

# 华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	53
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	53
<b>10 重大事件揭示</b> .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	57
<b>12 备查文件目录</b> .....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安沪深 300ETF
场内简称	HS300
基金主代码	515390
交易代码	515390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	222,683,016.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 10 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	0755-83077987
负责人	电子邮箱	service@huan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4008850099	95555
传真	021-68863414	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	朱学华	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、 32 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-9,611,691.52
本期利润	6,179,453.34
加权平均基金份额本期利润	0.0290
本期加权平均净值利润率	2.67%
本期基金份额净值增长率	0.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,406,018.19
期末可供分配基金份额利润	0.0512
期末基金资产净值	234,089,034.19
期末基金份额净值	1.0512
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	5.12%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申

购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.11%	0.86%	1.16%	0.87%	0.95%	-0.01%
过去三个月	-4.08%	0.82%	-5.15%	0.83%	1.07%	-0.01%
过去六个月	0.27%	0.84%	-0.75%	0.84%	1.02%	0.00%
过去一年	-12.27%	0.98%	-14.33%	0.99%	2.06%	-0.01%
过去三年	2.90%	1.19%	-7.72%	1.20%	10.62%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.12%	1.22%	-1.25%	1.24%	6.37%	-0.02%

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

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2019 年 12 月 13 日至 2023 年 6 月 30 日）



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资资产管理有限公司、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 2023 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 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	2019-12-	-	19 年	理学博士，19 年证券、基金从业



	<p>经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理</p>	<p>13</p>		<p>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</p>
--	------------------------------	-----------	--	--

					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。
--	--	--	--	--	--

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	58,155,343,687.85	2008-04-25
	私募资产管理计划	2.00	200,333,530.57	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	16.00	58,355,677,218.42	

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 7 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

上半年国内经济呈现复苏态势，GDP 同比增长 5.5%，固定资产投资表现较好，一季度消费修复较快，二季度速度边际放缓。1-6 月工业企业利润同比-16.8%，但盈利降幅连续 4 个月收窄，体现盈利改善的趋势，中游表现好于上游。

上半年 A 股呈现结构性行情，一季度 A 股市场整体震荡上行，外资持续增配，但行业表现分化明显，二季度系经济复苏担忧、企业盈利下行等因素影响大部分行业和板块二季度均录得负收益。上半年沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板 50 指数下跌 9.33%。

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

截止 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0512 元，本报告期份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准增长率为-0.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济的稳步恢复是渐进的，过程中虽有波折但复苏的趋势未变。政策将在政治局会议着力强调的优化调整地产政策、扩大内需、防范和化解债务风险等方面发力。当前市场估值已经隐含较多悲观预期，股权风险溢价上升至一倍标准差左右，会议提出要“活跃资本市场，提振投资者信心”，宏观经济稳健向好有利于提升投资者风险偏好。

下半年随着业绩得到数据印证，市场有望从交易预期向交易基本面转变，我们认为，地产政策的优化调整及债务风险的有序释放将提振投资的信心。在中国特色估值体系的引领下，有望促进央企和国企的价值提升，发挥产业链龙头公司示范引导作用，优化产业布局，长期投资价值值得关注。

沪深 300 指数成分股囊括了各个行业的优质资产，配置价值依然突出。作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	9,585,234.28	16,759,615.33
结算备付金		1,373,527.30	4,837,290.91
存出保证金		1,021,399.62	2,668,328.08
交易性金融资产	6.4.7.2	222,622,935.23	276,850,822.30
其中：股票投资		222,622,935.23	276,850,822.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		234,603,096.43	301,116,056.62
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,234.65	39,280.68
应付托管费		9,411.52	13,093.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	476,416.07	509,447.68
<b>负债合计</b>		<b>514,062.24</b>	<b>561,821.92</b>
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	222,683,016.00	286,683,016.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,406,018.19	13,871,218.70
<b>净资产合计</b>		<b>234,089,034.19</b>	<b>300,554,234.70</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>234,603,096.43</b>	<b>301,116,056.62</b>

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0512 元，基金份额总额 222,683,016.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>6,572,839.59</b>	<b>-85,750,850.97</b>
1.利息收入		47,708.07	111,338.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	47,708.07	111,338.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,609,644.95	-99,007,073.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,137,481.33	-99,247,384.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	11,049.56	414,217.06
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	95,997.83	-4,834,744.63
股利收益	6.4.7.13	2,420,788.99	4,660,838.51
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	15,791,144.86	11,866,240.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	343,631.61	1,278,644.59
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>393,386.25</b>	<b>819,509.87</b>
1. 管理人报酬		173,247.27	472,454.48
2. 托管费		57,749.11	157,484.80
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		1,161.83	0.42
8. 其他费用	6.4.7.16	161,228.04	189,570.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,179,453.34</b>	<b>-86,570,360.84</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,179,453.34</b>	<b>-86,570,360.84</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>6,179,453.34</b>	<b>-86,570,360.84</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	286,683,016.00	-	13,871,218.70	300,554,234.70



资产(基金净值)				
二、本期期初净资产(基金净值)	286,683,016.00	-	13,871,218.70	300,554,234.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,000,000.00	-	-2,465,200.51	-66,465,200.51
(一)、综合收益总额	-	-	6,179,453.34	6,179,453.34
(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)	-64,000,000.00	-	-8,644,653.85	-72,644,653.85
其中: 1.基金申购款	120,000,000.00	-	8,680,878.79	128,680,878.79
2.基金赎回款	-184,000,000.00	-	-17,325,532.64	-201,325,532.64
(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)	222,683,016.00	-	11,406,018.19	234,089,034.19
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,130,683,016.00	-	348,139,153.34	1,478,822,169.34
二、本期期初净资产(基金净值)	1,130,683,016.00	-	348,139,153.34	1,478,822,169.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-556,000,000.00	-	-234,255,005.89	-790,255,005.89
(一)、综合收益总额	-	-	-86,570,360.84	-86,570,360.84
(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)	-556,000,000.00	-	-147,684,645.05	-703,684,645.05
其中: 1.基金申购款	776,000,000.00	-	106,744,050.80	882,744,050.80

2.基金赎回款	-1,332,000,000.00	-	-254,428,695.85	- 1,586,428,695. 85
(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)	574,683,016.00	-	113,884,147.45	688,567,163.4 5

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1823 号《关于准予华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华安沪深 300 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 442,683,016.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0677 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 442,683,016.00 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]309 号文核准同意，本基金 442,683,016.00 份基金份额于 2020 年 1 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为沪深 300 指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟

踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分、可交换债)、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

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，募集成立了华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“华安沪深 300ETF 联接基金”)。华安沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金，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 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	9,585,234.28
等于: 本金	9,584,337.09
加: 应计利息	897.19
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	9,585,234.28

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	239,103,396.24	-	222,622,935.23	-16,480,461.01
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	239,103,396.24	-	222,622,935.23	-16,480,461.01

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	8,084,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,084,460.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2312	IF2312	7.00	8,079,120.00	-5,340.00
合计	-	-	-	-5,340.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-5,340.00
净额	-	-	-	-

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

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	170,897.46
其中：交易所市场	170,897.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
应付替代款	181,258.46
应付指数使用费	35,000.00
合计	476,416.07

注：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。

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	286,683,016.00	286,683,016.00
本期申购	120,000,000.00	120,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-184,000,000.00	-184,000,000.00
本期末	222,683,016.00	222,683,016.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,866,071.39	-30,994,852.69	13,871,218.70

本期利润	-9,611,691.52	15,791,144.86	6,179,453.34
本期基金份额交易产生的变动数	-9,935,424.73	1,290,770.88	-8,644,653.85
其中：基金申购款	14,542,638.50	-5,861,759.71	8,680,878.79
基金赎回款	-24,478,063.23	7,152,530.59	-17,325,532.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,318,955.14	-13,912,936.95	11,406,018.19

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,640.05
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	31,630.90
其他	437.12
合计	47,708.07

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,293,947.43
股票投资收益——赎回差价收入	-4,843,533.90
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	-12,137,481.33

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	99,605,822.97
减：卖出股票成本总额	106,614,139.30
减：交易费用	285,631.10
买卖股票差价收入	-7,293,947.43

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	201,325,532.64
减：现金支付赎回款总额	79,497,231.64
减：赎回股票成本总额	126,671,834.90
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,843,533.90

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	13.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,036.21
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	11,049.56

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	70,452.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,400.00
减：应计利息总额	13.72
减：交易费用	2.81
买卖债券差价收入	11,036.21

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	95,997.83
合计	95,997.83

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,420,788.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,420,788.99

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	15,273,764.86
——股票投资	15,273,764.86
——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	517,380.00
——权证投资	-
——期货投资	517,380.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	15,791,144.86

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	343,631.61
合计	343,631.61

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成

本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	1,967.89
合计	161,228.04

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，收取下限为每季度人民币 3.5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	173,247.27	472,454.48
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,749.11	157,484.80

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	7,401,374.00	3.32%	12,570,179.00	4.38%
招商银行股份有限公司—华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	83,209,300.00	37.37%	66,039,300.00	23.04%

#### 6.4.10.5 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	
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	9,585,234.28	15,640.05	32,096,197.15	49,541.64

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	127085	韵达转债	老股东配售	134.00	13,400.00
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508.00	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581.00	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499.00	30,873.13
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	3,380.00	281,229.35
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	301263	泰恩康	网下申购	6,813.00	135,783.09
国泰君安证券股份有限公司	113057	中银转债	老股东配售	410.00	41,000.00
国泰君安证券股份有限公司	113059	福莱转债	老股东配售	310.00	31,000.00

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

无。

### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6 个月（含）	新股限售	33.73	31.85	242.00	8,162.66	7,707.70	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6 个月（含）	新股限售	26.80	22.32	344.00	9,219.20	7,678.08	-

#### 6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货及权证投资等。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。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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



式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而

发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,585,234.28	-	-	-	9,585,234.28
结算备付金	1,373,527.30	-	-	-	1,373,527.30
存出保证金	1,021,399.62	-	-	-	1,021,399.62
交易性金融资产	-	-	-	222,622,935.23	222,622,935.23
应收清算款	-	-	-	-	-
资产总计	11,980,161.20	-	-	222,622,935.23	234,603,096.43
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	-	-	-	28,234.65	28,234.65
应付托管费	-	-	-	9,411.52	9,411.52

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	476,416.07	476,416.07
负债总计	-	-	-	514,062.24	514,062.24
利率敏感度缺口	11,980,161.20	-	-	222,108,872.99	234,089,034.19
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,759,615.33	-	-	-	16,759,615.33
结算备付金	4,837,290.91	-	-	-	4,837,290.91
存出保证金	2,668,328.08	-	-	-	2,668,328.08
交易性金融资产	-	-	-	276,850,822.30	276,850,822.30
应收清算款	-	-	-	-	-
资产总计	24,265,234.32	-	-	276,850,822.30	301,116,056.62
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	-	-	-	39,280.68	39,280.68
应付托管费	-	-	-	13,093.56	13,093.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,447.68	509,447.68
负债总计	-	-	-	561,821.92	561,821.92
利率敏感度缺口	24,265,234.32	-	-	276,289,000.38	300,554,234.70

					0
--	--	--	--	--	---

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2023 年 6 月 30 日		2022 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	222,622,935.23	95.10	276,850,822.30	92.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	222,622,935.23	95.10	276,850,822.30	92.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	11,590,000.00	14,880,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-11,590,000.00	-14,880,000.00

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	222,607,549.45	276,241,976.77
第二层次	-	-
第三层次	15,385.78	608,845.53
合计	222,622,935.23	276,850,822.30

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	222,622,935.23	94.89
	其中：股票	222,622,935.23	94.89
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	10,958,761.58	4.67
8	其他各项资产	1,021,399.62	0.44
9	合计	234,603,096.43	100.00

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 0.00 元。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,492,356.45	1.06
B	采矿业	8,671,310.00	3.70
C	制造业	125,845,455.12	53.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,645,462.00	2.84
E	建筑业	5,275,075.30	2.25
F	批发和零售业	738,041.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	6,932,763.90	2.96
H	住宿和餐饮业	228,636.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,120,375.23	4.75
J	金融业	45,258,921.21	19.33
K	房地产业	3,335,212.14	1.42

L	租赁和商务服务业	2,081,485.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	2,166,974.20	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,511,012.90	0.65
R	文化、体育和娱乐业	304,469.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	222,607,549.45	95.10

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,385.78	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-



R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,385.78	0.01

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,300	12,344,300.00	5.27
2	300750	宁德时代	31,071	7,108,734.09	3.04
3	601318	中国平安	127,598	5,920,547.20	2.53
4	600036	招商银行	137,728	4,511,969.28	1.93
5	000858	五粮液	22,800	3,729,396.00	1.59
6	000333	美的集团	57,877	3,410,112.84	1.46
7	002594	比亚迪	10,700	2,763,489.00	1.18
8	601166	兴业银行	171,200	2,679,280.00	1.14
9	600900	长江电力	115,300	2,543,518.00	1.09
10	600276	恒瑞医药	52,650	2,521,935.00	1.08
11	600030	中信证券	112,850	2,232,173.00	0.95
12	601899	紫金矿业	193,900	2,204,643.00	0.94
13	600887	伊利股份	75,000	2,124,000.00	0.91
14	300059	东方财富	149,402	2,121,508.40	0.91
15	601012	隆基绿能	71,372	2,046,235.24	0.87
16	601398	工商银行	412,900	1,990,178.00	0.85
17	600309	万华化学	22,186	1,948,818.24	0.83
18	000651	格力电器	53,100	1,938,681.00	0.83
19	002475	立讯精密	58,759	1,906,729.55	0.81
20	601328	交通银行	323,600	1,876,880.00	0.80
21	000568	泸州老窖	8,742	1,832,060.94	0.78
22	002415	海康威视	55,100	1,824,361.00	0.78
23	000725	京东方 A	441,600	1,806,144.00	0.77
24	300760	迈瑞医疗	5,700	1,708,860.00	0.73
25	000063	中兴通讯	37,500	1,707,750.00	0.73
26	601816	京沪高铁	289,100	1,520,666.00	0.65
27	603259	药明康德	24,220	1,509,148.20	0.64
28	002230	科大讯飞	21,900	1,488,324.00	0.64
29	600028	中国石化	224,000	1,424,640.00	0.61
30	300274	阳光电源	12,200	1,422,886.00	0.61

31	601668	中国建筑	246,900	1,417,206.00	0.61
32	300124	汇川技术	21,900	1,406,199.00	0.60
33	002714	牧原股份	32,216	1,357,904.40	0.58
34	601288	农业银行	376,100	1,327,633.00	0.57
35	002352	顺丰控股	28,750	1,296,337.50	0.55
36	000001	平安银行	114,200	1,282,466.00	0.55
37	601888	中国中免	11,500	1,271,095.00	0.54
38	002129	TCL 中环	37,975	1,260,770.00	0.54
39	300015	爱尔眼科	67,358	1,249,490.90	0.53
40	000792	盐湖股份	64,000	1,226,880.00	0.52
41	601088	中国神华	38,780	1,192,485.00	0.51
42	002142	宁波银行	46,760	1,183,028.00	0.51
43	601138	工业富联	46,800	1,179,360.00	0.50
44	688981	中芯国际	23,037	1,163,829.24	0.50
45	600031	三一重工	69,900	1,162,437.00	0.50
46	300498	温氏股份	61,823	1,134,452.05	0.48
47	000002	万 科 A	80,157	1,123,801.14	0.48
48	600048	保利发展	84,600	1,102,338.00	0.47
49	600016	民生银行	292,400	1,096,500.00	0.47
50	600406	国电南瑞	47,251	1,091,498.10	0.47
51	600438	通威股份	31,800	1,091,058.00	0.47
52	600050	中国联通	224,700	1,078,560.00	0.46
53	600809	山西汾酒	5,700	1,054,899.00	0.45
54	601601	中国太保	40,400	1,049,592.00	0.45
55	600837	海通证券	113,600	1,047,392.00	0.45
56	600690	海尔智家	44,500	1,044,860.00	0.45
57	600436	片仔癀	3,600	1,030,896.00	0.44
58	601728	中国电信	182,900	1,029,727.00	0.44
59	600089	特变电工	45,900	1,023,111.00	0.44
60	600919	江苏银行	139,140	1,022,679.00	0.44
61	002371	北方华创	3,200	1,016,480.00	0.43
62	600000	浦发银行	138,305	1,001,328.20	0.43
63	601857	中国石油	133,500	997,245.00	0.43
64	600941	中国移动	10,600	988,980.00	0.42
65	688111	金山办公	2,091	987,412.02	0.42
66	601988	中国银行	248,300	970,853.00	0.41
67	603501	韦尔股份	9,838	964,517.52	0.41
68	601766	中国中车	143,300	931,450.00	0.40
69	603288	海天味业	19,692	922,570.20	0.39
70	002304	洋河股份	7,000	919,450.00	0.39
71	601390	中国中铁	121,000	917,180.00	0.39
72	600905	三峡能源	168,600	905,382.00	0.39
73	300014	亿纬锂能	14,500	877,250.00	0.37
74	600150	中国船舶	26,300	865,533.00	0.37

75	000938	紫光股份	26,940	858,039.00	0.37
76	002466	天齐锂业	12,100	845,911.00	0.36
77	688012	中微公司	5,363	839,041.35	0.36
78	601688	华泰证券	60,600	834,462.00	0.36
79	601225	陕西煤业	45,800	833,102.00	0.36
80	603986	兆易创新	7,744	822,800.00	0.35
81	002460	赣锋锂业	13,400	816,864.00	0.35
82	002459	晶澳科技	19,501	813,191.70	0.35
83	002027	分众传媒	119,000	810,390.00	0.35
84	601169	北京银行	174,400	807,472.00	0.34
85	000338	潍柴动力	63,900	796,194.00	0.34
86	600570	恒生电子	17,861	791,063.69	0.34
87	601985	中国核电	111,100	783,255.00	0.33
88	600104	上汽集团	55,000	779,350.00	0.33
89	002050	三花智控	25,420	769,209.20	0.33
90	000625	长安汽车	58,490	756,275.70	0.32
91	002049	紫光国微	8,080	753,460.00	0.32
92	601211	国泰君安	53,100	742,869.00	0.32
93	600111	北方稀土	29,900	717,002.00	0.31
94	603019	中科曙光	13,880	706,492.00	0.30
95	601919	中远海控	75,052	705,488.80	0.30
96	000100	TCL 科技	176,890	696,946.60	0.30
97	603799	华友钴业	15,140	695,077.40	0.30
98	601628	中国人寿	19,700	688,712.00	0.29
99	600660	福耀玻璃	19,000	681,150.00	0.29
100	002179	中航光电	15,018	681,066.30	0.29
101	601229	上海银行	117,100	673,325.00	0.29
102	601818	光大银行	218,600	671,102.00	0.29
103	600585	海螺水泥	28,200	669,468.00	0.29
104	600009	上海机场	14,700	667,674.00	0.29
105	600893	航发动力	15,700	663,482.00	0.28
106	601989	中国重工	134,200	646,844.00	0.28
107	002271	东方雨虹	23,600	643,336.00	0.27
108	601658	邮储银行	130,900	640,101.00	0.27
109	002555	三七互娱	18,200	634,816.00	0.27
110	300122	智飞生物	14,250	629,850.00	0.27
111	688036	传音控股	4,169	612,843.00	0.26
112	002812	恩捷股份	6,300	607,005.00	0.26
113	600958	东方证券	61,700	598,490.00	0.26
114	600019	宝钢股份	104,900	589,538.00	0.25
115	000977	浪潮信息	12,100	586,850.00	0.25
116	600760	中航沈飞	12,943	582,435.00	0.25
117	002709	天赐材料	13,700	564,303.00	0.24
118	600999	招商证券	41,290	560,305.30	0.24

119	688599	天合光能	12,844	547,282.84	0.23
120	688008	澜起科技	9,451	542,676.42	0.23
121	300316	晶盛机电	7,600	538,840.00	0.23
122	300896	爱美客	1,200	533,940.00	0.23
123	601186	中国铁建	54,200	533,870.00	0.23
124	600426	华鲁恒升	17,400	532,962.00	0.23
125	000661	长春高新	3,900	531,570.00	0.23
126	601360	三六零	42,100	527,934.00	0.23
127	600584	长电科技	16,700	520,539.00	0.22
128	601006	大秦铁路	70,000	520,100.00	0.22
129	000596	古井贡酒	2,100	519,498.00	0.22
130	002920	德赛西威	3,300	514,173.00	0.22
131	000776	广发证券	34,900	513,379.00	0.22
132	601600	中国铝业	93,500	513,315.00	0.22
133	002410	广联达	15,680	509,443.20	0.22
134	600845	宝信软件	9,919	503,984.39	0.22
135	600745	闻泰科技	10,283	502,838.70	0.21
136	300142	沃森生物	19,000	502,550.00	0.21
137	600547	山东黄金	21,300	500,124.00	0.21
138	600588	用友网络	24,380	499,790.00	0.21
139	002241	歌尔股份	28,100	498,775.00	0.21
140	601377	兴业证券	81,290	497,494.80	0.21
141	601939	建设银行	79,100	495,166.00	0.21
142	000166	申万宏源	106,200	490,644.00	0.21
143	601009	南京银行	60,800	486,400.00	0.21
144	600011	华能国际	51,900	480,594.00	0.21
145	600010	包钢股份	267,300	478,467.00	0.20
146	001979	招商蛇口	36,500	475,595.00	0.20
147	600085	同仁堂	8,200	471,992.00	0.20
148	601669	中国电建	81,100	465,514.00	0.20
149	300450	先导智能	12,860	465,146.20	0.20
150	300408	三环集团	15,800	463,730.00	0.20
151	600196	复星医药	15,000	463,500.00	0.20
152	002311	海大集团	9,839	460,858.76	0.20
153	300033	同花顺	2,600	455,728.00	0.19
154	601800	中国交建	41,500	452,765.00	0.19
155	603659	璞泰来	11,785	450,422.70	0.19
156	000538	云南白药	8,580	450,278.40	0.19
157	000963	华东医药	10,300	446,711.00	0.19
158	600886	国投电力	35,200	445,280.00	0.19
159	603993	洛阳钼业	83,300	443,989.00	0.19
160	000768	中航西飞	16,400	438,700.00	0.19
161	600600	青岛啤酒	4,200	435,246.00	0.19
162	300782	卓胜微	4,420	427,104.60	0.18

163	601689	拓普集团	5,200	419,640.00	0.18
164	002493	荣盛石化	35,850	417,294.00	0.18
165	002252	上海莱士	55,500	416,805.00	0.18
166	000733	振华科技	4,300	412,155.00	0.18
167	600926	杭州银行	35,000	411,250.00	0.18
168	600015	华夏银行	75,000	405,750.00	0.17
169	601100	恒立液压	6,304	405,536.32	0.17
170	600795	国电电力	105,100	402,533.00	0.17
171	600176	中国巨石	28,220	399,595.20	0.17
172	002180	纳思达	11,600	397,300.00	0.17
173	600674	川投能源	26,300	395,815.00	0.17
174	000157	中联重科	58,500	394,875.00	0.17
175	300347	泰格医药	6,100	393,694.00	0.17
176	600732	爱旭股份	12,780	392,985.00	0.17
177	002236	大华股份	19,700	389,075.00	0.17
178	603369	今世缘	7,300	385,440.00	0.16
179	600115	中国东航	80,600	383,656.00	0.16
180	600029	南方航空	63,500	382,905.00	0.16
181	000425	徐工机械	55,710	377,156.70	0.16
182	000301	东方盛虹	31,200	368,784.00	0.16
183	601633	长城汽车	14,601	367,507.17	0.16
184	300496	中科创达	3,800	366,130.00	0.16
185	601995	中金公司	10,300	365,856.00	0.16
186	601066	中信建投	15,046	364,113.20	0.16
187	601336	新华保险	9,900	364,023.00	0.16
188	601788	光大证券	22,900	363,881.00	0.16
189	601117	中国化学	43,200	357,696.00	0.15
190	601868	中国能建	152,800	357,552.00	0.15
191	600346	恒力石化	24,900	356,817.00	0.15
192	601877	正泰电器	12,600	348,390.00	0.15
193	002074	国轩高科	12,500	345,250.00	0.15
194	002202	金风科技	32,462	344,746.44	0.15
195	002821	凯莱英	2,900	341,794.00	0.15
196	688396	华润微	6,519	341,660.79	0.15
197	600741	华域汽车	18,500	341,510.00	0.15
198	300454	深信服	3,000	339,750.00	0.15
199	601111	中国国航	41,200	339,488.00	0.15
200	002001	新和成	21,856	336,582.40	0.14
201	688126	沪硅产业	16,079	336,051.10	0.14
202	002841	视源股份	5,000	334,200.00	0.14
203	601618	中国中冶	84,100	333,877.00	0.14
204	688223	晶科能源	23,500	330,410.00	0.14
205	603806	福斯特	8,884	330,395.96	0.14
206	600989	宝丰能源	25,900	326,599.00	0.14

207	600188	兖矿能源	10,800	323,136.00	0.14
208	601838	成都银行	26,435	322,771.35	0.14
209	300661	圣邦股份	3,875	318,253.75	0.14
210	601615	明阳智能	18,800	317,344.00	0.14
211	601901	方正证券	48,500	317,190.00	0.14
212	000876	新希望	26,700	311,856.00	0.13
213	688303	大全能源	7,700	311,465.00	0.13
214	300413	芒果超媒	8,900	304,469.00	0.13
215	600039	四川路桥	30,880	302,932.80	0.13
216	600460	士兰微	10,000	302,700.00	0.13
217	300769	德方纳米	2,740	302,030.20	0.13
218	603392	万泰生物	4,483	299,329.91	0.13
219	605117	德业股份	2,000	299,100.00	0.13
220	000895	双汇发展	12,162	297,847.38	0.13
221	002648	卫星化学	19,860	297,105.60	0.13
222	002736	国信证券	33,900	295,947.00	0.13
223	600233	圆通速递	20,300	295,568.00	0.13
224	603260	合盛硅业	4,200	294,084.00	0.13
225	000786	北新建材	11,900	291,669.00	0.12
226	601607	上海医药	13,000	291,330.00	0.12
227	003816	中国广核	92,700	288,297.00	0.12
228	002007	华兰生物	12,764	286,041.24	0.12
229	300207	欣旺达	17,500	285,600.00	0.12
230	300999	金龙鱼	7,000	279,930.00	0.12
231	002601	龙佰集团	16,800	277,200.00	0.12
232	300433	蓝思科技	23,400	275,184.00	0.12
233	601238	广汽集团	26,100	271,962.00	0.12
234	600383	金地集团	37,200	268,212.00	0.11
235	600332	白云山	8,400	267,792.00	0.11
236	600132	重庆啤酒	2,900	267,264.00	0.11
237	601021	春秋航空	4,600	264,362.00	0.11
238	300759	康龙化成	6,900	264,132.00	0.11
239	600763	通策医疗	2,700	261,522.00	0.11
240	300751	迈为股份	1,540	260,845.20	0.11
241	300223	北京君正	2,900	256,099.00	0.11
242	600219	南山铝业	82,800	250,056.00	0.11
243	300763	锦浪科技	2,400	249,840.00	0.11
244	000983	山西焦煤	26,700	242,970.00	0.10
245	600875	东方电气	13,000	242,450.00	0.10
246	002756	永兴材料	3,830	239,796.30	0.10
247	601699	潞安环能	14,200	231,744.00	0.10
248	600362	江西铜业	12,200	231,556.00	0.10
249	601865	福莱特	6,000	231,060.00	0.10
250	000723	美锦能源	30,600	230,724.00	0.10

251	600754	锦江酒店	5,400	228,636.00	0.10
252	600918	中泰证券	32,800	226,648.00	0.10
253	601878	浙商证券	22,800	225,264.00	0.10
254	601799	星宇股份	1,800	222,480.00	0.10
255	601872	招商轮船	38,200	221,178.00	0.09
256	601319	中国人保	37,600	219,584.00	0.09
257	603833	欧派家居	2,280	218,424.00	0.09
258	603486	科沃斯	2,800	217,756.00	0.09
259	000617	中油资本	29,900	216,177.00	0.09
260	688005	容百科技	4,000	216,080.00	0.09
261	601998	中信银行	36,100	215,878.00	0.09
262	600061	国投资本	30,304	215,764.48	0.09
263	603290	斯达半导	1,000	215,200.00	0.09
264	000069	华侨城 A	48,300	212,520.00	0.09
265	000408	藏格矿业	9,400	212,158.00	0.09
266	300628	亿联网络	5,910	207,263.70	0.09
267	600803	新奥股份	10,900	206,882.00	0.09
268	600884	杉杉股份	13,500	204,390.00	0.09
269	002938	鹏鼎控股	8,300	201,607.00	0.09
270	600183	生益科技	13,900	197,380.00	0.08
271	300601	康泰生物	7,760	197,026.40	0.08
272	603899	晨光股份	4,400	196,416.00	0.08
273	300919	中伟股份	3,200	192,800.00	0.08
274	688363	华熙生物	2,157	192,318.12	0.08
275	002916	深南电路	2,509	189,103.33	0.08
276	000708	中信特钢	11,800	186,912.00	0.08
277	603185	弘元绿能	2,500	186,375.00	0.08
278	688561	奇安信	3,543	183,562.83	0.08
279	601898	中煤能源	21,500	181,460.00	0.08
280	601881	中国银河	15,200	176,472.00	0.08
281	600018	上港集团	32,900	172,725.00	0.07
282	603195	公牛集团	1,732	166,375.92	0.07
283	000877	天山股份	20,400	166,056.00	0.07
284	601216	君正集团	39,700	162,770.00	0.07
285	002120	韵达股份	17,010	162,615.60	0.07
286	002064	华峰化学	23,300	159,838.00	0.07
287	002414	高德红外	20,098	156,161.46	0.07
288	601155	新城控股	10,600	152,746.00	0.07
289	600025	华能水电	21,200	151,156.00	0.06
290	300957	贝泰妮	1,600	142,208.00	0.06
291	600606	绿地控股	49,630	136,482.50	0.06
292	688187	时代电气	3,000	125,580.00	0.05
293	688065	凯赛生物	1,980	123,274.80	0.05
294	601698	中国卫通	5,000	99,400.00	0.04

295	601808	中海油服	6,900	95,772.00	0.04
296	300979	华利集团	1,900	92,606.00	0.04
297	000800	一汽解放	10,900	91,233.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	500	86,450.00	0.04
299	601236	红塔证券	11,100	82,695.00	0.04
300	001289	龙源电力	1,900	42,750.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	301373	凌玮科技	242.00	7,707.70	0.00
2	301303	真兰仪表	344.00	7,678.08	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,146,225.00	1.38
2	000858	五粮液	2,505,043.00	0.83
3	000333	美的集团	2,016,243.00	0.67
4	000568	泸州老窖	1,721,381.00	0.57
5	002594	比亚迪	1,707,479.00	0.57
6	300059	东方财富	1,590,342.96	0.53
7	002415	海康威视	1,409,995.00	0.47
8	000596	古井贡酒	1,291,726.00	0.43
9	000651	格力电器	1,247,640.00	0.42
10	002371	北方华创	1,177,809.00	0.39
11	000725	京东方 A	1,166,678.00	0.39
12	002475	立讯精密	1,076,606.00	0.36
13	002352	顺丰控股	1,014,686.00	0.34
14	300760	迈瑞医疗	1,014,502.00	0.34
15	300015	爱尔眼科	1,014,156.00	0.34
16	300769	德方纳米	990,964.00	0.33
17	002714	牧原股份	949,720.00	0.32
18	000001	平安银行	930,516.00	0.31
19	600519	贵州茅台	885,041.00	0.29
20	300124	汇川技术	880,412.00	0.29

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



用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	6,241,102.00	2.08
2	000858	五粮液	3,770,149.00	1.25
3	000333	美的集团	2,813,070.00	0.94
4	002594	比亚迪	2,488,419.00	0.83
5	300059	东方财富	2,349,199.00	0.78
6	000568	泸州老窖	2,234,457.00	0.74
7	002415	海康威视	1,913,823.00	0.64
8	000651	格力电器	1,694,113.00	0.56
9	600519	贵州茅台	1,623,282.00	0.54
10	000725	京东方 A	1,596,545.00	0.53
11	002475	立讯精密	1,552,044.00	0.52
12	300760	迈瑞医疗	1,520,256.00	0.51
13	002352	顺丰控股	1,488,231.00	0.50
14	000001	平安银行	1,399,147.00	0.47
15	000596	古井贡酒	1,396,448.00	0.46
16	002714	牧原股份	1,319,630.00	0.44
17	002371	北方华创	1,311,653.00	0.44
18	000792	盐湖股份	1,308,447.00	0.44
19	300124	汇川技术	1,284,873.06	0.43
20	002142	宁波银行	1,272,013.00	0.42

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	86,105,223.27
卖出股票的收入（成交）总额	99,605,822.97

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

2022 年 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 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 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。

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,021,399.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,021,399.62

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301373	凌玮科技	7,707.70	0.00	处于锁定期
2	301303	真兰仪表	7,678.08	0.00	处于锁定期

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2,134	104,350.05	165,004,036.00	74.10%	57,678,980.00	25.90%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	12,582,500.00	5.65%
2	中国国际金融股份有限公司	12,010,279.00	5.39%
3	北京泰铼投资管理有限公司—泰铼信铼 8 号私募证券投资基金	9,054,600.00	4.07%
4	中国中金财富证券有限公司转融通担保证券明细账户	8,752,100.00	3.93%
5	广发证券股份有限公司	8,013,306.00	3.60%
6	国泰君安证券股份有限公司	7,401,295.00	3.32%
7	戚威	6,692,500.00	3.01%
8	招商证券股份有限公司	6,538,638.00	2.94%

9	方正证券股份有限公司	5,470,119.00	2.46%
10	中信证券股份有限公司	3,392,309.00	1.52%
11	招商银行股份有限公司— 华安沪深 300 交易型开放 式指数证券投资基金发起 式联接基金	83,209,300.00	37.37%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 12 月 13 日）基金份额总额	442,683,016.00
本报告期期初基金份额总额	286,683,016.00
本报告期基金总申购份额	120,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	184,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	222,683,016.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	71,896,372.64	38.82%	66,238.51	38.76%	-
浙商证券	1	67,346,501.28	36.37%	62,046.63	36.31%	-
广发证券	1	28,433,962.07	15.35%	26,481.77	15.50%	-
民生证券	1	17,252,722.87	9.32%	15,895.05	9.30%	-
中信证券	3	152,382.07	0.08%	141.99	0.08%	-
信达证券	1	101,471.96	0.05%	93.51	0.05%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证券	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:

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的国泰君安深交所 016401 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的国泰君安深交所 016402 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的野村东方上交所 56969 交易单元

2023 年 1 月完成租用托管在招商银行的华创证券上交所 47797 交易单元

2023 年 3 月完成退租托管在招商银行的国泰君安深交所 016402 交易单元

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	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
方正证券	17,118.50	13.18%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	46,000.00	35.42%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	66,734.24	51.39%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-01-20
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（亿道信息）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-03
3	华安基金管理有限公司关于华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-24
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（宿迁联盛）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-15
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金变更扩位证券简称的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-22
6	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-23
7	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-03-30



		定媒介	
8	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（韵达转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-14
9	华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023-04-21
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-06-01

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20230630	66,039,300.00	21,250,000.00	4,080,000.00	83,209,300.00	37.37%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日