

华安 CES 港股通精选 100 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44

8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安 CES 港股通精选 100ETF
场内简称	港股 100
基金主代码	513900
交易代码	513900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	203,978,000.00 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	2018 年 5 月 25 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	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。
业绩比较基准	中华交易服务港股通精选 100 指数收益率（经汇率调整）
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	秦一楠
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	service@huanan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816

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	北京市东城区建国门内大街69 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	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	-5,445,458.92
本期利润	-3,767,681.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0193
本期加权平均净值利润率	-2.27%
本期基金份额净值增长率	-2.95%
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	-53,121,755.78
期末可供分配基金份额利润	-0.2604
期末基金资产净值	170,563,082.80
期末基金份额净值	0.8362
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	-16.38%

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：封闭式基金交易佣金、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）。

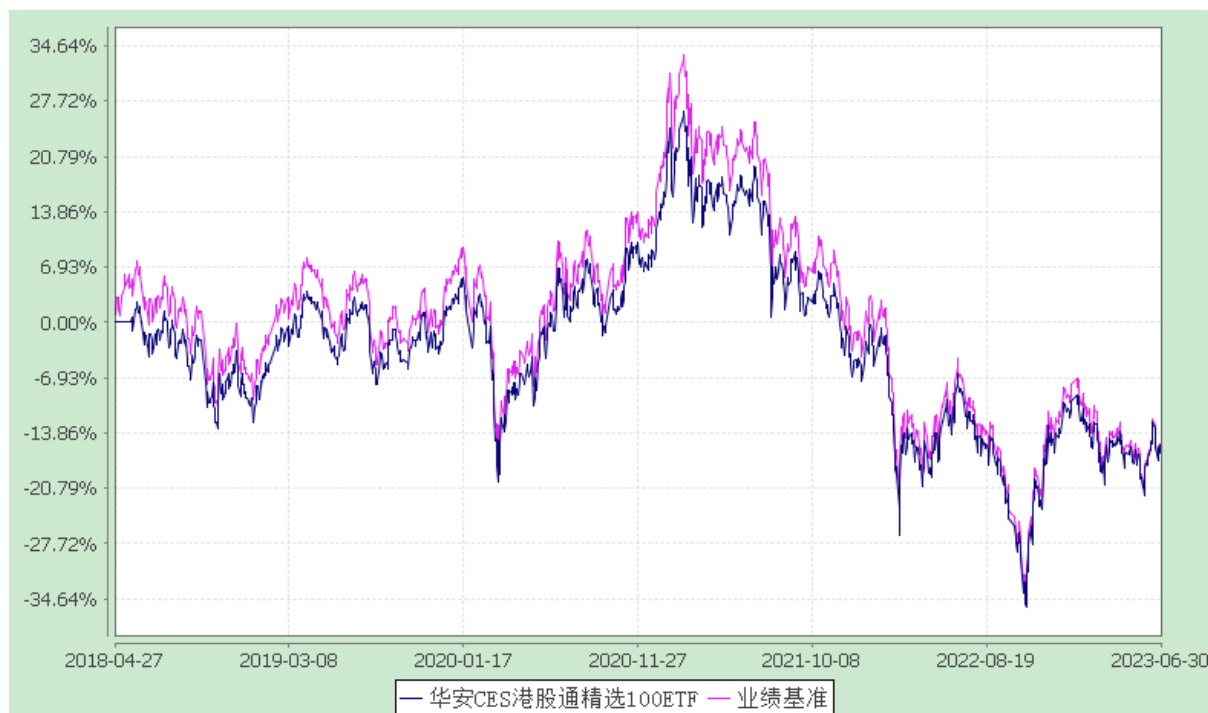
3.2 基金净值表现

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	6.90%	1.41%	6.84%	1.45%	0.06%	-0.04%
过去三个月	-1.61%	1.21%	-2.48%	1.24%	0.87%	-0.03%
过去六个月	-2.95%	1.29%	-4.87%	1.35%	1.92%	-0.06%
过去一年	-8.74%	1.63%	-10.30%	1.68%	1.56%	-0.05%
过去三年	-15.65%	1.55%	-17.62%	1.61%	1.97%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-16.38%	1.45%	-16.15%	1.51%	-0.23%	-0.06%

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 CES 港股通精选 100 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
 （2018 年 4 月 27 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		
倪斌	本基金的基金	2018-09-	-	12 年	硕士研究生，12 年基金行业从业

	<p>经理、指数与 量化投资部助 理总监</p>	<p>10</p>		<p>经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金（2022 年 12 月起，转型为华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII））、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安 CES 港股通精选 100 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。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月起，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月起，同时担任华安中证新能源汽车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 4 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式</p>
--	----------------------------------	-----------	--	---

					联接基金（QDII）的基金经理。 2022 年 7 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。 2023 年 1 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，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，港股一度延续去年的强势，但春节后出现明显回调，主要受到了国内经济复苏不及预期，部分金融、经济环比数据有所走弱的影响，海外方面，欧美高通胀持续，美联储货币政策基调仍较为鹰派，加息预期持续上修，美元指数和美债收益率上涨，叠加美国债务上限问题、欧美银行业流动性危机以及外部地缘关系变化等因素，均对港股产生一定扰动。多重因素叠加，港股市场风险偏好有所下行，走势震荡下行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8362 元，本报告期份额净值增长率为-2.95%，同期业绩比较基准增长率为-4.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着国内相关政策效应的持续释放，中国经济的增长复苏动能有望在进一步增强，而海外随着美联储加息接近尾声，外部流动性收紧的担忧预计将有所缓和，人民币汇率也有望企稳。港股的基本面、资金面以及风险偏好都有望迎来边际改善。但同时也应密切关注海外市场不确定因素，或许仍将对港股产生一定扰动。本基金跟踪不含 A+H 的纯港股投资标的，我们认为，港股经前期大幅回调后，估值优势显著，具备中长期配置价值。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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 CES 港股通精选 100 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
资产：		-	-

银行存款	6.4.7.1	4,294,122.74	6,562,884.85
结算备付金		4,611,774.43	193.03
存出保证金		14,260.64	-
交易性金融资产	6.4.7.2	165,618,438.54	176,674,238.83
其中：股票投资		165,618,438.54	176,674,238.83
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		634,834.80	28,543.09
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		175,173,431.15	183,265,859.80
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
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		37.47	339.92
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		85,508.01	98,713.41
应付托管费		14,251.35	16,452.23
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	4,510,551.52	2,241,964.23
负债合计		4,610,348.35	2,357,469.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	203,978,000.00	209,978,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-33,414,917.20	-29,069,609.99
净资产合计		170,563,082.80	180,908,390.01
负债和净资产总计		175,173,431.15	183,265,859.80

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8362 元，基金份额总额 203,978,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安 CES 港股通精选 100 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
一、营业总收入		-2,990,389.02	-14,322,421.96
1.利息收入		29,330.38	47,257.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	29,330.38	47,257.37
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）		-4,955,107.75	-19,604,680.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-7,089,693.90	-22,107,608.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,134,586.15	2,502,927.48
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,677,776.94	5,129,768.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	257,611.41	105,232.68
减：二、营业总支出		777,292.96	920,049.58
1. 管理人报酬		496,980.22	617,724.36
2. 托管费		82,830.12	102,954.07
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	197,482.62	199,371.15

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,767,681.98	-15,242,471.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,767,681.98	-15,242,471.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,767,681.98	-15,242,471.54

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安 CES 港股通精选 100 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、上期期末净资产（基金净值）	209,978,000.00	-	-29,069,609.99	180,908,390.01
二、本期期初净资产（基金净值）	209,978,000.00	-	-29,069,609.99	180,908,390.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	-4,345,307.21	-10,345,307.21
（一）、综合收益总额	-	-	-3,767,681.98	-3,767,681.98
（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）	-6,000,000.00	-	-577,625.23	-6,577,625.23
其中：1.基金申购款	61,000,000.00	-	-9,414,983.36	51,585,016.64
2.基金赎回款	-67,000,000.00	-	8,837,358.13	-58,162,641.87
（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）	203,978,000.00	-	-33,414,917.20	170,563,082.80
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)	205,978,000.00	-	-9,203,516.87	196,774,483.13
二、本期期初净资产(基金净值)	205,978,000.00	-	-9,203,516.87	196,774,483.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-7,781,922.14	-10,781,922.14
(一)、综合收益总额	-	-	-15,242,471.54	-15,242,471.54
(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)	-3,000,000.00	-	7,460,549.40	4,460,549.40
其中：1.基金申购款	79,000,000.00	-	-5,652,092.71	73,347,907.29
2.基金赎回款	-82,000,000.00	-	13,112,642.11	-68,887,357.89
(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)	202,978,000.00	-	-16,985,439.01	185,992,560.99

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 CES 港股通精选 100 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[2018]第 369 号《关于准予华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》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 CES 港股通精选 100 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

人民币 284,978,000.00 元，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(2018)第 0289 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 284,978,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]62 号文审核同意，本基金 284,978,000.00 份基金份额于 2018 年 5 月 25 日在上交所挂牌交易。本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 CES 港股通精选 100 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中华交易服务港股通精选 100 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；本基金的主要投资范围为标的指数成分股(含存托凭证)、备选成分股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成分股(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行的股票、存托凭证)、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证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。本基金投资于标的指数成分股和备选成分股的比例不低于基金资产的 90%。本基金的业绩比较基准为：中华交易服务港股通精选 100 指数收益率(经汇率调整)。

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 2018 年 5 月 30 日募集成立了华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华安 CES 港股通精选 100ETF 联接”)。华安 CES 港股通精选 100ETF 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 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 CES 港股通精选 100 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 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

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

6.4.5 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	4,294,122.74
等于：本金	4,293,393.93
加：应计利息	728.81
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	4,294,122.74

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	188,483,830.37	-	165,618,438.54	-22,865,391.83
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	188,483,830.37	-	165,618,438.54	-22,865,391.83
----	----------------	---	----------------	----------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

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	91,065.71
其中：交易所市场	91,065.71
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	4,230,225.66
应付指数使用费	100,000.00
合计	4,510,551.52

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	209,978,000.00	209,978,000.00

本期申购	61,000,000.00	61,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-67,000,000.00	-67,000,000.00
本期末	203,978,000.00	203,978,000.00

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-49,086,144.50	20,016,534.51	-29,069,609.99
本期利润	-5,445,458.92	1,677,776.94	-3,767,681.98
本期基金份额交易产生的变动数	1,409,847.64	-1,987,472.87	-577,625.23
其中：基金申购款	-15,346,774.97	5,931,791.61	-9,414,983.36
基金赎回款	16,756,622.61	-7,919,264.48	8,837,358.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-53,121,755.78	19,706,838.58	-33,414,917.20

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	19,030.54
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	10,155.91
其他	143.93
合计	29,330.38

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	-7,089,693.90
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-7,089,693.90

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	68,011,106.45
减：卖出股票成本总额	74,816,548.54
减：交易费用	284,251.81
买卖股票差价收入	-7,089,693.90

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	58,162,641.87
减：现金支付赎回款总额	58,162,641.87
减：赎回股票成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.11 债券投资收益

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 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	2,134,586.15
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	2,134,586.15

6.4.7.16 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	1,677,776.94
——股票投资	1,677,776.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,677,776.94

6.4.7.17 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	257,611.41
合计	257,611.41

6.4.7.18 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	100,000.00
证券组合费	6,482.46
银行汇划费	1,360.01
其他费用	380.00
合计	197,482.62

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
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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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 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	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
当期发生的基金应支付的管理费	496,980.22	617,724.36
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	82,830.12	102,954.07

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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
中国农业银行股份 有限公司—华 安 CES 港股通精	33,747,600.00	16.54%	37,628,700.00	17.92%

选 100 交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金				
----------------------------------	--	--	--	--

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,294,122.74	19,030.54	4,291,828.57	31,086.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00813	世茂集团	2022-04-01	重大事项	1.23	2023-07-31	1.83	35,000.00	540,252.65	42,918.17	-
03333	中国恒大	2022-03-21	重大事项	0.01	2023-08-28	0.20	47,000.00	459,522.62	433.33	-
06666	恒大物	2022-	重大事	0.01	2023-	1.34	103,500.00	567,665.18	954.25	-

	业	03-21	项		08-03				
--	---	-------	---	--	-------	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。基金管理人将运用合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	4,294,122.74	-	-	-	4,294,122.74
结算备付金	4,611,774.43	-	-	-	4,611,774.43
存出保证金	14,260.64	-	-	-	14,260.64
交易性金融资产	-	-	-	165,618,438.54	165,618,438.54
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	634,834.80	634,834.80
资产总计	8,920,157.81	-	-	166,253,273.34	175,173,431.15
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	-	-	-	37.47	37.47
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	85,508.01	85,508.01
应付托管费	-	-	-	14,251.35	14,251.35
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	-	-	-	4,510,551.52	4,510,551.52
负债总计	-	-	-	4,610,348.35	4,610,348.35
利率敏感度缺口	8,920,157.81	-	-	161,642,924.99	170,563,082.80
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	6,562,884.85	-	-	-	6,562,884.85
结算备付金	193.03	-	-	-	193.03
交易性金融资产	-	-	-	176,674,238.83	176,674,238.83
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	28,543.09	28,543.09
资产总计	6,563,077.88	-	-	176,702,781.92	183,265,859.80
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	-	-	-	339.92	339.92
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	98,713.41	98,713.41
应付托管费	-	-	-	16,452.23	16,452.23
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	-	-	-	2,241,964.23	2,241,964.23
负债总计	-	-	-	2,357,469.79	2,357,469.79
利率敏感度缺口	6,563,077.88	-	-	174,345,312.13	180,908,390.01

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	165,618,438.54	165,618,438.54
应收股利	-	634,834.80	634,834.80
资产合计	-	166,253,273.34	166,253,273.34
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	166,253,273.34	166,253,273.34
项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	176,674,238.83	176,674,238.83
应收股利	-	28,543.09	28,543.09
资产合计	-	176,702,781.92	176,702,781.92
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-

资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	176,702,781.92	176,702,781.92
-----------------------	---	----------------	----------------

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一汇率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
	港币相对人民币升值 5%	8,310,000.00	8,840,000.00
	港币相对人民币贬值 5%	-8,310,000.00	-8,840,000.00

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比	公允价值	占基金资产 净值比例

		例 (%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	165,618,438.54	97.10	176,674,238.8 3	97.66
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	165,618,438.54	97.10	176,674,238.8 3	97.66

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%	7,580,000.00	8,320,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-7,580,000.00	-8,320,000.00

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	165,574,132.79	176,535,857.91
第二层次	-	-
第三层次	44,305.75	138,380.92
合计	165,618,438.54	176,674,238.83

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

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	165,618,438.54	94.55
	其中：股票	165,618,438.54	94.55
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	8,905,897.17	5.08
8	其他各项资产	649,095.44	0.37
9	合计	175,173,431.15	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 165618438.54 元，占基金资产净值比例为 97.10%。

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

无。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	450,977.30	0.26
工业	9,369,305.52	5.49
非日常生活消费品	32,756,122.02	19.20
日常消费品	11,281,093.74	6.61
医疗保健	6,882,494.04	4.04
金融	51,555,434.38	30.23
信息技术	8,728,187.35	5.12
通信服务	21,126,226.68	12.39
公用事业	8,624,595.97	5.06
房地产	14,844,001.54	8.70
合计	165,618,438.54	97.10

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	00005	汇丰控股	304,400	17,119,693.43	10.04
2	00700	腾讯控股	53,200	16,264,759.82	9.54
3	01299	友邦保险	214,000	15,606,724.25	9.15
4	03690	美团-W	115,320	13,003,270.32	7.62
5	00388	香港交易所	23,400	6,368,742.81	3.73
6	02378	保诚	50,900	5,026,072.55	2.95
7	02888	渣打集团	52,050	3,234,462.58	1.90
8	01810	小米集团-W	323,800	3,200,317.97	1.88
9	09987	百胜中国	7,700	3,135,027.03	1.84
10	09633	农夫山泉	74,400	2,966,747.24	1.74
11	00016	新鸿基地产	32,000	2,911,981.63	1.71
12	02015	理想汽车-W	23,100	2,885,843.50	1.69
13	01024	快手-W	56,100	2,769,770.83	1.62
14	02269	药明生物	78,000	2,700,387.22	1.58
15	00669	创科实业	34,000	2,669,224.30	1.56
16	00027	银河娱乐	48,000	2,199,475.49	1.29
17	00001	长和	49,500	2,183,778.78	1.28
18	00002	中电控股	37,500	2,105,571.83	1.23
19	01109	华润置地	66,000	2,020,242.58	1.18
20	02020	安踏体育	26,200	1,933,677.87	1.13
21	02331	李宁	48,500	1,884,780.66	1.11
22	02388	中银香港	78,000	1,722,350.84	1.01
23	01113	长实集团	40,000	1,600,557.28	0.94
24	02319	蒙牛乳业	58,000	1,577,507.78	0.92
25	01928	金沙中国有限公司	59,600	1,467,165.21	0.86
26	00011	恒生银行	14,100	1,449,490.86	0.85
27	00291	华润啤酒	30,000	1,427,225.04	0.84
28	00267	中信股份	161,000	1,387,902.59	0.81
29	02688	新奥能源	14,600	1,313,784.62	0.77
30	00003	香港中华煤气	206,924	1,291,579.18	0.76
31	00688	中国海外发展	81,000	1,275,540.89	0.75
32	01997	九龙仓置业	34,000	1,227,247.58	0.72
33	02313	申洲国际	16,700	1,150,930.68	0.67
34	00066	港铁公司	34,500	1,145,099.16	0.67

35	01093	石药集团	175,200	1,100,025.40	0.64
36	06618	京东健康	23,500	1,071,409.91	0.63
37	00006	电能实业	27,500	1,040,800.17	0.61
38	09868	小鹏汽车-W	22,300	1,028,007.70	0.60
39	02328	中国财险	128,000	1,027,897.06	0.60
40	02382	舜宇光学科技	14,200	1,023,148.87	0.60
41	00992	联想集团	134,000	1,009,365.26	0.59
42	00175	吉利汽车	112,000	987,182.43	0.58
43	00020	商汤-W	433,000	826,379.89	0.48
44	00960	龙湖集团	47,000	825,061.46	0.48
45	00968	信义光能	98,000	817,704.06	0.48
46	00322	康师傅控股	72,000	808,539.58	0.47
47	01801	信达生物	27,000	736,846.42	0.43
48	01929	周大福	55,400	719,173.90	0.42
49	01821	ESR	56,800	703,832.16	0.41
50	00788	中国铁塔	862,000	691,429.68	0.41
51	00083	信和置业	76,000	674,778.72	0.40
52	03800	协鑫科技	400,000	667,513.52	0.39
53	01177	中国生物制药	209,000	657,085.93	0.39
54	06862	海底捞	41,000	651,692.34	0.38
55	00288	万洲国际	166,000	635,152.02	0.37
56	00019	太古股份公司 A	11,000	609,013.89	0.36
57	00881	中升控股	22,000	607,492.62	0.36
58	00868	信义玻璃	53,000	596,152.27	0.35
59	01876	百威亚太	31,800	592,243.07	0.35
60	00836	华润电力	36,000	587,485.66	0.34
61	09626	哔哩哔哩-W	5,300	570,253.85	0.33
62	00012	恒基地产	26,470	568,632.09	0.33
63	00762	中国联通	114,000	544,447.63	0.32
64	01038	长江基建集团	14,000	535,024.99	0.31
65	00151	中国旺旺	110,000	527,372.56	0.31
66	00017	新世界发展	28,250	502,165.63	0.29
67	00384	中国燃气	60,400	499,517.70	0.29
68	00268	金蝶国际	51,000	492,779.87	0.29
69	01066	威高股份	50,000	472,053.76	0.28
70	00135	昆仑能源	80,000	454,351.74	0.27
71	01209	华润万象生活	12,600	451,899.28	0.26
72	00241	阿里健康	100,000	434,252.58	0.25
73	01193	华润燃气	17,100	422,524.99	0.25
74	02618	京东物流	36,600	412,357.40	0.24
75	01044	恒安国际	13,500	410,742.09	0.24
76	06098	碧桂园服务	44,000	410,539.25	0.24
77	00004	九龙仓集团	23,000	394,847.15	0.23
78	01548	金斯瑞生物科技	24,000	389,444.35	0.23

79	01972	太古地产	21,600	383,558.43	0.22
80	00270	粤海投资	60,000	373,955.09	0.22
81	02007	碧桂园	255,000	373,816.79	0.22
82	00101	恒隆地产	33,000	368,146.61	0.22
83	00285	比亚迪电子	16,500	360,540.28	0.21
84	06110	滔搏	57,000	356,833.92	0.21
85	09688	再鼎医药	18,100	350,444.60	0.21
86	06186	中国飞鹤	84,000	337,665.96	0.20
87	01347	华虹半导体	14,000	330,437.63	0.19
88	01308	海丰国际	25,000	329,607.85	0.19
89	01378	中国宏桥	50,500	296,121.54	0.17
90	00772	阅文集团	9,400	285,564.87	0.17
91	03692	翰森制药	22,000	255,572.86	0.15
92	06969	思摩尔国际	34,000	249,524.67	0.15
93	03998	波司登	80,000	243,402.72	0.14
94	00316	东方海外国际	2,500	242,250.25	0.14
95	00656	复星国际	45,500	225,691.48	0.13
96	00853	微创医疗	16,900	220,633.50	0.13
97	00293	国泰航空	24,000	177,241.44	0.10
98	01313	华润水泥控股	52,000	154,855.76	0.09
99	03799	达利食品	39,000	125,850.27	0.07
100	06993	蓝月亮集团	32,500	116,860.97	0.07

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	00813	世茂集团	35,000.00	42,918.17	0.03
2	06666	恒大物业	103,500.00	954.25	0.00
3	03333	中国恒大	47,000.00	433.33	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	00700	腾讯控股	5,888,247.74	3.25
2	03690	美团-W	5,281,983.09	2.92
3	00005	汇丰控股	5,272,187.35	2.91
4	02378	保诚	5,164,402.76	2.85

5	01299	友邦保险	4,704,978.35	2.60
6	02888	渣打集团	3,215,369.54	1.78
7	00388	香港交易所	2,086,007.20	1.15
8	01024	快手-W	1,210,525.71	0.67
9	01810	小米集团-W	1,041,485.26	0.58
10	02269	药明生物	1,035,045.17	0.57
11	09987	百胜中国	1,003,271.97	0.55
12	00016	新鸿基地产	904,985.06	0.50
13	09633	农夫山泉	895,127.41	0.49
14	02020	安踏体育	786,820.42	0.43
15	02331	李宁	776,523.30	0.43
16	01109	华润置地	759,037.29	0.42
17	00027	银河娱乐	726,024.40	0.40
18	00669	创科实业	711,539.00	0.39
19	00001	长和	645,513.64	0.36
20	09626	哔哩哔哩-W	638,793.77	0.35

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	00005	汇丰控股	9,608,413.63	5.31
2	00700	腾讯控股	8,564,391.00	4.73
3	03690	美团-W	6,293,983.25	3.48
4	01299	友邦保险	5,469,730.17	3.02
5	02328	中国财险	3,952,210.76	2.18
6	00388	香港交易所	2,257,601.95	1.25
7	02269	药明生物	1,258,919.65	0.70
8	01810	小米集团-W	1,116,966.37	0.62
9	09987	百胜中国	1,053,374.33	0.58
10	00016	新鸿基地产	957,152.37	0.53
11	09633	农夫山泉	933,368.63	0.52
12	02331	李宁	914,516.14	0.51
13	01024	快手-W	876,887.67	0.48
14	01109	华润置地	835,439.10	0.46
15	00027	银河娱乐	802,645.73	0.44
16	00669	创科实业	774,644.88	0.43
17	02020	安踏体育	734,149.65	0.41
18	00001	长和	688,246.02	0.38

19	02015	理想汽车—W	646,946.97	0.36
20	02388	中银香港	582,920.10	0.32

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	62,082,971.31
卖出股票的收入（成交）总额	68,011,106.45

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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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

本报告期内，本基金投资的前十名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	14,260.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	634,834.80
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	649,095.44

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

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

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	00813	世茂集团	42,918.17	0.03	重大事项停

					牌
2	06666	恒大物业	954.25	0.00	重大事项停牌
3	03333	中国恒大	433.33	0.00	重大事项停牌

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
4,122	49,485.20	93,249,600.00	45.72%	110,728,400.00	54.28%

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	李莉	24,826,600.00	12.17%
2	BARCLAYS BANK PLC	10,259,300.00	5.03%
3	泰康资产丰泽混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	6,106,100.00	2.99%
4	泰康资产红利成长股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	4,237,800.00	2.08%
5	中信建投证券股份有限公司	3,530,839.00	1.73%
6	南靖汇添企业管理有限公司	3,000,000.00	1.47%
7	广发证券股份有限公司	1,922,900.00	0.94%
8	招商证券股份有限公司	1,821,061.00	0.89%
9	中国铁路北京局集团有限	1,742,900.00	0.85%

	公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司		
10	中国铁路成都局集团有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	1,725,200.00	0.85%
11	中国农业银行股份有限公司—华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	33,747,600.00	16.54%

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（2018 年 4 月 27 日）基金份额总额	284,978,000.00
本报告期期初基金份额总额	209,978,000.00
本报告期基金总申购份额	61,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	67,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	203,978,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	4	130,094,077.76	100.00%	91,065.71	100.00%	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	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:

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	关于华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-01-16
2	华安 CES 港股通精选 100 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
3	华安 CES 港股通精选 100 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定媒介	2023-03-30
4	关于华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-04
5	华安 CES 港股通精选 100 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
6	关于华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-23
7	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指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

联接基金	1	20230228- 20230613	37,628 ,700.0 0	28,710 ,000.0 0	32,591,1 00.00	33,747,600. 00	16.54%
------	---	-----------------------	-----------------------	-----------------------	-------------------	-------------------	--------

注：无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安 CES 港股通精选 100 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 CES 港股通精选 100 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