

**上证 180 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2022 年年度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	17
6.1 审计意见 .....	17
6.2 形成审计意见的基础 .....	18
6.3 管理层对财务报表的责任 .....	18
6.4 注册会计师的责任 .....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	19
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	80
8.1 期末基金资产组合情况 .....	80
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	80
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	82
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	87
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	88

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	89
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	89
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	89
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	89
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	89
8.12	投资组合报告附注 .....	89
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>91</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	91
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	91
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	92
9.4	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 .....	92
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	92
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>92</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>93</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	93
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	93
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	93
11.4	基金投资策略的改变 .....	93
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	93
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	93
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	94
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	94
11.9	其他重大事件 .....	95
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>97</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>98</b>
13.1	备查文件目录 .....	98
13.2	存放地点 .....	98
13.3	查阅方式 .....	98

## §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	5,609,557,679.00 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	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228
传真		021-68863414	021-60635778
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	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 世纪大道8号国金中心二期 31—32层	北京市西城区闹市口大街1号 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	41,777,241.63	1,146,535,692.92	1,054,990,861.06
本期利润	-3,841,281,028.89	-777,950,018.92	4,461,600,166.36
加权平均基金份额本期利润	-0.6908	-0.1401	0.7936
本期加权平均净值利润率	-19.13%	-3.34%	21.55%
本期基金份额净值增长率	-16.76%	-3.35%	22.54%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	13,277,302,955.88	16,942,987,034.42	17,904,102,890.94
期末可供分配基金份额利润	2.3669	3.0594	3.2026
期末基金资产净值	19,298,030,383.89	22,886,973,650.41	23,904,437,655.61
期末基金份额净值	3.4402	4.1327	4.2759
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	293.62%	372.85%	389.24%

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
过去三个月	1.79%	1.26%	1.51%	1.26%	0.28%	0.00%
过去六个月	-11.26%	1.07%	-12.58%	1.08%	1.32%	-0.01%
过去一年	-16.76%	1.21%	-18.77%	1.22%	2.01%	-0.01%
过去三年	-1.41%	1.23%	-7.31%	1.23%	5.90%	0.00%
过去五年	4.72%	1.23%	-4.84%	1.24%	9.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	293.62%	1.64%	222.45%	1.67%	71.17%	-0.03%

### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2006 年 4 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日)

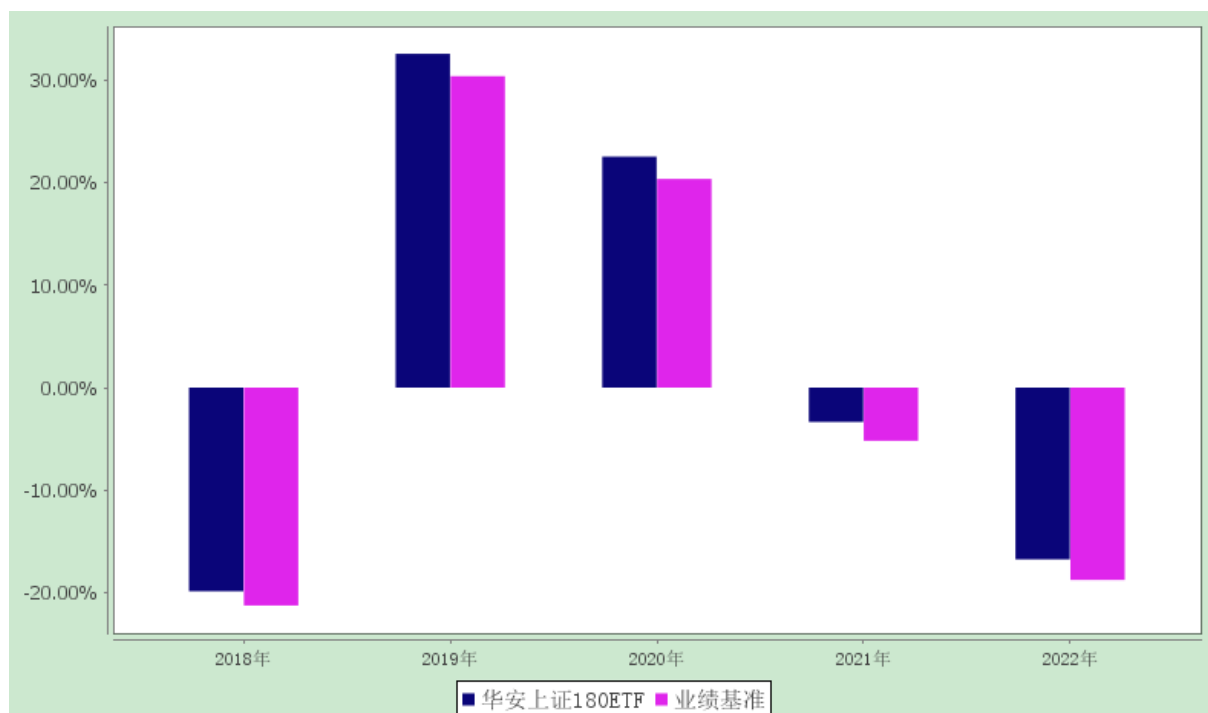


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022年	-	-	-	-	-
2021年	-	-	-	-	-
2020年	0.670	376,007,878.48	-	376,007,878.48	-
合计	0.670	376,007,878.48	-	376,007,878.48	-

## §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

12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 224 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,522.94 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	-	19	理学博士，19 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

				<p>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。2022 年 12 月起, 同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</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	14.00	51,036,375,485.16	2008-04-25
	私募资产管理计划	2.00	260,807,298.80	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	16.00	51,297,182,783.96	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理许之彦先生兼任私募资产管理计划投资经理，其薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统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同意向一一对应。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业股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

在严格执行《基金管理公司公平交易制度指导意见》的基础上，公司根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》，制定了《华安基金管理有限公司基金经理兼任私募资产管理计划投资经理管理办法》，进一步完善公司的防范利益冲突机制，健全公平交易控制体系和防范利益冲突的管理措施。

投资研究部负责宏观、策略、行业以及上市公司的研究，研究员在为公司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、投资研究会议讨论、研究报告登录在研究报告管理系统中等方式，确保公募基金基金经理与私募资产管理计划投资经理可以公平享有信息获取机会。

公司实行强制公平交易机制，确保公募基金与私募资产管理计划等各投资组合享有公平的交易执行机会，避免在交易环节出现利益冲突的情况。

同一基金经理同时管理公募基金与私募资产管理计划的情况下，兼任的基金经理保持同一个券（股）投资逻辑与决策、交易过程的一致性与同步性，避免出现风格相似的公募基金与私募资产管理计划在同一个期间内业绩偏差较大的情况。

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，并定期对各类投资组合间的同日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合间的隔日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的同向交易价差进行检查与分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。

本报告期内，同一基金经理管理的各投资组合公平交易执行情况良好，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 14 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

2022 年，国内经济经历了一波三折，1-2 月的开门红、3-5 月的疫情冲击，6 月以来的波折修复，在内外超预期因素的冲击下中国经济爬坡过坎，展现了较强的韧性，全年 GDP 同比增幅 3%，高于海外主要经济体的增速。

2022 年 A 股市场震荡调整，资金对经济预期和政策预期博弈主导了各阶段行情。全年来看，主要指数与行业均录得负收益，沪深 300 指数下跌 21.63%，中证 500 指数下跌 20.31%，创业板指下跌 29.37%。行业层面结构性分化明显，中信一级行业中位数收益-18.45%，煤炭、消费者服务、交运表现靠前，电子、计算机、军工、传媒等表现靠后。上证 180 指数全年收益-18.77%。

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 12 月 31 日，本基金份额净值为 3.4402 元，本报告期份额净值增长率为-16.76%，同期业绩比较基准增长率为-18.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济复苏将成为 2023 年的关键主题，中央经济工作会议进一步明确了 2023 年的经济发力方向，包括扩大内需、建立现代化产业体系、推动国企改革、高水平对外开放等。财政政策与货币政策也

将积极服务于稳增长领域。随着疫情对社会生产生活的影响边际减弱，经济发展的内生动力有望较快修复，经济有望重回中长期上行通道。

对比海外权益市场的估值情况，当前 A 股核心资产处于低估的状态。在中国特色估值体系作用下，预期 2023 年低估值优质资产的价值有望得到重塑，在经济修复趋势下 A 股盈利增长也将逐渐回暖，困境反转的行业、国企改革主线与数字化与低碳转型是值得关注的方向。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。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

合规和稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，监督各部门与全体员工合法合规执业，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等各项法律法规和监管要求，督促公司各项业务平稳、有序开展。

(3) 强化内控建设，推动落实公司各项业务操作流程标准化，进一步细化各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外信息披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各

业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高合规监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 4 次，若自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。每次基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配收益的 100%。

本报告期基金投资出现净亏损，不进行收益分配。



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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 25015 号

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了上证 180 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华安上证 180ETF 基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

##### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业

协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华安上证 180ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安上证 180ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层对财务报表的责任

华安上证 180ETF 基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安上证 180ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安上证 180ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安上证 180ETF 基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华安上证 180ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安上证 180ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

魏 佳 亮 楼 茜 蓉

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	54,528,599.15	48,892,471.71
结算备付金		25,179.79	185,716.61
存出保证金		77,141.53	100,023.32
交易性金融资产	7.4.7.2	19,269,311,606.24	22,855,694,874.57
其中：股票投资		19,269,311,606.24	22,824,978,874.57
基金投资		-	-
债券投资		-	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,328,906.70	413,566.40
应收股利		11,046.00	28,150.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	326,957.72	694,259.62
资产总计		19,325,609,437.13	22,906,009,062.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		14,913,665.16	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,187,205.57	9,743,403.25
应付托管费		1,637,441.12	1,948,680.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.40	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,840,734.99	7,343,327.93
负债合计		27,579,053.24	19,035,411.82

<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	6,020,727,428.01	5,943,986,615.99
未分配利润	7.4.7.8	13,277,302,955.88	16,942,987,034.42
净资产合计		19,298,030,383.89	22,886,973,650.41
负债和净资产总计		19,325,609,437.13	22,906,009,062.23

注：报告截至日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.4402 元，基金份额总额 5,609,557,679.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,720,369,812.32	-625,355,250.79
1.利息收入		13,583,812.94	8,404,781.25
其中：存款利息收入	7.4.7.9	244,184.12	249,794.22
债券利息收入		-	13,295.06
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		13,339,628.82	8,141,691.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		149,154,313.36	1,289,438,170.74
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-436,398,980.41	804,425,948.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	16,374,604.63	11,733,763.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	569,178,689.14	473,278,458.52
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,883,058,270.52	-1,924,485,711.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-49,668.10	1,287,509.06
<b>减：二、营业总支出</b>		120,911,216.57	152,594,768.13
1. 管理人报酬		100,532,351.37	116,689,434.16
2. 托管费		20,106,470.27	23,337,886.83

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		23.17	12.97
8. 其他费用	7.4.7.18	272,371.76	12,567,434.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,841,281,028.89</b>	<b>-777,950,018.92</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,841,281,028.89</b>	<b>-777,950,018.92</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>-3,841,281,028.89</b>	<b>-777,950,018.92</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	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
加：会计政策变更	-	-	-
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）	76,740,812.02	-3,665,684,078.54	3,588,943,266.52
（一）、综合收益总额	-	-3,841,281,028.89	3,841,281,028.89
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	76,740,812.02	175,596,950.35	252,337,762.37

号填列)			
其中：1.基金申购款	300,523,459.30	691,061,031.21	991,584,490.51
2.基金赎回款	-223,782,647.28	-515,464,080.86	-739,246,728.14
(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)	6,020,727,428.01	13,277,302,955.88	19,298,030,383.89
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	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)	-56,348,148.68	-961,115,856.52	-1,017,464,005.20
(一)、综合收益总额	-	-777,950,018.92	777,950,018.92
(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)	-56,348,148.68	-183,165,837.60	-239,513,986.28
其中：1.基金申购款	228,075,839.45	659,038,444.10	887,114,283.55
2.基金赎回款	-284,423,988.13	-842,204,281.70	-1,126,628,269.83
(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）	5,943,986,615.99	16,942,987,034.42	22,886,973,650.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱兴华 主管会计工作负责人：朱兴华 会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 2023 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并

进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额合并引起的实收基金份额变动于基金份额合并日根据拆分前的基金份额数及确定的合并比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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



原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。

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确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部

分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价

值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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, 财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号), 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。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》 根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	54,528,599.15	48,892,471.71
等于：本金	54,521,757.62	48,892,471.71

加：应计利息	6,841.53	-
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	54,528,599.15	48,892,471.71

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,440,118,646.25	-	19,269,311,606.24	829,192,959.99
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	18,440,118,646.25	-	19,269,311,606.24	829,192,959.99
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,112,727,644.06	-	22,824,978,874.57	4,712,251,230.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	30,716,000.00	-	30,716,000.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,716,000.00	-	30,716,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,143,443,644.06	-	22,855,694,874.57	4,712,251,230.51

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	694,259.62

其他应收款	326,957.72	-
待摊费用	-	-
合计	326,957.72	694,259.62

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,454,014.99	7,044,000.75
其中：交易所市场	2,454,014.99	7,044,000.75
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
可退替代款	116,720.00	-
预提费用	270,000.00	287,000.00
应付替代款	-	12,327.18
合计	2,840,734.99	7,343,327.93

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。

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 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	280,000,000.00	300,523,459.30
本期赎回（以“-”号填列）	-208,500,000.00	-223,782,647.28



本期末	5,609,557,679.00	6,020,727,428.01
-----	------------------	------------------

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。

#### 7.4.7.8 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	41,777,241.63	-3,883,058,270.52	-3,841,281,028.89
本期基金份额交易产生的变动数	275,016,652.03	-99,419,701.68	175,596,950.35
其中：基金申购款	1,079,355,451.33	-388,294,420.12	691,061,031.21
基金赎回款	-804,338,799.30	288,874,718.44	-515,464,080.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,531,807,860.50	-8,254,504,904.62	13,277,302,955.88

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	205,263.95	200,579.11
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	37,225.24	47,126.20
其他	1,694.93	2,088.91
合计	244,184.12	249,794.22

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-483,197,490.91	482,178,588.73
股票投资收益——赎回差价收入	46,798,510.50	322,247,360.00
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	-436,398,980.41	804,425,948.73

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,403,892,484.59	4,103,899,335.95
减：卖出股票成本总额	2,879,407,512.01	3,621,720,747.22
减：交易费用	7,682,463.49	-
买卖股票差价收入	-483,197,490.91	482,178,588.73

#### 7.4.7.10.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	739,246,728.14	1,126,628,269.83
减：现金支付赎回款总额	-61,468,911.86	-86,945,205.17
减：赎回股票成本总额	753,917,129.50	891,326,115.00
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	46,798,510.50	322,247,360.00

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	10,103.75	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,364,500.88	11,733,763.49
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	16,374,604.63	11,733,763.49
----	---------------	---------------

**7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	97,277,936.27	111,906,565.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	80,902,000.00	100,158,000.00
减：应计利息总额	10,970.09	14,802.01
减：交易费用	465.30	-
买卖债券差价收入	16,364,500.88	11,733,763.49

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

无。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

无。

**7.4.7.14 衍生工具收益**
**7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	569,178,689.14	473,278,458.52
其中：证券出借权益补偿收入	14,407,859.92	2,079,080.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	569,178,689.14	473,278,458.52

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-3,883,058,270.52	-1,924,485,711.84
——股票投资	-3,883,058,270.52	-1,924,485,711.84
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-3,883,058,270.52	-1,924,485,711.84

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	-58,431.52	105,253.70
其他	8,763.42	1,182,255.36
合计	-49,668.10	1,287,509.06

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。

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	150,000.00	167,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,371.76	2,506.76
交易费用	-	12,232,927.41
律师费	-	30,000.00
公证费	-	15,000.00
合计	272,371.76	12,567,434.17

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	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(“上证 180ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
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
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据华安基金于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经华安基金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，华安基金股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的华安基金 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

3.根据华安基金于 2022 年 10 月 12 日发布的公告，经华安基金股东会第七十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2022]2382 号文核准，华安基金股东上海工业投资（集团）有限公司将其持有的华安基金 8%的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。本次股东股权变更完成后，国泰君安证券股份有限公司成为华安基金的控股股东，国泰君安证券股份有限公司的实际控制人上海国际集团有限公司成为华安基金的实际控制人。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	4,899,018,051.13	92.73%	5,063,031,146.89	59.01%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	31,051,134.57	21.06%	183,909,565.50	85.69%

##### 7.4.10.1.4 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 12 月 31 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	4,546,627.57	95.01%	2,454,014.99	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	4,708,022.58	64.73%	4,479,255.36	63.59%

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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	100,532,351.37
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	20,106,470.27	23,337,886.83

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：

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期				
2022年1月1日至2022年12月31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
国泰君安证券股份有限公司	2,734,776,700.00	3,838,823.78	125,129,400.00	76,102.03
上年度可比期间				
2021年1月1日至2021年12月31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
国泰君安证券股份有限公司	3,110,763,287.00	3,614,141.29	609,979,060.00	277,586.59

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期										
2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	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	2022	中芯国	2022-	41,14	1,000.00	14	3.4	3.89	41,140.00	3.89



安证券 股份有 限公司	1230 0001 1047	际	12-30	0.00			0			
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1230 0001 1049	康希诺	2022- 12-30	146,0 20.00	1,000.00	14	3.4 0	13.79	146,020.00	13.79
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1230 0001 1051	金山办 公	2022- 12-30	264,4 90.00	1,000.00	14	3.4 0	24.98	264,490.00	24.98
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1230 0001 2397	容百科 技	2022- 12-30	68,75 0.00	1,000.00	14	3.4 0	6.49	68,750.00	6.49
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1230 0001 2417	天合光 能	2022- 12-30	1,912 ,800. 00	30,000.00	14	3.4 0	180.6 5	1,912,800.0 0	180.65
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1229 0001 3835	大全能 源	2022- 12-29	951,4 00.00	20,000.00	14	3.4 0	179.7 1	951,400.00	179.71
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1229 0001 3837	澜起科 技	2022- 12-29	3,819 ,000. 00	60,000.00	14	3.4 0	721.3 7	3,819,000.0 0	721.37
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1229 0001 4141	金山办 公	2022- 12-29	267,0 00.00	1,000.00	14	3.4 0	50.43	267,000.00	50.43
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1229 0001 4143	天合光 能	2022- 12-29	316,0 00.00	5,000.00	14	3.4 0	59.69	316,000.00	59.69
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1229 0001 4147	中芯国 际	2022- 12-29	40,89 0.00	1,000.00	14	3.4 0	7.72	40,890.00	7.72
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1228 0002 4405	澜起科 技	2022- 12-28	4,451 ,300. 00	70,000.00	14	3.4 0	1,261 .20	4,451,300.0 0	1,261.20
国泰君 安证券	2022 1228	大全能 源	2022- 12-28	1,444 ,200.	30,000.00	14	3.4 0	409.1 9	1,444,200.0 0	409.19

股份有 限公司	0002 4407			00						
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1228 0002 8007	天合光 能	2022- 12-28	627,2 00.00	10,000.00	14	3.4 0	177.7 1	627,200.00	177.71
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1228 0002 8011	中芯国 际	2022- 12-28	40,90 0.00	1,000.00	14	3.4 0	11.59	40,900.00	11.59
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1228 0002 8013	金山办 公	2022- 12-28	259,4 10.00	1,000.00	14	3.4 0	73.50	259,410.00	73.50
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1193	天合光 能	2022- 12-21	53,65 0.00	1,000.00	14	3.4 0	50.67	53,650.00	50.67
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1195	金山办 公	2022- 12-21	240,9 60.00	1,000.00	14	3.4 0	227.5 7	240,960.00	227.57
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1197	中芯国 际	2022- 12-21	41,29 0.00	1,000.00	14	3.4 0	39.00	41,290.00	39.00
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1209	容百科 技	2022- 12-21	69,64 0.00	1,000.00	14	3.4 0	65.77	69,640.00	65.77
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1211	康希诺	2022- 12-21	171,1 00.00	1,000.00	14	3.4 0	161.5 9	171,100.00	161.59
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1221 0002 1213	君实生 物	2022- 12-21	3,780 ,000. 00	70,000.00	14	3.4 0	3,570 .00	3,780,000.0 0	3,570.00
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1219 0000 3197	天合光 能	2022- 12-19	1,100 ,200. 00	20,000.00	14	3.4 0	1,246 .89	1,100,200.0 0	1,246.89
国泰君 安证券 股份有	2022 1219 0000	华熙生 物	2022- 12-19	125,9 80.00	1,000.00	14	3.4 0	142.7 8	125,980.00	142.78

限公司	3199									
国泰君安证券股份有限公司	2022 1219 0000 3201	中芯国际	2022- 12-19	41,78 0.00	1,000.00	14	3.4 0	47.35	41,780.00	47.35
国泰君安证券股份有限公司	2022 1219 0000 3203	华润微	2022- 12-19	1,644 ,900. 00	30,000.00	14	3.4 0	1,864 .22	1,644,900.0 0	1,864.22
国泰君安证券股份有限公司	2022 1219 0000 3205	大全能源	2022- 12-19	51,32 0.00	1,000.00	14	3.4 0	58.16	51,320.00	58.16
国泰君安证券股份有限公司	2022 1216 0001 0159	容百科技	2022- 12-16	72,23 0.00	1,000.00	14	3.4 0	95.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1216 0001 0161	中芯国际	2022- 12-16	43,00 0.00	1,000.00	14	3.4 0	56.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1216 0001 0989	天合光能	2022- 12-16	1,648 ,500. 00	30,000.00	14	3.4 0	2,179 .68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1216 0001 0991	康希诺	2022- 12-16	195,0 00.00	1,000.00	14	3.4 0	257.8 3	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1216 0001 0993	金山办公	2022- 12-16	253,5 20.00	1,000.00	14	3.4 0	335.2 1	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1215 0000 3660	中芯国际	2022- 12-15	42,77 0.00	1,000.00	14	3.4 0	56.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1215 0000 3662	金山办公	2022- 12-15	259,0 00.00	1,000.00	14	3.4 0	342.4 6	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1215 0000 3664	大全能源	2022- 12-15	1,060 ,200. 00	20,000.00	14	3.4 0	1,401 .82	-	-

国泰君安证券股份有限公司	2022 1215 0000 3666	天合光能	2022-12-15	278,250.00	5,000.00	14	3.40	367.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1215 0000 3668	澜起科技	2022-12-15	3,990,600.00	60,000.00	14	3.40	5,276.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1214 0000 5649	天合光能	2022-12-14	546,600.00	10,000.00	14	3.40	722.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1214 0000 5651	澜起科技	2022-12-14	4,620,700.00	70,000.00	14	3.40	6,109.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1214 0000 5653	中芯国际	2022-12-14	42,570.00	1,000.00	14	3.40	56.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1214 0000 5655	大全能源	2022-12-14	1,584,600.00	30,000.00	14	3.40	2,095.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1214 0000 5657	金山办公	2022-12-14	257,780.00	1,000.00	14	3.40	340.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1207 0001 0506	天合光能	2022-12-07	57,550.00	1,000.00	14	3.40	76.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1207 0001 0508	金山办公	2022-12-07	254,490.00	1,000.00	14	3.40	336.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1207 0001 0510	中芯国际	2022-12-07	41,920.00	1,000.00	14	3.40	55.43	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022 1207 0001 2454	容百科技	2022-12-07	80,180.00	1,000.00	14	3.40	106.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022	康希诺	2022-	182,6	1,000.00	14	3.4	241.4	-	-

安证券 股份有 限公司	1207 0001 2456		12-07	00.00			0	4		
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1207 0001 2458	君实生 物	2022- 12-07	4,032 ,700. 00	70,000.00	14	3.4 0	5,332 .13	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1202 0000 1188	容百科 技	2022- 12-02	77,12 0.00	1,000.00	14	3.4 0	101.9 7	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1202 0000 1190	中芯国 际	2022- 12-02	40,65 0.00	1,000.00	14	3.4 0	53.75	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1202 0000 1192	天合光 能	2022- 12-02	2,019 ,300. 00	30,000.00	14	3.4 0	2,669 .96	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1202 0000 1194	康希诺	2022- 12-02	205,0 10.00	1,000.00	14	3.4 0	271.0 7	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1202 0000 1196	金山办 公	2022- 12-02	255,3 00.00	1,000.00	14	3.4 0	337.5 6	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1123 0000 1257	容百科 技	2022- 11-23	76,68 0.00	1,000.00	14	3.4 0	101.3 9	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1123 0000 1259	天合光 能	2022- 11-23	66,27 0.00	1,000.00	14	3.4 0	87.62	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1123 0000 1261	康希诺	2022- 11-23	205,1 90.00	1,000.00	14	3.4 0	271.3 1	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1123 0000 1263	金山办 公	2022- 11-23	265,3 00.00	1,000.00	14	3.4 0	350.7 9	-	-
国泰君 安证券	2022 1123	中芯国 际	2022- 11-23	40,77 0.00	1,000.00	14	3.4 0	53.91	-	-

股份有 限公司	0000 1265									
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 1123 0000 1267	君实生 物	2022- 11-23	4,541 ,600. 00	70,000.00	14	3.4 0	6,005 .00	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0921 0002 5852	天合光 能	2022- 09-21	662,3 00.00	10,000.00	28	3.4 0	1,751 .42	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0921 0002 5854	金山办 公	2022- 09-21	210,8 90.00	1,000.00	28	3.4 0	557.6 9	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0921 0002 9660	中芯国 际	2022- 09-21	38,45 0.00	1,000.00	28	3.4 0	101.6 8	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0921 0002 9662	中微公 司	2022- 09-21	116,6 50.00	1,000.00	28	3.4 0	308.4 7	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0921 0002 9664	沪硅产 业	2022- 09-21	1,548 ,000. 00	80,000.00	28	3.4 0	4,093 .60	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0916 0001 1090	中芯国 际	2022- 09-16	39,79 0.00	1,000.00	14	3.4 0	52.61	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0916 0001 1158	天合光 能	2022- 09-16	663,2 00.00	10,000.00	14	3.4 0	876.9 0	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0916 0001 1166	金山办 公	2022- 09-16	220,9 90.00	1,000.00	14	3.4 0	292.2 0	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0916 0001 2846	沪硅产 业	2022- 09-16	2,008 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	2,655 .02	-	-
国泰君 安证券 股份有	2022 0916 0001	中微公 司	2022- 09-16	1,291 ,400. 00	10,000.00	14	3.4 0	1,707 .52	-	-

限公司	2848									
国泰君安证券股份有限公司	2022090200009071	中微公司	2022-09-02	1,235,100.00	10,000.00	14	3.40	1,633.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022090200010369	金山办公	2022-09-02	188,350.00	1,000.00	14	3.40	249.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022090200010371	沪硅产业	2022-09-02	2,016,000.00	100,000.00	14	3.40	2,665.60	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022090200010373	中芯国际	2022-09-02	40,400.00	1,000.00	14	3.40	53.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022090200010375	天合光能	2022-09-02	728,000.00	10,000.00	14	3.40	962.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082900019351	中芯国际	2022-08-29	40,080.00	1,000.00	28	3.40	105.99	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082900019361	沪硅产业	2022-08-29	1,600,000.00	80,000.00	28	3.40	4,231.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082900019363	中微公司	2022-08-29	125,570.00	1,000.00	28	3.40	332.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082900019377	金山办公	2022-08-29	163,000.00	1,000.00	28	3.40	431.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082900019389	天合光能	2022-08-29	368,000.00	5,000.00	28	3.40	973.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082400026385	天合光能	2022-08-24	710,000.00	10,000.00	28	3.40	1,877.56	-	-

国泰君安证券股份有限公司	2022082400026387	中芯国际	2022-08-24	39,700.00	1,000.00	28	3.40	104.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082400026389	中微公司	2022-08-24	130,810.00	1,000.00	28	3.40	345.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082400026391	沪硅产业	2022-08-24	1,624,000.00	80,000.00	28	3.40	4,294.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022082400026393	金山办公	2022-08-24	168,000.00	1,000.00	28	3.40	444.27	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081900008974	金山办公	2022-08-19	170,120.00	1,000.00	14	3.40	224.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081900008976	沪硅产业	2022-08-19	2,157,000.00	100,000.00	14	3.40	2,852.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081900008978	中芯国际	2022-08-19	40,990.00	1,000.00	14	3.40	54.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081900008982	天合光能	2022-08-19	721,900.00	10,000.00	14	3.40	954.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081900008984	中微公司	2022-08-19	1,368,000.00	10,000.00	14	3.40	1,808.80	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081500015769	中芯国际	2022-08-15	41,840.00	1,000.00	14	3.40	55.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081500015771	天合光能	2022-08-15	422,400.00	5,000.00	14	3.40	558.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022081500015771	金山办公	2022-08-15	186,600.00	1,000.00	14	3.40	246.80	-	-



安证券 股份有 限公司	0815 0001 5773	公	08-15	60.00			0	1		
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0815 0001 5775	沪硅产 业	2022- 08-15	1,744 ,800. 00	80,000.00	14	3.4 0	2,307 .01	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0815 0001 5777	中微公 司	2022- 08-15	139,8 10.00	1,000.00	14	3.4 0	184.8 6	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0805 0000 1346	天合光 能	2022- 08-05	788,6 00.00	10,000.00	14	3.4 0	1,042 .70	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0805 0000 1348	金山办 公	2022- 08-05	202,1 60.00	1,000.00	14	3.4 0	267.3 0	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0805 0000 1350	沪硅产 业	2022- 08-05	2,329 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	3,079 .46	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0805 0000 1352	中芯国 际	2022- 08-05	44,34 0.00	1,000.00	14	3.4 0	58.63	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0805 0000 1354	中微公 司	2022- 08-05	1,475 ,000. 00	10,000.00	14	3.4 0	1,950 .28	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0801 0000 0792	中芯国 际	2022- 08-01	40,18 0.00	1,000.00	14	3.4 0	53.13	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0801 0000 0794	天合光 能	2022- 08-01	409,0 00.00	5,000.00	14	3.4 0	540.7 9	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0801 0000 0796	金山办 公	2022- 08-01	174,0 00.00	1,000.00	14	3.4 0	230.0 7	-	-
国泰君 安证券	2022 0801	沪硅产 业	2022- 08-01	1,610 ,400.	80,000.00	14	3.4 0	2,129 .31	-	-

股份有 限公司	0000 0798			00							
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0801 0000 0800	中微公 司	2022- 08-01	126,8 60.00	1,000.00	14	3.4 0	167.7 4	-	-	
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0727 0000 1285	天合光 能	2022- 07-27	804,0 00.00	10,000.00	28	3.4 0	2,126 .13	-	-	
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0727 0000 1287	中芯国 际	2022- 07-27	40,96 0.00	1,000.00	28	3.4 0	108.3 2	-	-	
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0727 0000 1289	中微公 司	2022- 07-27	121,7 20.00	1,000.00	28	3.4 0	321.8 8	-	-	
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0727 0000 1291	沪硅产 业	2022- 07-27	1,635 ,200. 00	80,000.00	28	3.4 0	4,324 .20	-	-	
国泰君 安证券 股份有 限公司	2022 0727 0000 1293	金山办 公	2022- 07-27	177,5 70.00	1,000.00	28	3.4 0	469.5 7	-	-	
上年度可比期间											
2021年1月1日至2021年12月31日											
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成交 时间	交易 金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位:天 )	费率 ( %)	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 安证券 股份有 限公司	2021 0824 0000 1377	中微公 司	2021- 12-31	182,0 00.00	1,000.00	28	3.4 0	498.4 8	-	-	

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 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	4,620,470.00	0.08%	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	44,181,625.00	0.79%	38,881,625.00	0.70%

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	54,528,599.15	205,263.95	48,892,471.71	200,579.11

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。

#### 7.4.10.7 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 12 月 31 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	113057	中银转债	老股东配售	25,300.00	2,530,000.00
国泰君安证券股份有限公司	688031	星环科技	网下申购	12,047.00	573,156.50

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 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	113655	欧 22 转债	老股东配 售	9,550.00	955,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	603182	嘉华股份	网下申购	546.00	5,760.30
国泰君安证 券股份有限 公司	688459	哈铁科技	网下申购	17,259.00	235,549.11
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
国泰君安证 券股份有限 公司	113661	福 22 转债	老股东配 售	20,730.00	2,073,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	603170	宝立食品	网下申购	542.00	5,447.10
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安证 券股份有限 公司	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安证 券股份有限 公司	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安证 券股份有限 公司	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安证	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92

券股份有限 公司					
国泰君安证 券股份有限 公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安证 券股份有限 公司	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安证 券股份有限 公司	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安证 券股份有限 公司	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安证 券股份有限 公司	113042	上银转债	老股东配 售	278,560.00	27,856,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113049	长汽转债	老股东配 售	13,460.00	1,346,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	113050	南银转债	老股东配 售	181,550.00	18,155,000.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688718	唯赛勃	网下申购	3,145.00	18,490.24
国泰君安证 券股份有限 公司	605507	国邦医药	网下申购	1,202.00	39,149.14
国泰君安证 券股份有限 公司	605589	圣泉集团	网下申购	1,750.00	42,017.50
国泰君安证 券股份有限 公司	601825	沪农商行	网下申购	15,480.00	137,772.00
国泰君安证 券股份有限 公司	688187	时代电气	网下申购	33,865.00	1,067,997.12
国泰君安证 券股份有限 公司	688767	博拓生物	网下申购	2,220.00	77,084.51
国泰君安证 券股份有限 公司	688232	新点软件	网下申购	18,893.00	920,702.18

国泰君安证券股份有限公司	688190	云路股份	网下申购	3,026.00	141,807.89
国泰君安证券股份有限公司	688235	百济神州	网下申购	19,217.00	3,719,700.17
国泰君安证券股份有限公司	113052	兴业转债	老股东配售	307,160.00	30,716,000.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 7,861,380 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 145,532,448.79 元，估值总额为人民币 106,836,154.20 元，占基金资产净值的比例为 0.55%(于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 7,952,580 股国泰君安的 A 股普通股，成本总额为人民币 149,586,081.02 元，估值总额为人民币 142,271,656.20 元，占基金资产净值的比例为 0.62%)。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有国泰君安的 A 股融出证券股（于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 10,000 股国泰君安的 A 股融出证券股，成本总额为人民币 188,138.75 元，估值总额为人民币 178,900.00 元，占基金资产净值的比例为 0.0008%）。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 11,707,672 股托管人建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 72,821,839.49 元，估值总额为人民币 65,914,193.36 元，占基金资产净值的比例为 0.34%(于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 11,614,172 股托管人建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 72,687,922.41 元，估值总额为人民币 68,059,047.92 元，占基金资产净值的比例为 0.30%)。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有托管人建设银行的 A 股融出证券股（于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 240,000 股托管人建设银行的 A 股融出证券股，成本总额为人民币 1,530,467.14 元，估值总额为人民币 1,406,400.00 元，占基金资产净值的比例为 0.0061%）。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688332	中科蓝讯	2022-07-08	1-6 个月(含)	新股限售	91.66	50.21	5,870	538,044.20	294,732.70	-
688376	美埃科技	2022-11-10	1-6 个月(含)	新股限售	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-
688252	天德钰	2022-09-20	1-6 个月(含)	新股限售	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688292	浩瀚深度	2022-08-09	1-6 个月(含)	新股限售	16.56	14.67	4,503	74,569.68	66,059.01	-

注：1. 根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022-12-26	重大事项或临时停牌	46.41	2023-01-10	51.05	511,524	22,989,122.18	23,739,828.84	

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	57.71	130,000.00	7,502,300.00
2	600010	包钢股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 10 日	1.92	2,910,000.00	5,587,200.00
3	600011	华能国际	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	7.61	480,000.00	3,652,800.00



4	600025	华能水电	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 11 日	6.60	210,000.00	1,386,000.00
5	600031	三一重工	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	15.80	1,070,000.00	16,906,000.00
6	600038	中直股份	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 9 日	46.41	50,000.00	2,320,500.00
7	600048	保利发展	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	15.13	550,000.00	8,321,500.00
8	600050	中国联通	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 16 日	4.48	4,740,000.00	21,235,200.00
9	600085	同仁堂	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	44.68	20,000.00	893,600.00
10	600096	云天化	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	21.04	380,000.00	7,995,200.00
11	600104	上汽集团	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 16 日	14.41	440,000.00	6,340,400.00
12	600111	北方稀土	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 6 日	25.05	320,000.00	8,016,000.00
13	600132	重庆啤酒	2023 年 1 月 9 日- 2023 年 1 月 9 日	127.38	20,000.00	2,547,600.00
14	600141	兴发集团	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	29.00	240,000.00	6,960,000.00
15	600150	中国船舶	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	22.28	60,000.00	1,336,800.00
16	600176	中国巨石	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 11 日	13.71	50,000.00	685,500.00
17	600188	兖矿能源	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	33.58	270,000.00	9,066,600.00
18	600196	复星医药	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 30 日	35.24	410,000.00	14,448,400.00
19	600219	南山铝业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 6 日	3.27	510,000.00	1,667,700.00
20	600276	恒瑞医药	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	38.53	30,000.00	1,155,900.00
21	600298	安琪酵母	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	45.22	150,000.00	6,783,000.00
22	600309	万华化学	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	92.65	40,000.00	3,706,000.00
23	600346	恒力石化	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 10 日	15.53	200,000.00	3,106,000.00
24	600383	金地集团	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 30 日	10.23	640,000.00	6,547,200.00
25	600436	片仔癀	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 6 日	288.46	20,000.00	5,769,200.00

26	600438	通威股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 19 日	38.58	750,000.00	28,935,000.00
27	600460	士兰微	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 18 日	32.79	240,000.00	7,869,600.00
28	600487	亨通光电	2023 年 1 月 13 日- 2023 年 1 月 13 日	15.06	50,000.00	753,000.00
29	600499	科达制造	2023 年 1 月 11 日- 2023 年 1 月 20 日	14.21	200,000.00	2,842,000.00
30	600516	方大炭素	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	6.12	610,000.00	3,733,200.00
31	600521	华海药业	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	21.86	250,000.00	5,465,000.00
32	600522	中天科技	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	16.15	220,000.00	3,553,000.00
33	600547	山东黄金	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	19.16	20,000.00	383,200.00
34	600570	恒生电子	2023 年 1 月 6 日- 2023 年 1 月 6 日	40.46	30,000.00	1,213,800.00
35	600584	长电科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 9 日	23.05	140,000.00	3,227,000.00
36	600585	海螺水泥	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 5 日	27.38	80,000.00	2,190,400.00
37	600588	用友网络	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 4 日	24.17	60,000.00	1,450,200.00
38	600598	北大荒	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	13.76	80,000.00	1,100,800.00
39	600660	福耀玻璃	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 16 日	35.07	90,000.00	3,156,300.00
40	600690	海尔智家	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 10 日	24.46	50,000.00	1,223,000.00
41	600699	均胜电子	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 9 日	14.05	180,000.00	2,529,000.00
42	600732	爱旭股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 30 日	37.82	210,000.00	7,942,200.00
43	600741	华域汽车	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 10 日	17.33	40,000.00	693,200.00
44	600745	闻泰科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	52.58	140,000.00	7,361,200.00
45	600760	中航沈飞	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 10 日	58.63	20,000.00	1,172,600.00
46	600763	通策医疗	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 11 日	152.99	20,000.00	3,059,800.00
47	600765	中航重机	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 5 日	31.09	30,000.00	932,700.00

48	600779	水井坊	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 9 日	84.42	60,000.00	5,065,200.0 0
49	600809	山西汾酒	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 10 日	284.9 9	90,000.00	25,649,100. 00
50	600837	海通证券	2023 年 1 月 5 日- 2023 年 1 月 5 日	8.69	600,000.00	5,214,000.0 0
51	600872	中炬高新	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 17 日	36.87	160,000.00	5,899,200.0 0
52	600873	梅花生物	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	10.18	80,000.00	814,400.00
53	600875	东方电气	2023 年 1 月 12 日- 2023 年 1 月 13 日	21.02	100,000.00	2,102,000.0 0
54	600884	杉杉股份	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 9 日	18.20	150,000.00	2,730,000.0 0
55	600887	伊利股份	2023 年 1 月 16 日- 2023 年 1 月 16 日	31.00	30,000.00	930,000.00
56	600905	三峡能源	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	5.65	340,000.00	1,921,000.0 0
57	600906	财达证券	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	7.57	260,000.00	1,968,200.0 0
58	600918	中泰证券	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 2 日	6.41	40,000.00	256,400.00
59	600919	江苏银行	2023 年 1 月 12 日- 2023 年 1 月 12 日	7.29	80,000.00	583,200.00
60	600938	中国海油	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 11 日	15.20	20,000.00	304,000.00
61	600958	东方证券	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 4 日	8.94	40,000.00	357,600.00
62	600989	宝丰能源	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 30 日	12.07	80,000.00	965,600.00
63	601012	隆基绿能	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	42.26	260,000.00	10,987,600. 00
64	601016	节能风电	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	3.81	1,080,000.0 0	4,114,800.0 0
65	601088	中国神华	2023 年 1 月 9 日- 2023 年 1 月 9 日	27.62	100,000.00	2,762,000.0 0
66	601100	恒立液压	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 10 日	63.15	50,000.00	3,157,500.0 0
67	601108	财通证券	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	7.12	580,000.00	4,129,600.0 0
68	601111	中国国航	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	10.60	1,010,000.0 0	10,706,000. 00
69	601155	新城控股	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 12 日	20.50	310,000.00	6,355,000.0 0

70	601169	北京银行	2023 年 1 月 11 日- 2023 年 1 月 11 日	4.31	100,000.00	431,000.00
71	601186	中国铁建	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	7.73	740,000.00	5,720,200.00
72	601225	陕西煤业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 9 日	18.58	390,000.00	7,246,200.00
73	601233	桐昆股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	14.45	310,000.00	4,479,500.00
74	601238	广汽集团	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	11.03	170,000.00	1,875,100.00
75	601319	中国人保	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	5.22	100,000.00	522,000.00
76	601336	新华保险	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 10 日	30.08	30,000.00	902,400.00
77	601360	三六零	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	6.54	270,000.00	1,765,800.00
78	601390	中国中铁	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	5.56	570,000.00	3,169,200.00
79	601456	国联证券	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 12 日	11.25	220,000.00	2,475,000.00
80	601600	中国铝业	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 9 日	4.47	620,000.00	2,771,400.00
81	601601	中国太保	2023 年 1 月 16 日- 2023 年 1 月 16 日	24.52	20,000.00	490,400.00
82	601607	上海医药	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	17.83	320,000.00	5,705,600.00
83	601615	明阳智能	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	25.26	380,000.00	9,598,800.00
84	601618	中国中冶	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 17 日	3.18	1,310,000.00	4,165,800.00
85	601628	中国人寿	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	37.12	460,000.00	17,075,200.00
86	601633	长城汽车	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 12 日	29.62	390,000.00	11,551,800.00
87	601636	旗滨集团	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	11.39	220,000.00	2,505,800.00
88	601668	中国建筑	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 4 日	5.43	800,000.00	4,344,000.00
89	601669	中国电建	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 30 日	7.08	2,500,000.00	17,700,000.00
90	601689	拓普集团	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	58.58	80,000.00	4,686,400.00
91	601696	中银证券	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	10.57	450,000.00	4,756,500.00

92	601728	中国电信	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 4 日	4.19	800,000.00	3,352,000.0 0
93	601788	光大证券	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	14.87	210,000.00	3,122,700.0 0
94	601800	中国交建	2023 年 1 月 4 日- 2023 年 1 月 16 日	8.05	750,000.00	6,037,500.0 0
95	601857	中国石油	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 10 日	4.97	40,000.00	198,800.00
96	601865	福莱特	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	33.31	170,000.00	5,662,700.0 0
97	601868	中国能建	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 12 日	2.29	1,780,000.0 0	4,076,200.0 0
98	601872	招商轮船	2023 年 1 月 11 日- 2023 年 1 月 13 日	5.59	140,000.00	782,600.00
99	601877	正泰电器	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 13 日	27.70	70,000.00	1,939,000.0 0
100	601878	浙商证券	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	9.93	170,000.00	1,688,100.0 0
101	601888	中国中免	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 16 日	216.0 3	50,000.00	10,801,500. 00
102	601899	紫金矿业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	10.00	70,000.00	700,000.00
103	601919	中远海控	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 17 日	10.29	310,000.00	3,189,900.0 0
104	601966	玲珑轮胎	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 10 日	20.48	40,000.00	819,200.00
105	601988	中国银行	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 11 日	3.16	190,000.00	600,400.00
106	603019	中科曙光	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	22.14	400,000.00	8,856,000.0 0
107	603026	胜华新材	2023 年 1 月 10 日- 2023 年 1 月 30 日	92.30	20,000.00	1,846,000.0 0
108	603185	上机数控	2023 年 1 月 5 日- 2023 年 1 月 5 日	105.8 5	20,000.00	2,117,000.0 0
109	603260	合盛硅业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 9 日	82.94	50,000.00	4,147,000.0 0
110	603288	海天味业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 6 日	79.60	110,000.00	8,756,000.0 0
111	603290	斯达半导	2023 年 1 月 6 日- 2023 年 1 月 6 日	329.3 0	10,000.00	3,293,000.0 0
112	603345	安井食品	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 10 日	161.8 8	20,000.00	3,237,600.0 0
113	603369	今世缘	2023 年 1 月 9 日- 2023 年 1 月 9 日	50.90	20,000.00	1,018,000.0 0

114	603392	万泰生物	2023 年 1 月 5 日- 2023 年 1 月 6 日	126.7 0	20,000.00	2,534,000.0 0
115	603486	科沃斯	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	72.94	70,000.00	5,105,800.0 0
116	603501	韦尔股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	77.09	10,000.00	770,900.00
117	603517	绝味食品	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 30 日	61.09	110,000.00	6,719,900.0 0
118	603589	口子窖	2023 年 1 月 2 日- 2023 年 1 月 12 日	57.67	110,000.00	6,343,700.0 0
119	603606	东方电缆	2023 年 1 月 6 日- 2023 年 1 月 12 日	67.83	20,000.00	1,356,600.0 0
120	603659	璞泰来	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 3 日	51.89	20,000.00	1,037,800.0 0
121	603799	华友钴业	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 4 日	55.63	80,000.00	4,450,400.0 0
122	603806	福斯特	2023 年 1 月 5 日- 2023 年 1 月 30 日	66.44	30,000.00	1,993,200.0 0
123	603882	金域医学	2023 年 1 月 12 日- 2023 年 1 月 12 日	78.20	10,000.00	782,000.00
124	603986	兆易创新	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	102.4 7	70,000.00	7,172,900.0 0
125	603993	洛阳钼业	2023 年 1 月 6 日- 2023 年 1 月 10 日	4.55	560,000.00	2,548,000.0 0
126	605117	德业股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	331.2 0	30,000.00	9,936,000.0 0
127	605358	立昂微	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	42.60	40,000.00	1,704,000.0 0
128	605499	东鹏饮料	2023 年 1 月 5 日- 2023 年 1 月 5 日	177.9 0	10,000.00	1,779,000.0 0
129	688005	容百科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	68.75	27,000.00	1,856,250.0 0
130	688008	澜起科技	2023 年 1 月 11 日- 2023 年 1 月 13 日	62.60	140,000.00	8,764,000.0 0
131	688012	中微公司	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	98.01	70,000.00	6,860,700.0 0
132	688063	派能科技	2023 年 1 月 13 日- 2023 年 1 月 13 日	315.6 5	3,000.00	946,950.00
133	688111	金山办公	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	264.4 9	14,000.00	3,702,860.0 0
134	688180	君实生物	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	62.60	115,000.00	7,199,000.0 0
135	688185	康希诺	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	146.0 2	8,000.00	1,168,160.0 0

136	688303	大全能源	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	47.68	54,000.00	2,574,720.0 0
137	688363	华熙生物	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	135.2 8	23,000.00	3,111,440.0 0
138	688396	华润微	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	52.65	61,000.00	3,211,650.0 0
139	688599	天合光能	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	63.76	301,000.00	19,191,760. 00
140	688981	中芯国际	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 13 日	41.14	9,000.00	370,260.00
合计	-	-	-	-	40,875,000. 00	645,066,450 .00

#### 7.4.13 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。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。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资(2021 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.13%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借



入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面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超过经确认的当日净赎回金额变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	54,528,599.15	-	-	-	54,528,599.15
结算备付金	25,179.79	-	-	-	25,179.79
存出保证金	77,141.53	-	-	-	77,141.53
交易性金融资产	-	-	-	19,269,311,606.24	19,269,311,606.24
应收清算款	-	-	-	1,328,906.70	1,328,906.70
应收股利	-	-	-	11,046.00	11,046.00
其他资产	-	-	-	326,957.72	326,957.72
资产总计	54,630,920.47	-	-	19,270,978,516.66	19,325,609,437.13
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	-	-	-	14,913,665.16	14,913,665.16
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,187,205.57	8,187,205.57
应付托管费	-	-	-	1,637,441.12	1,637,441.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6.40	6.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,840,734.99	2,840,734.99
负债总计	-	-	-	27,579,053.24	27,579,053.24
利率敏感度缺口	54,630,920.47	-	-	19,243,399,463.42	19,298,030,383.89
<b>上年度末</b>					
<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
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	-	-	22,824,978,874.5	22,855,694,874.5

				7	4.57
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	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
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负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.13%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。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，上证 180 指数成份股和备选成份股股票(含存托凭证)投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股(含存托凭证)、债券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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	19,269,311,606.2 4	99.85	22,824,978, 874.57	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	-	-	-	-
合计	19,269,311,606.2 4	99.85	22,824,978, 874.57	99.73

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 961,080,000.00	增加约 1,141,170,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 961,080,000.00	减少约 1,141,170,000.00

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	19,245,023,130.54	22,821,056,411.28
第二层次	23,739,828.84	30,716,000.00
第三层次	548,646.86	3,922,463.29
合计	19,269,311,606.24	22,855,694,874.57

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,922,463.29	3,922,463.29
当期购买	-	1,177,604.03	1,177,604.03
当期 出售/结 算	-		-
转入 第三层次	-		-
转出 第三层次	-	7,785,555.86	7,785,555.86
当期 利得或损 失总额	-	3,234,135.40	3,234,135.40
其中： 计入损益 的利得或 损失	-	2,515,821.58	2,515,821.58
计入其他 综合收益 的利得或 损失（若 有）	-		-
期末 余额	-	548,646.86	548,646.86
期末 仍持有的 第三层次 金融资产 计入本期 损益的未 实现利得 或损失的 变动—— 公允价值 变动损益	-	-285,107.17	-285,107.17
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	

期初余额	-		-
当期购买	-	5,188,050.46	5,188,050.46
当期 出售/结 算	-		-
转入 第三层次	-		-
转出 第三层次	-		-
当期 利得或损 失总额	-	-1,265,587.17	-1,265,587.17
其中： 计入损益 的利得或 损失	-	-1,265,587.17	-1,265,587.17
计入其他 综合收益 的利得或 损失（若 有）	-		-
期末 余额	-	3,922,463.29	3,922,463.29
期末 仍持有的 第三层次 金融资产 计入本期 损益的未 实现利得 或损失的 变动—— 公允价值 变动损益	-	1,904,937.10	1,904,937.10

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估值技术	不可观察输入值
----	--------	---------	---------

	值		名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	548,646.86	平均价格亚式期权模型	预期波动率	42.27%-64.12%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	3,922,463.29	平均价格亚式期权模型	预期波动率	17.17%-75.03%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2022 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 991,584,490.51 元(2021 年度：887,114,283.55 元)，其中包括以股票支付的申购款 1,065,271,752.42 元和以现金支付的申购款-73,687,261.91 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 934,043,793.72 元和以现金支付的申购款-46,929,510.17 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,269,311,606.24	99.71
	其中：股票	19,269,311,606.24	99.71



2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	54,553,778.94	0.28
8	其他各项资产	1,744,051.95	0.01
9	合计	19,325,609,437.13	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 586,108,700.00 元，占基金资产净值的比例为 3.04%。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	17,040,384.00	0.09
B	采矿业	966,187,988.80	5.01
C	制造业	9,157,368,910.95	47.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	771,065,548.76	4.00
E	建筑业	645,098,583.34	3.34
F	批发和零售业	34,579,270.21	0.18

G	交通运输、仓储和邮政业	301,637,164.41	1.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	779,093,462.12	4.04
J	金融业	5,560,327,695.89	28.81
K	房地产业	278,003,698.67	1.44
L	租赁和商务服务业	368,929,121.04	1.91
M	科学研究和技术服务业	289,686,780.00	1.50
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	99,744,351.19	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,268,762,959.38	99.85

### 8.2.2 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	400,516.07	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	148,130.79	0.00
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	548,646.86	0.00

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,095,623	1,892,140,921.00	9.80
2	601318	中国平安	18,888,997	887,782,859.00	4.60
3	600036	招商银行	21,583,221	804,190,814.46	4.17
4	601012	隆基绿能	10,573,006	446,815,233.56	2.32
5	601166	兴业银行	25,363,595	446,145,636.05	2.31
6	600900	长江电力	19,832,963	416,492,223.00	2.16
7	601888	中国中免	1,707,768	368,929,121.04	1.91
8	600887	伊利股份	11,156,324	345,846,044.00	1.79
9	600030	中信证券	17,015,738	338,783,343.58	1.76
10	600309	万华化学	3,284,000	304,262,600.00	1.58
11	600276	恒瑞医药	7,787,436	300,049,909.08	1.55
12	603259	药明康德	3,576,380	289,686,780.00	1.50

13	601398	工商银行	61,127,028	265,291,301.52	1.37
14	601899	紫金矿业	25,133,810	251,338,100.00	1.30
15	600809	山西汾酒	853,500	243,238,965.00	1.26
16	601328	交通银行	47,916,449	227,123,968.26	1.18
17	601668	中国建筑	36,563,890	198,541,922.70	1.03
18	603288	海天味业	2,422,065	192,796,374.00	1.00
19	600048	保利发展	12,521,162	189,445,181.06	0.98
20	600438	通威股份	4,705,750	181,547,835.00	0.94
21	600031	三一重工	10,361,667	163,714,338.60	0.85
22	601288	农业银行	55,676,115	162,017,494.65	0.84
23	600690	海尔智家	6,601,836	161,480,908.56	0.84
24	601088	中国神华	5,749,764	158,808,481.68	0.82
25	600436	片仔癀	532,175	153,511,200.50	0.80
26	600919	江苏银行	20,602,564	150,192,691.56	0.78
27	600016	民生银行	43,289,137	149,347,522.65	0.77
28	600000	浦发银行	20,473,230	149,045,114.40	0.77
29	600050	中国联通	33,212,037	148,789,925.76	0.77
30	600837	海通证券	16,831,472	146,265,491.68	0.76
31	601601	中国太保	5,963,619	146,227,937.88	0.76
32	600406	国电南瑞	5,834,525	142,362,410.00	0.74
33	688981	中芯国际	3,411,253	140,338,948.42	0.73
34	600089	特变电工	6,751,846	135,577,067.68	0.70
35	601225	陕西煤业	6,761,335	125,625,604.30	0.65
36	603799	华友钴业	2,228,980	123,998,157.40	0.64
37	688599	天合光能	1,893,191	120,709,858.16	0.63
38	603986	兆易创新	1,162,664	119,138,180.08	0.62
39	600104	上汽集团	8,145,498	117,376,626.18	0.61
40	601988	中国银行	36,730,433	116,068,168.28	0.60
41	600585	海螺水泥	4,187,798	114,661,909.24	0.59
42	601688	华泰证券	8,980,207	114,407,837.18	0.59
43	601919	中远海控	11,106,524	114,286,131.96	0.59
44	601728	中国电信	27,042,643	113,308,674.17	0.59
45	601169	北京银行	25,809,033	111,236,932.23	0.58
46	601628	中国人寿	2,907,897	107,941,136.64	0.56
47	600570	恒生电子	2,646,447	107,075,245.62	0.55
48	601211	国泰君安	7,861,380	106,836,154.20	0.55
49	600028	中国石化	23,331,691	101,726,172.76	0.53
50	600009	上海机场	1,740,775	100,460,125.25	0.52
51	601390	中国中铁	17,900,240	99,525,334.40	0.52
52	601985	中国核电	16,439,734	98,638,404.00	0.51
53	600893	航发动力	2,323,395	98,233,140.60	0.51
54	600660	福耀玻璃	2,790,583	97,865,745.81	0.51
55	603501	韦尔股份	1,237,661	95,411,286.49	0.49
56	600111	北方稀土	3,795,457	95,076,197.85	0.49

57	601009	南京银行	8,985,639	93,630,358.38	0.49
58	601669	中国电建	13,203,659	93,481,905.72	0.48
59	601818	光大银行	28,848,776	88,565,742.32	0.46
60	601658	邮储银行	18,972,700	87,653,874.00	0.45
61	688008	澜起科技	1,388,083	86,893,995.80	0.45
62	600019	宝钢股份	15,534,681	86,838,866.79	0.45
63	600588	用友网络	3,589,809	86,765,683.53	0.45
64	600999	招商证券	6,472,940	86,090,102.00	0.45
65	600426	华鲁恒升	2,588,298	85,802,078.70	0.44
66	600905	三峡能源	14,969,463	84,577,465.95	0.44
67	601857	中国石油	16,940,798	84,195,766.06	0.44
68	688111	金山办公	318,270	84,179,232.30	0.44
69	600958	东方证券	9,114,595	81,484,479.30	0.42
70	600760	中航沈飞	1,364,851	80,021,214.13	0.41
71	600196	复星医药	2,214,911	78,053,463.64	0.40
72	600522	中天科技	4,757,346	76,831,137.90	0.40
73	600010	包钢股份	39,730,789	76,283,114.88	0.40
74	688012	中微公司	766,964	75,170,141.64	0.39
75	601615	明阳智能	2,768,800	69,939,888.00	0.36
76	600150	中国船舶	3,122,097	69,560,321.16	0.36
77	601989	中国重工	19,884,421	69,396,629.29	0.36
78	601377	兴业证券	12,048,537	69,158,602.38	0.36
79	600745	闻泰科技	1,301,615	68,438,916.70	0.35
80	600926	杭州银行	5,175,220	67,691,877.60	0.35
81	600600	青岛啤酒	623,650	67,042,375.00	0.35
82	600795	国电电力	15,527,300	66,301,571.00	0.34
83	601939	建设银行	11,707,672	65,914,193.36	0.34
84	600941	中国移动	946,400	64,042,888.00	0.33
85	601633	长城汽车	2,150,622	63,701,423.64	0.33
86	603659	璞泰来	1,211,440	62,861,621.60	0.33
87	601186	中国铁建	8,017,174	61,972,755.02	0.32
88	603806	福斯特	930,660	61,833,050.40	0.32
89	601600	中国铝业	13,794,200	61,660,074.00	0.32
90	600763	通策医疗	398,861	61,021,744.39	0.32
91	600547	山东黄金	3,153,545	60,421,922.20	0.31
92	601838	成都银行	3,844,412	58,819,503.60	0.30
93	600011	华能国际	7,671,681	58,381,492.41	0.30
94	601995	中金公司	1,525,100	58,152,063.00	0.30
95	601100	恒立液压	912,423	57,619,512.45	0.30
96	600176	中国巨石	4,191,093	57,459,885.03	0.30
97	600584	长电科技	2,479,700	57,157,085.00	0.30
98	600346	恒力石化	3,678,549	57,127,865.97	0.30
99	600383	金地集团	5,508,157	56,348,446.11	0.29
100	603993	洛阳钼业	12,318,820	56,050,631.00	0.29

101	603369	今世缘	1,093,972	55,683,174.80	0.29
102	601111	中国国航	5,213,672	55,264,923.20	0.29
103	600132	重庆啤酒	429,028	54,649,586.64	0.28
104	605117	德业股份	164,900	54,614,880.00	0.28
105	601066	中信建投	2,261,424	53,708,820.00	0.28
106	600085	同仁堂	1,195,000	53,392,600.00	0.28
107	600188	兖矿能源	1,589,500	53,375,410.00	0.28
108	601877	正泰电器	1,878,234	52,027,081.80	0.27
109	601868	中国能建	22,614,500	51,787,205.00	0.27
110	600487	亨通光电	3,436,600	51,755,196.00	0.27
111	603345	安井食品	315,100	51,008,388.00	0.26
112	601117	中国化学	6,395,800	50,782,652.00	0.26
113	688063	派能科技	160,447	50,645,095.55	0.26
114	601788	光大证券	3,404,329	50,622,372.23	0.26
115	601800	中国交建	6,139,544	49,423,329.20	0.26
116	688396	华润微	933,801	49,164,622.65	0.25
117	603606	东方电缆	722,171	48,984,858.93	0.25
118	600460	士兰微	1,477,203	48,437,486.37	0.25
119	600765	中航重机	1,534,115	47,695,635.35	0.25
120	600741	华域汽车	2,745,214	47,574,558.62	0.25
121	600096	云天化	2,239,800	47,125,392.00	0.24
122	600989	宝丰能源	3,831,349	46,244,382.43	0.24
123	603019	中科曙光	2,043,361	45,240,012.54	0.23
124	601689	拓普集团	772,000	45,223,760.00	0.23
125	600732	爱旭股份	1,188,700	44,956,634.00	0.23
126	601336	新华保险	1,450,988	43,645,719.04	0.23
127	688180	君实生物	681,434	42,657,768.40	0.22
128	601233	桐昆股份	2,946,700	42,579,815.00	0.22
129	601238	广汽集团	3,848,741	42,451,613.23	0.22
130	600298	安琪酵母	911,026	41,196,595.72	0.21
131	600875	东方电气	1,937,700	40,730,454.00	0.21
132	600872	中炬高新	1,095,447	40,389,130.89	0.21
133	601108	财通证券	5,665,690	40,339,712.80	0.21
134	600219	南山铝业	12,249,100	40,054,557.00	0.21
135	603392	万泰生物	312,761	39,626,818.70	0.21
136	601618	中国中冶	12,447,635	39,583,479.30	0.21
137	600938	中国海油	2,599,804	39,517,020.80	0.20
138	600141	兴发集团	1,354,000	39,266,000.00	0.20
139	603517	绝味食品	641,531	39,191,128.79	0.20
140	603290	斯达半导	117,700	38,758,610.00	0.20
141	603185	上机数控	365,867	38,727,021.95	0.20
142	603882	金域医学	495,174	38,722,606.80	0.20
143	600873	梅花生物	3,704,800	37,714,864.00	0.20
144	603456	九洲药业	873,800	37,075,334.00	0.19

145	603589	口子窖	632,645	36,484,637.15	0.19
146	600884	杉杉股份	1,964,600	35,755,720.00	0.19
147	605358	立昂微	827,300	35,242,980.00	0.18
148	601699	潞安环能	2,084,800	35,128,880.00	0.18
149	601607	上海医药	1,939,387	34,579,270.21	0.18
150	600521	华海药业	1,547,038	33,818,250.68	0.18
151	600499	科达制造	2,373,100	33,721,751.00	0.17
152	688005	容百科技	489,585	33,658,968.75	0.17
153	601878	浙商证券	3,380,166	33,565,048.38	0.17
154	603077	和邦生物	10,766,500	32,730,160.00	0.17
155	601360	三六零	4,980,031	32,569,402.74	0.17
156	601155	新城控股	1,571,223	32,210,071.50	0.17
157	601636	旗滨集团	2,812,900	32,038,931.00	0.17
158	603260	合盛硅业	382,100	31,691,374.00	0.16
159	601872	招商轮船	5,657,600	31,625,984.00	0.16
160	600918	中泰证券	4,856,200	31,128,242.00	0.16
161	601696	中银证券	2,910,004	30,758,742.28	0.16
162	603486	科沃斯	407,270	29,706,273.80	0.15
163	601865	福莱特	889,700	29,635,907.00	0.15
164	600779	水井坊	348,466	29,417,499.72	0.15
165	601319	中国人保	5,570,400	29,077,488.00	0.15
166	601016	节能风电	6,809,940	25,945,871.40	0.13
167	688303	大全能源	535,752	25,544,655.36	0.13
168	600516	方大炭素	3,985,401	24,390,654.12	0.13
169	600038	中直股份	511,524	23,739,828.84	0.12
170	603026	胜华新材	256,300	23,656,490.00	0.12
171	601456	国联证券	2,081,900	23,421,375.00	0.12
172	600699	均胜电子	1,665,638	23,402,213.90	0.12
173	688363	华熙生物	165,957	22,450,662.96	0.12
174	601966	玲珑轮胎	1,030,924	21,113,323.52	0.11
175	601881	中国银河	2,247,900	20,882,991.00	0.11
176	600025	华能水电	3,140,685	20,728,521.00	0.11
177	688185	康希诺	118,743	17,338,852.86	0.09
178	600906	财达证券	2,260,500	17,111,985.00	0.09
179	600598	北大荒	1,238,400	17,040,384.00	0.09
180	605499	东鹏饮料	75,900	13,502,610.00	0.07

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688332	中科蓝讯	5,870.00	294,732.70	0.00

2	688376	美埃科技	3,713.00	105,783.37	0.00
3	688252	天德钰	5,201.00	82,071.78	0.00
4	688292	浩瀚深度	4,503.00	66,059.01	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688008	澜起科技	96,144,650.75	0.42
2	601728	中国电信	81,936,917.68	0.36
3	601615	明阳智能	77,139,331.97	0.34
4	600887	伊利股份	72,404,501.00	0.32
5	600188	兖矿能源	67,619,120.69	0.30
6	600096	云天化	67,205,594.43	0.29
7	601117	中国化学	65,488,488.79	0.29
8	600795	国电电力	63,983,714.26	0.28
9	600941	中国移动	62,327,297.08	0.27
10	601838	成都银行	57,747,777.31	0.25
11	600085	同仁堂	56,463,361.69	0.25
12	600141	兴发集团	56,214,976.00	0.25
13	600519	贵州茅台	55,900,656.62	0.24
14	688180	君实生物	55,226,814.05	0.24
15	688063	派能科技	54,899,260.09	0.24
16	600487	亨通光电	53,519,188.07	0.23
17	600309	万华化学	52,089,823.00	0.23
18	601233	桐昆股份	50,153,678.99	0.22
19	688005	容百科技	49,635,147.57	0.22
20	603606	东方电缆	48,094,582.24	0.21

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------



				(%)
1	601816	京沪高铁	176,932,210.39	0.77
2	601766	中国中车	117,047,716.55	0.51
3	601229	上海银行	113,926,983.91	0.50
4	600519	贵州茅台	98,604,709.00	0.43
5	601138	工业富联	66,311,954.03	0.29
6	600029	南方航空	57,625,426.15	0.25
7	600886	国投电力	57,225,122.95	0.25
8	601555	东吴证券	50,069,404.80	0.22
9	601901	方正证券	49,980,906.40	0.22
10	600352	浙江龙盛	48,735,926.89	0.21
11	601318	中国平安	44,573,959.14	0.19
12	600036	招商银行	44,131,083.10	0.19
13	600109	国金证券	39,655,873.84	0.17
14	603833	欧派家居	39,009,430.80	0.17
15	688126	沪硅产业	38,491,504.66	0.17
16	600862	中航高科	35,412,608.20	0.15
17	600143	金发科技	34,781,759.73	0.15
18	688036	传音控股	34,028,473.97	0.15
19	600362	江西铜业	33,277,789.07	0.15
20	601990	南京证券	33,189,537.79	0.15

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,895,443,891.28
卖出股票的收入（成交）总额	2,403,892,484.59

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2022 年 8 月 22 日，中国平安因未按照规定进行国际收支统计申报，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2022〕23 号）责令改正、给予警告，并处罚款人民币 30 万元。

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。2022 年 9 月 9 日，招商银行因个人经营贷款挪用至房地产市场等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕48 号）给予罚款 460 万元的行政处罚。2022 年 8 月 31 日，招商银行因违反账户管

理规定、违反清算管理规定等违法违规事项，被中国人民银行（银罚决字〔2022〕1号）给予警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 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。2022 年 9 月 9 日，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕41 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。2022 年 9 月 28 日，兴业银行因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕50 号）给予罚款 450 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	77,141.53
2	应收清算款	1,328,906.70
3	应收股利	11,046.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	326,957.72
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,744,051.95

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601012	隆基绿能	10,987,600.00	0.06	转融通证券出借
2	601888	中国中免	10,801,500.00	0.06	转融通证券出借
3	600309	万华化学	3,706,000.00	0.02	转融通证券出借
4	600887	伊利股份	930,000.00	0.00	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688332	中科蓝讯	294,732.70	0.00	处于锁定期
2	688376	美埃科技	105,783.37	0.00	处于锁定期
3	688252	天德钰	82,071.78	0.00	处于锁定期
4	688292	浩瀚深度	66,059.01	0.00	处于锁定期

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
16,808	333,743.32	5,403,809,179.00	96.33%	205,748,500.00	3.67%

9.2 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	93.26%
2	中国平安人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	58,428,300.00	1.04%
3	三菱日联国际资产管理公司	10,872,414.00	0.19%

	—MAXIS 华安中国股票（上证 180 指数）ETF		
4	全球人寿保险股份有限公司—自有资金	8,248,700.00	0.15%
5	孙晓燕	7,150,000.00	0.13%
6	广发证券股份有限公司	6,569,375.00	0.12%
7	招商证券股份有限公司	6,088,956.00	0.11%
8	中信建投证券股份有限公司	5,439,138.00	0.10%
9	国泰君安证券股份有限公司	4,620,470.00	0.08%
10	上海奇宇建筑工程设计咨询有限公司	4,500,000.00	0.08%
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	44,181,625.00	0.79%

### 9.3 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%

### 9.4 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、基金投资和研究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。

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产
许之彦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

## §10 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	280,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	208,500,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,609,557,679.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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。

2022 年 12 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任职的公告》，任志浩先生新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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 150,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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	4,899,018,051.13	92.73%	4,546,627.57	95.01%	-
招商证券	1	384,002,775.18	7.27%	238,676.56	4.99%	-
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，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

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

**11.8.2 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	31,051,134.57	21.06%	-	-	-	-
招商证券	116,412,801.70	78.94%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

**11.9 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
2	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
3	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
4	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
5	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定媒介	2022-03-15
6	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	2022-03-26



		定媒介	
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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（宝立食品）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-07-09
15	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 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	2022-07-20
16	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（欧 22 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	2022-08-09
17	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-08-30
18	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（嘉华股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-09-03
19	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（哈铁科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-09-29
20	华安基金管理有限公司关于公司股东股权变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-10-12
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会基金电子披	2022-10-12

	关联方承销证券的公告（星环科技）	露网站和公司网站等指定媒介	
22	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	2022-10-17
23	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 3 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	2022-10-25
24	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 22 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	2022-11-24
25	华安基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-08
26	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-27
27	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-27
28	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-12-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20221231	5,231,571,046.00	0.00	0.00	5,231,571,046.00	93.26%
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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；

### 13.2 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>。

### 13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日