,612.08	21,576,993,633.81
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	39,549,073.87	39,549,073.87
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,421,249.92	8,421,249.92
应付托管费	-	-	-	1,684,249.99	1,684,249.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9.01	9.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,643,167.58	2,643,167.58
负债总计	-	-	-	52,297,750.37	52,297,750.37

利率敏感度缺口	107,526,021.73	-	-	21,417,169,861.71	21,524,695,883.44
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	48,892,471.71	-	-	-	48,892,471.71
结算备付金	185,716.61	-	-	-	185,716.61
存出保证金	100,023.32	-	-	-	100,023.32
交易性金融资产	30,716,000.00	-	-	22,824,978,874.57	22,855,694,874.57
应收清算款	-	-	-	413,566.40	413,566.40
应收股利	-	-	-	28,150.00	28,150.00
其他资产	-	-	-	694,259.62	694,259.62
资产总计	79,894,211.64	-	-	22,826,114,850.59	22,906,009,062.23
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,743,403.25	9,743,403.25
应付托管费	-	-	-	1,948,680.64	1,948,680.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,343,327.93	7,343,327.93
负债总计	-	-	-	19,035,411.82	19,035,411.82
利率敏感度缺口	79,894,211.64	-	-	22,807,079,438.77	22,886,973,650.41

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 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 0.02%(2021 年 12 月 31 日：0.13%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 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份股权重方法构建组合。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，上证 180 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	21,464,308,175 .35	99.72	22,824,978,87 4.57	99.73
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,464,308,175 .35	99.72	22,824,978,87 4.57	99.73

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	1,075,620,000.00	1,141,170,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-1,075,620,000.00	-1,141,170,000.00

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上期末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	21,463,697,973.85	22,821,056,411.28

第二层次	5,236,390.19	30,716,000.00
第三层次	610,201.50	3,922,463.29
合计	21,469,544,565.54	22,855,694,874.57

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 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

无。

## 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	21,464,308,175.35	99.48
	其中：股票	21,464,308,175.35	99.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,236,390.19	0.02

	其中：债券	5,236,390.19	0.02
	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	102,152,570.96	0.47
8	其他各项资产	5,296,497.31	0.02
9	合计	21,576,993,633.81	100.00

注：本报告期末基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 855,837,680.00 元，占基金资产净值的比例为 3.98%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	18,162,180.00	0.08
B	采矿业	939,660,859.78	4.37
C	制造业	10,712,616,247.67	49.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	815,224,034.96	3.79
E	建筑业	682,434,450.15	3.17
F	批发和零售业	34,753,140.96	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	477,460,191.50	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	608,103,296.12	2.83
J	金融业	5,985,106,972.79	27.81
K	房地产业	320,062,137.49	1.49

L	租赁和商务服务业	393,504,488.24	1.83
M	科学研究和技术服务业	369,328,804.20	1.72
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	107,244,353.54	0.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,463,661,157.40	99.72

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	647,017.95	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	647,017.95	0.00

### 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投资股票。

## 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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,087,423	2,223,780,035.00	10.33
2	600036	招商银行	21,435,821	904,591,646.20	4.20
3	601318	中国平安	18,760,597	875,932,273.93	4.07
4	601012	隆基绿能	10,500,606	699,655,377.78	3.25
5	601166	兴业银行	25,181,795	501,117,720.50	2.33
6	600900	长江电力	19,689,663	455,225,008.56	2.11
7	601888	中国中免	1,689,368	393,504,488.24	1.83
8	603259	药明康德	3,551,580	369,328,804.20	1.72
9	600030	中信证券	16,904,373	366,148,719.18	1.70
10	600887	伊利股份	8,866,324	345,343,319.80	1.60
11	601398	工商银行	60,697,428	289,526,731.56	1.35
12	600276	恒瑞医药	7,733,336	286,829,432.24	1.33
13	600438	通威股份	4,673,950	279,782,647.00	1.30
14	600809	山西汾酒	843,900	274,098,720.00	1.27
15	600309	万华化学	2,718,500	263,667,315.00	1.22
16	601328	交通银行	47,583,049	236,963,584.02	1.10
17	601899	紫金矿业	24,962,060	232,896,019.80	1.08
18	603288	海天味业	2,407,259	217,519,923.24	1.01
19	600048	保利发展	12,436,662	217,144,118.52	1.01
20	603799	华友钴业	2,197,980	210,170,847.60	0.98
21	600031	三一重工	10,294,267	196,208,729.02	0.91
22	601668	中国建筑	36,317,690	193,210,110.80	0.90
23	601088	中国神华	5,710,764	190,168,441.20	0.88
24	600436	片仔癀	520,575	185,704,719.75	0.86
25	600690	海尔智家	6,555,136	180,004,034.56	0.84
26	600089	特变电工	6,560,346	179,687,876.94	0.83
27	601816	京沪高铁	33,997,424	170,667,068.48	0.79

28	601288	农业银行	55,285,715	166,962,859.30	0.78
29	603986	兆易创新	1,155,564	164,332,756.44	0.76
30	600837	海通证券	16,720,072	164,023,906.32	0.76
31	600000	浦发银行	20,335,030	162,883,590.30	0.76
32	600016	民生银行	42,986,637	159,910,289.64	0.74
33	603501	韦尔股份	910,886	157,610,604.58	0.73
34	600406	国电南瑞	5,797,625	156,535,875.00	0.73
35	601919	中远海控	10,956,924	152,301,243.60	0.71
36	688981	中芯国际	3,352,805	151,446,201.85	0.70
37	600585	海螺水泥	4,155,598	146,609,497.44	0.68
38	600919	江苏银行	20,464,564	145,707,695.68	0.68
39	601688	华泰证券	10,194,707	144,764,839.40	0.67
40	600104	上汽集团	8,093,998	144,154,104.38	0.67
41	601225	陕西煤业	6,712,935	142,179,963.30	0.66
42	601601	中国太保	5,928,219	139,490,993.07	0.65
43	600111	北方稀土	3,770,857	132,583,332.12	0.62
44	688599	天合光能	1,873,773	122,263,688.25	0.57
45	601988	中国银行	36,501,233	118,994,019.58	0.55
46	601211	国泰君安	7,808,480	118,688,896.00	0.55
47	601169	北京银行	25,631,833	116,368,521.82	0.54
48	600660	福耀玻璃	2,774,083	115,984,410.23	0.54
49	601985	中国核电	16,321,134	111,962,979.24	0.52
50	600050	中国联通	32,202,437	111,420,432.02	0.52
51	600745	闻泰科技	1,294,015	110,133,616.65	0.51
52	601766	中国中车	21,063,612	109,530,782.40	0.51
53	601390	中国中铁	17,781,740	109,179,883.60	0.51
54	600522	中天科技	4,724,346	109,132,392.60	0.51
55	600893	航发动力	2,307,995	105,036,852.45	0.49
56	601669	中国电建	13,244,859	104,237,040.33	0.48
57	603659	璞泰来	1,204,140	101,629,416.00	0.47
58	601658	邮储银行	18,841,600	101,556,224.00	0.47
59	601615	明阳智能	2,912,200	98,432,360.00	0.46
60	600028	中国石化	23,161,991	94,500,923.28	0.44
61	600009	上海机场	1,666,275	94,477,792.50	0.44
62	600905	三峡能源	14,865,663	93,505,020.27	0.43
63	601009	南京银行	8,914,139	92,885,328.38	0.43
64	600019	宝钢股份	15,426,181	92,865,609.62	0.43
65	600010	包钢股份	39,425,289	92,649,429.15	0.43
66	600999	招商证券	6,424,940	92,583,385.40	0.43
67	600958	东方证券	9,051,595	92,416,784.95	0.43
68	600196	复星医药	2,088,211	92,069,222.99	0.43
69	601628	中国人寿	2,882,397	89,584,898.76	0.42
70	601857	中国石油	16,821,498	89,153,939.40	0.41
71	600570	恒生电子	2,023,744	88,113,813.76	0.41

72	601818	光大银行	28,648,776	86,232,815.76	0.40
73	600760	中航沈飞	1,357,651	82,070,002.95	0.38
74	600346	恒力石化	3,656,649	81,323,873.76	0.38
75	601633	长城汽车	2,129,922	78,892,310.88	0.37
76	600926	杭州银行	5,134,020	76,907,619.60	0.36
77	600460	士兰微	1,470,703	76,476,556.00	0.36
78	600426	华鲁恒升	2,573,598	75,149,061.60	0.35
79	688012	中微公司	635,746	74,223,345.50	0.34
80	601989	中国重工	19,738,421	73,229,541.91	0.34
81	600176	中国巨石	4,159,493	72,416,773.13	0.34
82	601939	建设银行	11,629,372	70,473,994.32	0.33
83	603993	洛阳钼业	12,232,320	70,091,193.60	0.33
84	600096	云天化	2,224,000	70,011,520.00	0.33
85	600763	通策医疗	386,661	67,449,144.84	0.31
86	600584	长电科技	2,465,400	66,565,800.00	0.31
87	601877	正泰电器	1,859,334	66,526,970.52	0.31
88	601377	兴业证券	9,270,144	65,354,515.20	0.30
89	601066	中信建投	2,248,124	64,993,264.84	0.30
90	600588	用友网络	2,970,909	64,498,434.39	0.30
91	601600	中国铝业	13,573,600	64,474,600.00	0.30
92	600600	青岛啤酒	611,950	63,593,844.00	0.30
93	600383	金地集团	4,689,957	63,033,022.08	0.29
94	688111	金山办公	319,662	63,011,773.44	0.29
95	601186	中国铁建	7,969,774	62,961,214.60	0.29
96	600085	同仁堂	1,189,000	62,874,320.00	0.29
97	600741	华域汽车	2,729,814	62,785,722.00	0.29
98	600188	兖矿能源	1,585,400	62,591,592.00	0.29
99	600132	重庆啤酒	416,728	61,092,324.80	0.28
100	603806	福斯特	920,760	60,328,195.20	0.28
101	601111	中国国航	5,169,172	60,014,086.92	0.28
102	688005	容百科技	462,331	59,844,124.64	0.28
103	601117	中国化学	6,351,200	59,764,792.00	0.28
104	600141	兴发集团	1,348,800	59,333,712.00	0.28
105	600150	中国船舶	3,096,397	58,769,615.06	0.27
106	603019	中科曙光	2,024,661	58,755,662.22	0.27
107	601238	广汽集团	3,823,841	58,275,336.84	0.27
108	600547	山东黄金	3,129,245	58,078,787.20	0.27
109	601800	中国交建	6,096,044	56,571,288.32	0.26
110	600989	宝丰能源	3,809,449	55,808,427.85	0.26
111	601100	恒立液压	902,823	55,722,235.56	0.26
112	600884	杉杉股份	1,869,500	55,561,540.00	0.26
113	603369	今世缘	1,085,872	55,379,472.00	0.26
114	600886	国投电力	5,162,089	54,201,934.50	0.25
115	688396	华润微	910,247	53,768,290.29	0.25

116	600011	华能国际	7,609,381	53,570,042.24	0.25
117	601788	光大证券	3,378,829	53,250,345.04	0.25
118	601868	中国能建	22,465,400	53,242,998.00	0.25
119	601689	拓普集团	761,700	52,123,131.00	0.24
120	603185	上机数控	330,467	51,549,547.33	0.24
121	603486	科沃斯	395,170	48,167,271.30	0.22
122	601555	东吴证券	6,937,624	48,077,734.32	0.22
123	601901	方正证券	7,126,940	47,821,767.40	0.22
124	603392	万泰生物	306,061	47,531,273.30	0.22
125	603833	欧派家居	314,218	47,346,368.24	0.22
126	600941	中国移动	781,200	47,262,600.00	0.22
127	601336	新华保险	1,445,888	46,543,134.72	0.22
128	601233	桐昆股份	2,924,700	46,444,236.00	0.22
129	600219	南山铝业	12,426,600	45,854,154.00	0.21
130	603290	斯达半导	118,700	45,806,330.00	0.21
131	601995	中金公司	1,011,400	44,997,186.00	0.21
132	688180	君实生物	595,145	44,838,224.30	0.21
133	601108	财通证券	5,626,790	44,282,837.30	0.21
134	603260	合盛硅业	369,900	43,633,404.00	0.20
135	601618	中国中冶	12,362,035	43,267,122.50	0.20
136	688126	沪硅产业	1,881,978	43,247,854.44	0.20
137	603345	安井食品	251,300	42,185,731.00	0.20
138	601360	三六零	4,946,931	42,147,852.12	0.20
139	600298	安琪酵母	863,926	42,116,392.50	0.20
140	600862	中航高科	1,447,402	40,671,996.20	0.19
141	601155	新城控股	1,568,423	39,884,996.89	0.19
142	603882	金域医学	482,074	39,795,208.70	0.18
143	601696	中银证券	2,882,604	38,338,633.20	0.18
144	601878	浙商证券	3,354,966	38,179,513.08	0.18
145	600918	中泰证券	4,826,400	36,921,960.00	0.17
146	688036	传音控股	412,820	36,835,928.60	0.17
147	603517	绝味食品	636,931	36,827,350.42	0.17
148	603589	口子窖	621,745	36,440,474.45	0.17
149	688169	石头科技	58,040	35,793,268.00	0.17
150	601636	旗滨集团	2,792,400	35,603,100.00	0.17
151	603026	石大胜华	244,200	35,494,470.00	0.16
152	600521	华海药业	1,554,138	35,278,932.60	0.16
153	601728	中国电信	9,413,543	35,112,515.39	0.16
154	605117	德业股份	124,800	34,930,272.00	0.16
155	600109	国金证券	3,866,292	34,796,628.00	0.16
156	601607	上海医药	1,922,187	34,753,140.96	0.16
157	600183	生益科技	2,001,643	34,007,914.57	0.16
158	601865	福莱特	879,600	33,512,760.00	0.16
159	600872	中炬高新	964,447	33,379,510.67	0.16



160	600362	江西铜业	1,795,448	32,012,837.84	0.15
161	601990	南京证券	3,827,303	31,919,707.02	0.15
162	600779	水井坊	335,766	31,071,785.64	0.14
163	600516	方大炭素	3,948,601	30,009,367.60	0.14
164	600143	金发科技	3,115,398	29,658,588.96	0.14
165	600161	天坛生物	1,189,200	28,873,776.00	0.13
166	601319	中国人保	5,532,400	27,993,944.00	0.13
167	601966	玲珑轮胎	1,026,924	26,053,061.88	0.12
168	600699	均胜电子	1,657,738	26,043,063.98	0.12
169	600882	妙可蓝多	534,900	25,033,320.00	0.12
170	601016	节能风电	5,206,000	24,988,800.00	0.12
171	688185	康希诺	119,518	23,793,643.44	0.11
172	688363	华熙生物	166,559	23,681,358.62	0.11
173	600038	中直股份	508,324	22,976,244.80	0.11
174	600025	华能水电	3,114,485	21,770,250.15	0.10
175	601881	中国银河	2,232,500	21,588,275.00	0.10
176	603087	甘李药业	386,660	18,548,080.20	0.09
177	600598	北大荒	1,230,500	18,162,180.00	0.08
178	601456	国联证券	1,240,500	15,220,935.00	0.07
179	605499	东鹏饮料	76,500	13,070,790.00	0.06
180	600906	财达证券	1,124,500	10,109,255.00	0.05

### 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	占基金资产净值比例(%)
1	688261	东微半导	2,645.00	610,201.50	0.00
2	601089	福元医药	1,749.00	36,816.45	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	601615	明阳智能	76,378,435.36	0.33
2	600188	兖矿能源	66,842,673.69	0.29
3	600096	云天化	66,341,939.43	0.29
4	601117	中国化学	64,607,940.79	0.28
5	600141	兴发集团	55,609,529.00	0.24
6	600085	同仁堂	55,587,265.69	0.24

7	600941	中国移动	51,284,500.08	0.22
8	688180	君实生物	50,742,203.09	0.22
9	601233	桐昆股份	49,577,606.99	0.22
10	688005	容百科技	48,090,865.71	0.21
11	600219	南山铝业	45,682,631.94	0.20
12	688036	传音控股	42,614,557.79	0.19
13	603290	斯达半导	42,317,391.90	0.18
14	600030	中信证券	36,251,553.04	0.16
15	601985	中国核电	34,536,517.79	0.15
16	601636	旗滨集团	30,628,338.04	0.13
17	603986	兆易创新	30,444,112.27	0.13
18	603026	石大胜华	28,899,533.00	0.13
19	688599	天合光能	26,639,541.30	0.12
20	688396	华润微	26,398,023.08	0.12

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	601229	上海银行	113,926,983.91	0.50
2	601138	工业富联	66,311,954.03	0.29
3	600519	贵州茅台	64,265,685.00	0.28
4	600029	南方航空	57,625,426.15	0.25
5	600352	浙江龙盛	48,735,926.89	0.21
6	600036	招商银行	29,687,968.10	0.13
7	600061	国投资本	28,985,003.90	0.13
8	601318	中国平安	28,421,035.14	0.12
9	601216	君正集团	28,313,132.43	0.12
10	601933	永辉超市	27,643,142.37	0.12
11	600606	绿地控股	26,035,019.35	0.11
12	601162	天风证券	24,452,024.00	0.11
13	603160	汇顶科技	23,616,959.39	0.10
14	601288	农业银行	22,569,492.00	0.10
15	600118	中国卫星	21,157,713.44	0.09
16	600315	上海家化	20,370,007.00	0.09
17	601012	隆基绿能	20,320,711.37	0.09
18	603195	公牛集团	19,831,930.80	0.09
19	603658	安图生物	18,263,933.59	0.08
20	600511	国药股份	18,092,222.51	0.08

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,410,752,943.36
卖出股票的收入（成交）总额	1,223,977,684.83

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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）	5,236,390.19	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,236,390.19	0.02

### 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	113060	浙 22 转债	52,360	5,236,390.19	0.02

### 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。

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

2022 年 3 月 21 日，招商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2022）21 号）给予罚款 300 万元的行政处罚。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行因违规办理内保外贷业务等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局（闽汇罚（2021）5 号）责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币的行政处罚。2021 年 8 月 13 日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中

国人民银行（银罚字〔2021〕26号）给予罚款5万元的行政处罚。2022年3月21日，兴业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕22号）给予罚款350万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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	137,060.58
2	应收清算款	2,662,262.78
3	应收股利	2,110,967.82
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	386,206.13
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,296,497.31

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603259	药明康德	19,758,100.00	0.09	转融通证券

					出借
2	601888	中国中免	11,646,500.00	0.05	转融通证券出借
3	600887	伊利股份	7,790,000.00	0.04	转融通证券出借
4	600900	长江电力	3,468,000.00	0.02	转融通证券出借
5	601318	中国平安	2,801,400.00	0.01	转融通证券出借
6	601166	兴业银行	1,990,000.00	0.01	转融通证券出借
7	601012	隆基绿能	666,300.00	0.00	转融通证券出借
8	600030	中信证券	433,200.00	0.00	转融通证券出借

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688261	东微半导	610,201.50	0.00	处于锁定期

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

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
16,094	344,976.87	5,364,304,594.00	96.62%	187,753,085.00	3.38%

## 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	中央汇金投资有限责任公司	5,231,571,046.00	94.23%
2	三菱日联国际资产管理公司—MAXIS 华安中国股票（上证 180 指数）ETF	41,652,214.00	0.75%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	7,876,500.00	0.14%
4	孙晓燕	7,150,000.00	0.13%
5	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	6,020,000.00	0.11%
6	广发证券股份有限公司	4,772,050.00	0.09%
7	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公司	4,500,000.00	0.08%
8	国泰君安证券股份有限公司	3,650,145.00	0.07%
9	中信建投证券股份有限公司	3,549,057.00	0.06%
10	招商证券股份有限公司	3,104,020.00	0.06%
11	中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	42,361,625.00	0.76%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

## 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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 4 月 13 日）基金份额总额	1,072,822,105.00
本报告期期初基金份额总额	5,538,057,679.00
本报告期基金总申购份额	95,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	81,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,552,057,679.00

## 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：

2022 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告》，范伟隽先生离任本基金管理人的首席信息官。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。



### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	5	2,246,977,756.21	85.40%	2,092,612.58	89.76%	-
招商证券	1	384,002,775.18	14.60%	238,676.56	10.24%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2022 年 1 月完成租用托管在建设银行的国泰君安北交所 720216 交易单元。

**10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券	7,558,948.70	6.10%	-	-	-	-
招商证券	116,412,801.70	93.90%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

**10.9 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（天岳先进）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
3	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-21
4	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（万控智造）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-04
6	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2022-03-15

		定媒介	
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（中银转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-26
8	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-30
9	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-21
10	华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-30
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（福莱转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-24
12	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-30
13	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2022 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-30
14	华安基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-06-20

注：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
机构	1	20220101-20220630	5,231,571.04 6.00	0.00	0.00	5,231,571.046.00	94.23%
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。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》；
- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于核准上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

### 12.2 存放地点

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

### 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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日