华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作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 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13

§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的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 42

7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
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 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
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 57
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 57
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 57

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 57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
7.12 投资组合报告附注 58
§8 基金份额持有人信息 58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
8.2 期末上市基金前十名持有人 59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 60
§9 开放式基金份额变动 60
§10 重大事件揭示 60
10.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
10.4 基金投资策略的改变 60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
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 60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 61
10.8 其他重大事件 62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 63
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 63
§12 备查文件目录 63
12.1 备查文件目录 63
12.2 存放地点 63
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 华安
基金主代码	159359
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 19 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	2,459,140,424.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 12 月 2 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、完全复制策略 2、替代性策略 3、股指期货投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	层	
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-24,931,398.89
本期利润	33,252,120.91
加权平均基金份额本期利润	0.0093
本期加权平均净值利润率	0.93%
本期基金份额净值增长率	1.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,383,231.27
期末可供分配基金份额利润	0.0014
期末基金资产净值	2,505,812,837.07
期末基金份额净值	1.0190
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.90%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、本基金于 2024 年 11 月 19 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

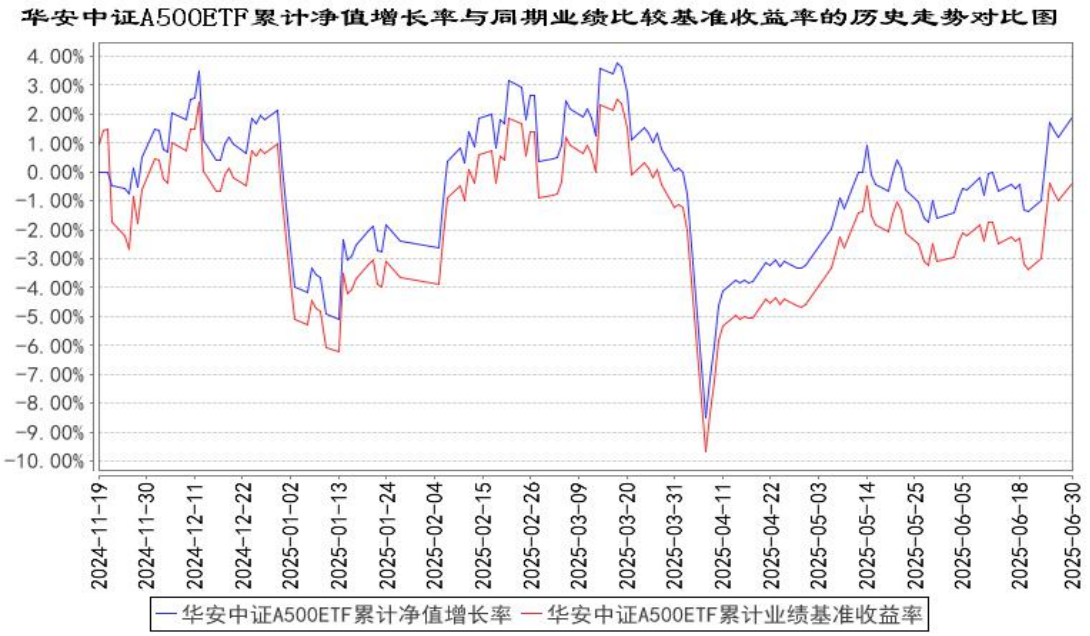
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.55%	0.59%	2.82%	0.60%	0.73%	-0.01%
过去三个月	1.88%	1.19%	0.84%	1.20%	1.04%	-0.01%
过去六个月	1.61%	1.10%	0.47%	1.10%	1.14%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.90%	1.04%	-0.38%	1.09%	2.28%	-0.05%

注：本基金于 2024 年 11 月 19 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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



注：本基金于 2024 年 11 月 19 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管

理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 283 只证券投资基金，管理资产规模达到 7,488.16 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	首席指数投资官、公司总经理助理、指数与量化投资部高级总监、本基金的基金经理	2024 年 11 月 19 日	-	21 年	理学博士，21 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 1 月担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金（由华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）、华安中证银行指数型证券投资基金（由华安中证银行指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月担任华安创业板 50 指数型证券投资基金（由华安创业板 50 指数分级证券投资基金于 2021 年 1 月转型而来）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 月至 2025 年 1 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来）的基金经理。2019 年 12 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，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 月至 2024 年 6 月，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月至 2023 年 11 月，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 月至 2024 年 6 月，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 12 月至 2025 年 6 月，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。2024 年 7 月至 2025 年 3 月，同时担任华安深证主板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月起，同时担任华安中证有色金属矿业主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月至 2024 年 12 月，同时担任华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。2024 年 11 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月起，同时担任华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 6 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发起式联接基金的基金经理。
顾昕	本基金的	2025 年 6	-	8 年	硕士研究生，8 年基金行业从业经验。2017

	基金经理	月 30 日			年 3 月应届毕业加入华安基金，历任指数与量化投资部 ETF 研究员、基金经理助理。2023 年 11 月起，担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起，同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月至 2025 年 5 月，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2024 年 8 月起，同时担任华安中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华安北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安中证云计算与大数据主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。
王超	本基金的基金经理助理	2025 年 1 月 2 日	2025 年 3 月 31 日	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经验，2014 年应届毕业加入华安基金，历任基金运营部基金会计，指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2025 年 3 月起，担任指数与量化投资部基金经理。

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	11	140,108,815,412.06	2009 年 9 月 5 日
	私募资产管理计划	1	9,596,204.36	2023 年 11 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	12	140,118,411,616.42	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控

制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)　交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)　交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。(3)　银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各

类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，国内经济增长稳中略升，即使二季度外部局势复杂多变、压力明显加大，依然取得了 GDP 增速 5.3%的经济成果，可谓波折中前行。资本市场演绎了同样剧本，受关税冲击影响，二季度 A 股市场发生较大波动，剧烈调整后演绎修复行情，报告期内中证 A500 指数微涨 0.47%。

本基金跟踪中证 A500 指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的 500 只证券作为指数样本，涵盖 A 股各行业的核心资产，对我国整体资本市场具有较强的代表性。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0190 元，本报告期份额净值增长率为 1.61%，同期业绩比较基准增长率为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们面临的外部环境仍然复杂多变，内部经济运行的基础还需加固，持续关注需求端的边际变化。政策层面精准施策，从“分子端”（企业盈利）到“分母端”（流动性）双管齐下，有效性和前瞻性大幅提升，成为市场重要的承托力量。

展望后市，行情已渐渐从政策驱动转向基本面和流动性驱动，多重资金积极入市，资金面持续较强支撑。虽美联储短期降息的急迫性不强，但已进入降息通道，这也为国内政策打开空间。

中证 A500 指数汇集中国核心资产，500 只成份股基本实现中证三级行业基本全覆盖，聚焦新质生产力，是把握本轮市场行情的理想工具。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	38,604,016.46	43,758,228.64
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,491,480,838.11	5,139,763,764.74
其中：股票投资		2,491,425,534.47	5,139,763,764.74
基金投资		-	-
债券投资		55,303.64	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	61,506.46
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		2,530,084,854.57	5,183,583,499.84
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,031,621.44	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		346,029.09	498,224.15
应付托管费		115,343.05	166,074.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	22,779,023.76	17,615,315.83
负债合计		24,272,017.50	18,279,614.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,459,140,424.00	5,150,140,424.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	46,672,413.07	15,163,461.14
净资产合计		2,505,812,837.07	5,165,303,885.14
负债和净资产总计		2,530,084,854.57	5,183,583,499.84

注:(1)报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 2,459,140,424.00 份。

（2）本基金基金合同于 2024 年 11 月 19 日生效。

6.2 利润表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		36,897,562.29
1.利息收入		27,426.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	27,426.82
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-23,101,640.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-60,605,493.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	97,922.36
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	37,405,930.89
以摊余成本计量的金融资产		-

终止确认产生的收益		
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	58,183,519.80
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	1,788,256.02
减：二、营业总支出		3,645,441.38
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,665,899.88
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	888,633.31
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-
4．投资顾问费		-
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．信用减值损失	6.4.7.16	-
7．税金及附加		0.22
8．其他费用	6.4.7.17	90,907.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,252,120.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,252,120.91
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		33,252,120.91

6.3 净资产变动表

会计主体：华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,150,140,424.00	-	15,163,461.14	5,165,303,885.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,150,140,424.00	-	15,163,461.14	5,165,303,885.14

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,691,000,000.00	-	31,508,951.93	-2,659,491,048.07
（一）、综合收益总额	-	-	33,252,120.91	33,252,120.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,691,000,000.00	-	-1,743,168.98	-2,692,743,168.98
其中：1.基金申购款	693,000,000.00	-	-16,435,998.42	676,564,001.58
2.基金赎回款	-3,384,000,000.00	-	14,692,829.44	-3,369,307,170.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,459,140,424.00	-	46,672,413.07	2,505,812,837.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2024]1525 号《关于准予华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 11 月 14 日止期间向社会公开发行募集。基金合同于 2024 年 11 月 19 日生效。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,999,999,822.00 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 140,602.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,000,140,424.00 元，折合 2,000,140,424.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，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）、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩基准为：中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 （以下简称“财政部”） 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和基金业协会

发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止和自 2024 年 11 月 19 日 (基金合同生效日)起至 2024 年 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关

交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为现金分红；

在符合以下基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配：

本基金每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时，基金管理人可进行收益分配；

当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引 （试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”） 在银行间债券市场、

上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种 （估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日

活期存款	1,298,008.91
等于：本金	1,297,882.71
加：应计利息	126.20
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	37,306,007.55
等于：本金	37,304,593.46
加：应计利息	1,414.09
减：坏账准备	-
合计	38,604,016.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,479,876,878.81	-	2,491,425,534.47	11,548,655.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	55,300.00	3.64	55,303.64	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	55,300.00	3.64	55,303.64	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,479,932,178.81	3.64	2,491,480,838.11	11,548,655.66

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	68,477.08
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付替代款	22,609,798.71
预提审计费	31,240.60
预提信息披露费	69,507.37
合计	22,779,023.76

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,150,140,424.00	5,150,140,424.00
本期申购	693,000,000.00	693,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,384,000,000.00	-3,384,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,459,140,424.00	2,459,140,424.00

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	26,096,467.23	-10,933,006.09	15,163,461.14
加：会计	-	-	-

政策变更			
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	26,096,467.23	-10,933,006.09	15,163,461.14
本期利润	-24,931,398.89	58,183,519.80	33,252,120.91
本期基金份额交易产生的变动数	2,218,162.93	-3,961,331.91	-1,743,168.98
其中：基金申购款	-114,548.79	-16,321,449.63	-16,435,998.42
基金赎回款	2,332,711.72	12,360,117.72	14,692,829.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,383,231.27	43,289,181.80	46,672,413.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,881.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,531.67
结算备付金利息收入	13.47
其他	-
合计	27,426.82

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-28,126,681.00
股票投资收益——赎回差价收入	-32,478,812.60
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	-60,605,493.60

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,239,302,297.23
减：卖出股票成本总额	2,265,564,421.51
减：交易费用	1,864,556.72
买卖股票差价收入	-28,126,681.00

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,369,307,170.56
减：现金支付赎回款总额	1,938,760,586.56
减：赎回股票成本总额	1,463,025,396.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	-32,478,812.60

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	59.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	97,862.44
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	97,922.36

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	636,946.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	539,000.00
减：应计利息总额	58.16
减：交易费用	25.56
买卖债券差价收入	97,862.44

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

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	37,405,930.89
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	37,405,930.89

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	58,183,519.80
股票投资	58,183,519.80
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	58,183,519.80

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	1,788,256.02
合计	1,788,256.02

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	160.00
合计	90,907.97

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。

根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,665,899.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	293,813.53
应支付基金管理人的净管理费	2,372,086.35

注：支付基金管理人华安基金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 X 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	888,633.31

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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： 日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.05% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国泰君安证券股份有限公司	-	-	984,047,762.00	19.11
招商银行股份有限公司－华安中证A500指数型发起式证券投资基金联接基金	1,431,585,300.00	58.21	1,775,000,000.00	34.47

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,298,008.91	4,881.68

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025年6月16日	1个月内（含）	配债未上市	100.00	100.01	553	55,300.00	55,303.64	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金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。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,604,016.46	-	-	-	38,604,016.46
交易性金融资产	55,303.64	-	-	2,491,425,534.47	2,491,480,838.11
资产总计	38,659,320.10	-	-	2,491,425,534.47	2,530,084,854.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	346,029.09	346,029.09
应付托管费	-	-	-	115,343.05	115,343.05
应付清算款	-	-	-	1,031,621.44	1,031,621.44
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
其他负债	-	-	-	22,779,023.76	22,779,023.76
负债总计	-	-	-	24,272,017.50	24,272,017.50
利率敏感度缺口	38,659,320.10	-	-	2,467,153,516.97	2,505,812,837.07
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	43,758,228.64	-	-	-	43,758,228.64
交易性金融资产	-	-	-	5,139,763,764.74	5,139,763,764.74
应收清算款	-	-	-	61,506.46	61,506.46
资产总计	43,758,228.64	-	-	5,139,825,271.20	5,183,583,499.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	498,224.15	498,224.15
应付托管费	-	-	-	166,074.72	166,074.72
其他负债	-	-	-	17,615,315.83	17,615,315.83
负债总计	-	-	-	18,279,614.70	18,279,614.70
利率敏感度缺口	43,758,228.64	-	-	5,121,545,656.50	5,165,303,885.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.002%(2024 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	2,491,425,534.47	99.43	5,139,763,764.74	99.51
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	55,303.64	0.00	-	-
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	2,491,480,838.11	99.43	5,139,763,764.74	99.51

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2025 年 6 月 30 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	124,701,416.37	-
	业绩比较基准下降 5%	-124,701,416.37	-

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满 6 个月，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	2,491,425,534.47	5,133,519,908.74
第二层次	55,303.64	6,243,856.00
第三层次	-	-

合计	2,491,480,838.11	5,139,763,764.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,491,425,534.47	98.47
	其中：股票	2,491,425,534.47	98.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,303.64	0.00
	其中：债券	55,303.64	0.00
	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	38,604,016.46	1.53
8	其他各项资产	-	-
9	合计	2,530,084,854.57	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,399,494.80	0.53
B	采矿业	126,051,178.00	5.03
C	制造业	1,445,922,010.98	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,724,208.00	3.06
E	建筑业	47,262,769.00	1.89
F	批发和零售业	17,366,731.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	86,580,531.00	3.46
H	住宿和餐饮业	2,013,279.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,763,211.89	6.66
J	金融业	403,269,213.60	16.09
K	房地产业	25,914,484.00	1.03
L	租赁和商务服务业	27,872,580.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	28,067,044.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	5,381,146.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,615,986.00	0.06
Q	卫生和社会工作	9,462,485.20	0.38
R	文化、体育和娱乐业	7,759,182.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	2,491,425,534.47	99.43

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	68,020	95,875,550.40	3.83
2	300750	宁德时代	286,380	72,230,763.60	2.88
3	601318	中国平安	1,171,500	64,994,820.00	2.59
4	600036	招商银行	1,348,300	61,954,385.00	2.47
5	601166	兴业银行	1,803,600	42,096,024.00	1.68
6	600900	长江电力	1,329,900	40,083,186.00	1.60
7	000333	美的集团	527,600	38,092,720.00	1.52
8	601899	紫金矿业	1,785,900	34,825,050.00	1.39
9	002594	比亚迪	98,500	32,693,135.00	1.30
10	300059	东方财富	1,368,320	31,649,241.60	1.26
11	600030	中信证券	1,058,700	29,241,294.00	1.17
12	601398	工商银行	3,796,800	28,817,712.00	1.15
13	600276	恒瑞医药	483,360	25,086,384.00	1.00
14	000858	五 粮 液	205,194	24,397,566.60	0.97
15	601328	交通银行	2,895,900	23,167,200.00	0.92
16	000651	格力电器	485,600	21,813,152.00	0.87
17	601288	农业银行	3,460,500	20,347,740.00	0.81
18	600887	伊利股份	691,300	19,273,444.00	0.77
19	603259	药明康德	275,300	19,147,115.00	0.76
20	002475	立讯精密	547,000	18,975,430.00	0.76
21	600919	江苏银行	1,585,600	18,932,064.00	0.76
22	688981	中芯国际	211,082	18,611,099.94	0.74
23	601816	京沪高铁	3,180,300	18,286,725.00	0.73
24	600000	浦发银行	1,267,900	17,598,452.00	0.70
25	000725	京东方 A	3,981,200	15,884,988.00	0.63
26	002371	北方华创	34,200	15,123,582.00	0.60
27	601088	中国神华	362,500	14,695,750.00	0.59
28	300308	中际旭创	98,760	14,405,133.60	0.57
29	300502	新易盛	111,760	14,195,755.20	0.57
30	300760	迈瑞医疗	63,100	14,181,725.00	0.57
31	688041	海光信息	100,175	14,153,725.75	0.56
32	688256	寒武纪	22,900	13,774,350.00	0.55
33	601601	中国太保	365,300	13,702,403.00	0.55
34	601728	中国电信	1,675,900	12,988,225.00	0.52
35	601668	中国建筑	2,234,500	12,893,065.00	0.51
36	002352	顺丰控股	263,800	12,862,888.00	0.51

37	300124	汇川技术	198,000	12,784,860.00	0.51
38	000001	平安银行	1,049,000	12,661,430.00	0.51
39	002714	牧原股份	291,480	12,245,074.80	0.49
40	002230	科大讯飞	251,700	12,051,396.00	0.48
41	601127	赛力斯	89,500	12,021,640.00	0.48
42	603501	豪威集团	94,000	11,999,100.00	0.48
43	600031	三一重工	642,000	11,523,900.00	0.46
44	000063	中兴通讯	353,200	11,475,468.00	0.46
45	600941	中国移动	100,400	11,300,020.00	0.45
46	603019	中科曙光	157,700	11,102,080.00	0.44
47	002415	海康威视	399,700	11,083,681.00	0.44
48	600309	万华化学	197,500	10,716,350.00	0.43
49	300274	阳光电源	156,200	10,585,674.00	0.42
50	601857	中国石油	1,229,400	10,511,370.00	0.42
51	601919	中远海控	688,900	10,361,056.00	0.41
52	600690	海尔智家	407,300	10,092,894.00	0.40
53	600660	福耀玻璃	175,000	9,976,750.00	0.40
54	601012	隆基绿能	657,400	9,874,148.00	0.39
55	600406	国电南瑞	439,500	9,849,195.00	0.39
56	688008	澜起科技	118,040	9,679,280.00	0.39
57	601766	中国中车	1,320,400	9,295,616.00	0.37
58	000338	潍柴动力	590,800	9,086,504.00	0.36
59	600050	中国联通	1,694,800	9,050,232.00	0.36
60	000568	泸州老窖	79,400	9,003,960.00	0.36
61	600028	中国石化	1,587,400	8,952,936.00	0.36
62	603986	兆易创新	70,500	8,920,365.00	0.36
63	000100	TCL 科技	2,032,100	8,798,993.00	0.35
64	688012	中微公司	48,049	8,759,332.70	0.35
65	601988	中国银行	1,551,300	8,718,306.00	0.35
66	601006	大秦铁路	1,312,000	8,659,200.00	0.35
67	300476	胜宏科技	63,100	8,479,378.00	0.34
68	601985	中国核电	892,000	8,313,440.00	0.33
69	601225	陕西煤业	422,800	8,134,672.00	0.32
70	600104	上汽集团	503,600	8,082,780.00	0.32
71	002027	分众传媒	1,104,000	8,059,200.00	0.32
72	600150	中国船舶	241,900	7,871,426.00	0.31
73	600418	江淮汽车	193,600	7,761,424.00	0.31
74	601628	中国人寿	183,300	7,550,127.00	0.30
75	600760	中航沈飞	125,500	7,356,810.00	0.29
76	605499	东鹏饮料	22,900	7,191,745.00	0.29
77	603288	海天味业	183,144	7,126,133.04	0.28
78	688111	金山办公	25,436	7,123,351.80	0.28
79	688271	联影医疗	54,307	6,937,176.18	0.28

80	600111	北方稀土	278,500	6,934,650.00	0.28
81	000425	徐工机械	890,700	6,920,739.00	0.28
82	000792	盐湖股份	401,000	6,849,080.00	0.27
83	600938	中国海油	261,400	6,825,154.00	0.27
84	000625	长安汽车	533,200	6,803,632.00	0.27
85	601888	中国中免	109,600	6,682,312.00	0.27
86	600436	片仔癀	33,100	6,620,331.00	0.26
87	600905	三峡能源	1,548,100	6,594,906.00	0.26
88	601658	邮储银行	1,199,300	6,560,171.00	0.26
89	002625	光启技术	163,600	6,540,728.00	0.26
90	600089	特变电工	542,600	6,473,218.00	0.26
91	300033	同花顺	23,700	6,470,337.00	0.26
92	603993	洛阳钼业	765,700	6,447,194.00	0.26
93	600547	山东黄金	201,100	6,421,123.00	0.26
94	002050	三花智控	242,700	6,402,426.00	0.26
95	300015	爱尔眼科	507,200	6,329,856.00	0.25
96	002241	歌尔股份	268,000	6,249,760.00	0.25
97	600048	保利发展	771,100	6,245,910.00	0.25
98	600019	宝钢股份	947,700	6,245,343.00	0.25
99	601390	XD中国中	1,108,600	6,219,246.00	0.25
100	002463	沪电股份	143,100	6,093,198.00	0.24
101	600415	小商品城	292,200	6,042,696.00	0.24
102	601600	中国铝业	854,300	6,014,272.00	0.24
103	000977	浪潮信息	116,300	5,917,344.00	0.24
104	300014	亿纬锂能	128,700	5,895,747.00	0.24
105	601989	中国重工	1,234,700	5,729,008.00	0.23
106	600585	海螺水泥	263,100	5,648,757.00	0.23
107	000538	云南白药	99,100	5,528,789.00	0.22
108	600570	恒生电子	164,400	5,513,976.00	0.22
109	002384	东山精密	145,800	5,506,866.00	0.22
110	600893	航发动力	141,400	5,449,556.00	0.22
111	002179	中航光电	133,400	5,384,024.00	0.21
112	603799	华友钴业	145,000	5,367,900.00	0.21
113	000988	华工科技	113,400	5,330,934.00	0.21
114	600584	长电科技	154,000	5,188,260.00	0.21
115	601727	上海电气	689,900	5,098,361.00	0.20
116	000938	紫光股份	211,900	5,083,481.00	0.20
117	600438	通威股份	287,200	4,810,600.00	0.19
118	002049	紫光国微	72,400	4,768,264.00	0.19
119	002028	思源电气	65,200	4,753,732.00	0.19
120	300408	三环集团	142,295	4,752,653.00	0.19
121	000002	万　科A	739,800	4,749,516.00	0.19
122	300433	蓝思科技	212,100	4,729,830.00	0.19

123	600795	国电电力	965,300	4,672,052.00	0.19
124	601669	中国电建	941,400	4,584,618.00	0.18
125	600489	中金黄金	312,600	4,573,338.00	0.18
126	002422	科伦药业	127,200	4,569,024.00	0.18
127	600988	赤峰黄金	183,000	4,553,040.00	0.18
128	601689	拓普集团	96,200	4,545,450.00	0.18
129	300339	润和软件	87,100	4,427,293.00	0.18
130	600010	包钢股份	2,456,400	4,396,956.00	0.18
131	002456	欧菲光	365,200	4,327,620.00	0.17
132	600009	上海机场	130,100	4,133,277.00	0.16
133	600160	巨化股份	143,600	4,118,448.00	0.16
134	000768	中航西飞	148,700	4,065,458.00	0.16
135	688169	石头科技	25,967	4,065,133.85	0.16
136	601186	中国铁建	500,700	4,010,607.00	0.16
137	688036	传音控股	50,276	4,006,997.20	0.16
138	002074	国轩高科	122,700	3,982,842.00	0.16
139	002252	上海莱士	578,600	3,974,982.00	0.16
140	002460	赣锋锂业	116,300	3,927,451.00	0.16
141	000963	华东医药	97,000	3,914,920.00	0.16
142	601100	恒立液压	54,300	3,909,600.00	0.16
143	600839	四川长虹	398,800	3,876,336.00	0.15
144	600886	国投电力	262,900	3,875,146.00	0.15
145	000157	中联重科	533,700	3,858,651.00	0.15
146	600989	宝丰能源	237,300	3,830,022.00	0.15
147	601360	三六零	375,000	3,825,000.00	0.15
148	600183	生益科技	126,800	3,823,020.00	0.15
149	600115	中国东航	932,200	3,756,766.00	0.15
150	002466	天齐锂业	116,700	3,739,068.00	0.15
151	601058	赛轮轮胎	279,600	3,668,352.00	0.15
152	000408	藏格矿业	85,800	3,661,086.00	0.15
153	300442	润泽科技	73,700	3,650,361.00	0.15
154	300394	天孚通信	45,636	3,643,578.24	0.15
155	002517	恺英网络	188,400	3,638,004.00	0.15
156	002916	深南电路	33,650	3,627,806.50	0.14
157	688213	思特威	35,400	3,618,588.00	0.14
158	002001	新 和 成	167,400	3,560,598.00	0.14
159	002920	德赛西威	34,800	3,554,124.00	0.14
160	000807	云铝股份	221,500	3,539,570.00	0.14
161	002340	格林美	553,100	3,512,185.00	0.14
162	600066	宇通客车	141,200	3,510,232.00	0.14
163	688120	华海清科	20,800	3,508,960.00	0.14
164	600426	华鲁恒升	160,400	3,475,868.00	0.14
165	600029	南方航空	587,400	3,465,660.00	0.14

166	000975	山金国际	182,600	3,458,444.00	0.14
167	000661	长春高新	34,800	3,451,464.00	0.14
168	001979	招商蛇口	392,000	3,437,840.00	0.14
169	002195	岩山科技	610,100	3,434,863.00	0.14
170	688235	百济神州	14,600	3,411,144.00	0.14
171	600011	华能国际	476,900	3,405,066.00	0.14
172	002558	巨人网络	144,400	3,400,620.00	0.14
173	601800	中国交建	380,300	3,380,867.00	0.13
174	688126	沪硅产业	180,457	3,378,155.04	0.13
175	600196	复星医药	134,500	3,374,605.00	0.13
176	002236	大华股份	210,400	3,341,152.00	0.13
177	300896	爱美客	19,100	3,338,871.00	0.13
178	600674	川投能源	206,200	3,307,448.00	0.13
179	300418	昆仑万维	97,700	3,285,651.00	0.13
180	302132	中航成飞	36,900	3,244,986.00	0.13
181	600346	恒力石化	227,400	3,242,724.00	0.13
182	002156	通富微电	126,300	3,235,806.00	0.13
183	600745	闻泰科技	96,100	3,222,233.00	0.13
184	301236	软通动力	58,908	3,218,733.12	0.13
185	002648	卫星化学	185,700	3,218,181.00	0.13
186	300207	欣旺达	160,000	3,209,600.00	0.13
187	300251	光线传媒	158,100	3,204,687.00	0.13
188	688608	恒玄科技	9,200	3,201,416.00	0.13
189	601111	中国国航	405,400	3,198,606.00	0.13
190	600487	亨通光电	208,900	3,196,170.00	0.13
191	688002	睿创微纳	45,718	3,187,458.96	0.13
192	600372	中航机载	264,300	3,187,458.00	0.13
193	688617	惠泰医疗	10,644	3,161,268.00	0.13
194	688396	华润微	66,811	3,150,806.76	0.13
195	601868	中国能建	1,407,600	3,138,948.00	0.13
196	300450	先导智能	125,300	3,113,705.00	0.12
197	003816	中国广核	847,100	3,083,444.00	0.12
198	601168	西部矿业	183,700	3,054,931.00	0.12
199	601117	中国化学	397,000	3,044,990.00	0.12
200	601319	中国人保	348,800	3,038,048.00	0.12
201	600741	华域汽车	172,100	3,037,565.00	0.12
202	000066	中国长城	205,200	3,036,960.00	0.12
203	688777	中控技术	67,393	3,026,619.63	0.12
204	300661	圣邦股份	41,530	3,022,138.10	0.12
205	300866	安克创新	26,600	3,021,760.00	0.12
206	688506	百利天恒	10,200	3,020,424.00	0.12
207	000786	北新建材	113,900	3,016,072.00	0.12
208	300454	深信服	31,900	3,004,342.00	0.12

209	688099	晶晨股份	42,242	2,999,604.42	0.12
210	600176	中国巨石	262,900	2,997,060.00	0.12
211	600460	士兰微	120,300	2,985,846.00	0.12
212	688122	西部超导	57,398	2,977,808.24	0.12
213	002601	龙佰集团	183,500	2,974,535.00	0.12
214	002273	水晶光电	148,600	2,967,542.00	0.12
215	600256	广汇能源	491,500	2,958,830.00	0.12
216	600588	用友网络	219,900	2,940,063.00	0.12
217	600096	云天化	133,600	2,935,192.00	0.12
218	002465	海格通信	210,500	2,934,370.00	0.12
219	002555	三七互娱	169,000	2,922,010.00	0.12
220	600879	航天电子	278,700	2,917,989.00	0.12
221	600352	浙江龙盛	287,100	2,916,936.00	0.12
222	603129	春风动力	13,400	2,901,100.00	0.12
223	600219	南山铝业	757,300	2,900,459.00	0.12
224	000831	中国稀土	80,300	2,900,436.00	0.12
225	300017	网宿科技	269,000	2,883,680.00	0.12
226	300474	景嘉微	39,400	2,876,200.00	0.11
227	600039	四川路桥	289,200	2,863,080.00	0.11
228	600482	中国动力	124,000	2,860,680.00	0.11
229	002185	华天科技	283,200	2,860,320.00	0.11
230	000933	神火股份	171,300	2,850,432.00	0.11
231	601633	长城汽车	131,500	2,824,620.00	0.11
232	000630	铜陵有色	837,000	2,795,580.00	0.11
233	601877	正泰电器	122,500	2,777,075.00	0.11
234	300347	泰格医药	51,800	2,761,976.00	0.11
235	600362	江西铜业	117,000	2,741,310.00	0.11
236	002493	荣盛石化	329,500	2,728,260.00	0.11
237	002129	TCL中环	354,600	2,723,328.00	0.11
238	002130	沃尔核材	114,100	2,717,862.00	0.11
239	601021	春秋航空	48,800	2,715,720.00	0.11
240	600885	宏发股份	121,600	2,712,896.00	0.11
241	002294	信立泰	57,100	2,702,543.00	0.11
242	688072	拓荆科技	17,547	2,697,149.37	0.11
243	688047	龙芯中科	20,100	2,681,139.00	0.11
244	600085	同仁堂	73,600	2,654,016.00	0.11
245	688578	艾力斯	28,400	2,642,336.00	0.11
246	001965	招商公路	218,300	2,619,600.00	0.10
247	002180	纳思达	112,720	2,585,796.80	0.10
248	002131	利欧股份	736,600	2,578,100.00	0.10
249	002085	万丰奥威	161,800	2,571,002.00	0.10
250	002709	天赐材料	141,600	2,565,792.00	0.10
251	688266	泽璟制药	23,400	2,515,734.00	0.10

252	002738	中矿资源	78,000	2,508,480.00	0.10
253	300058	蓝色光标	381,500	2,502,640.00	0.10
254	002138	顺络电子	88,800	2,497,056.00	0.10
255	002532	天山铝业	299,400	2,488,014.00	0.10
256	002078	太阳纸业	184,200	2,479,332.00	0.10
257	603605	珀莱雅	29,900	2,475,421.00	0.10
258	002436	兴森科技	186,600	2,470,584.00	0.10
259	600233	圆通速递	191,300	2,465,857.00	0.10
260	300002	神州泰岳	208,300	2,457,940.00	0.10
261	300782	卓胜微	34,400	2,455,128.00	0.10
262	300122	智飞生物	124,950	2,447,770.50	0.10
263	300136	信维通信	108,400	2,428,160.00	0.10
264	002410	广联达	180,700	2,423,187.00	0.10
265	600862	中航高科	92,400	2,409,792.00	0.10
266	002472	双环传动	71,900	2,407,931.00	0.10
267	300759	康龙化成	98,100	2,407,374.00	0.10
268	600188	兖矿能源	197,500	2,403,575.00	0.10
269	605117	德业股份	45,500	2,396,030.00	0.10
270	002128	电投能源	120,800	2,389,424.00	0.10
271	002281	光迅科技	48,240	2,379,196.80	0.09
272	002938	鹏鼎控股	74,000	2,370,220.00	0.09
273	600161	天坛生物	123,200	2,364,208.00	0.09
274	300054	鼎龙股份	81,700	2,343,156.00	0.09
275	601615	明阳智能	203,200	2,334,768.00	0.09
276	300346	南大光电	73,780	2,334,399.20	0.09
277	601618	中国中冶	782,400	2,331,552.00	0.09
278	000301	东方盛虹	279,700	2,329,901.00	0.09
279	600143	金发科技	224,700	2,316,657.00	0.09
280	002065	东华软件	241,200	2,315,520.00	0.09
281	000423	东阿阿胶	43,700	2,285,510.00	0.09
282	688180	君实生物	67,200	2,283,456.00	0.09
283	002202	金风科技	222,000	2,275,500.00	0.09
284	603659	璞泰来	120,600	2,264,868.00	0.09
285	688223	晶科能源	435,790	2,261,750.10	0.09
286	300024	机器人	131,300	2,255,734.00	0.09
287	002353	杰瑞股份	64,400	2,254,000.00	0.09
288	601799	星宇股份	18,000	2,250,000.00	0.09
289	002008	大族激光	92,200	2,246,914.00	0.09
290	600845	宝信软件	94,900	2,241,538.00	0.09
291	000999	华润三九	71,440	2,234,643.20	0.09
292	600549	厦门钨业	106,300	2,223,796.00	0.09
293	300383	光环新网	155,300	2,220,790.00	0.09
294	002595	豪迈科技	37,500	2,220,750.00	0.09

295	002223	鱼跃医疗	62,300	2,217,880.00	0.09
296	002405	四维图新	259,200	2,213,568.00	0.09
297	002155	湖南黄金	123,900	2,211,615.00	0.09
298	601872	招商轮船	352,700	2,207,902.00	0.09
299	002624	完美世界	145,500	2,207,235.00	0.09
300	002821	凯莱英	25,000	2,206,250.00	0.09
301	000034	神州数码	58,600	2,205,704.00	0.09
302	300012	华测检测	186,300	2,177,847.00	0.09
303	600515	海南机场	612,400	2,167,896.00	0.09
304	600895	张江高科	84,200	2,163,940.00	0.09
305	002271	东方雨虹	201,300	2,159,949.00	0.09
306	603392	万泰生物	35,100	2,141,100.00	0.09
307	603596	伯特利	40,600	2,139,214.00	0.09
308	300459	汤姆猫	378,100	2,117,360.00	0.08
309	002459	晶澳科技	211,500	2,110,770.00	0.08
310	300253	卫宁健康	197,200	2,090,320.00	0.08
311	000426	兴业银锡	130,700	2,065,060.00	0.08
312	300832	新产业	36,400	2,064,608.00	0.08
313	000617	中油资本	278,700	2,034,510.00	0.08
314	300223	北京君正	29,400	2,034,480.00	0.08
315	300395	菲利华	39,800	2,033,780.00	0.08
316	688599	天合光能	139,546	2,027,603.38	0.08
317	605589	圣泉集团	72,400	2,009,100.00	0.08
318	600153	建发股份	193,600	2,007,632.00	0.08
319	603606	东方电缆	38,700	2,001,177.00	0.08
320	000519	中兵红箭	91,200	1,996,368.00	0.08
321	601216	君正集团	361,400	1,994,928.00	0.08
322	600332	白云山	75,400	1,987,544.00	0.08
323	600392	盛和资源	150,700	1,984,719.00	0.08
324	601233	桐昆股份	186,600	1,977,960.00	0.08
325	300627	华测导航	56,343	1,972,005.00	0.08
326	002444	巨星科技	77,200	1,969,372.00	0.08
327	000932	华菱钢铁	447,200	1,967,680.00	0.08
328	002007	华兰生物	125,100	1,960,317.00	0.08
329	600803	新奥股份	103,600	1,958,040.00	0.08
330	002409	雅克科技	35,800	1,957,902.00	0.08
331	600699	均胜电子	111,600	1,946,304.00	0.08
332	002414	高德红外	189,600	1,943,400.00	0.08
333	300142	沃森生物	175,500	1,930,500.00	0.08
334	300699	光威复材	60,700	1,922,369.00	0.08
335	300003	乐普医疗	139,000	1,915,420.00	0.08
336	300496	中科创达	33,400	1,911,148.00	0.08
337	300604	长川科技	42,500	1,908,675.00	0.08

338	002389	航天彩虹	74,500	1,907,200.00	0.08
339	300757	罗博特科	12,700	1,904,619.00	0.08
340	000878	云南铜业	149,600	1,902,912.00	0.08
341	300001	特锐德	79,300	1,900,821.00	0.08
342	688188	柏楚电子	14,412	1,897,483.92	0.08
343	300724	捷佳伟创	34,800	1,889,640.00	0.08
344	600521	华海药业	101,000	1,881,630.00	0.08
345	300316	晶盛机电	69,300	1,881,495.00	0.08
346	300037	新宙邦	52,900	1,862,080.00	0.07
347	600563	法拉电子	16,900	1,843,621.00	0.07
348	600398	海澜之家	264,500	1,840,920.00	0.07
349	600177	雅戈尔	251,000	1,832,300.00	0.07
350	300558	贝达药业	31,600	1,831,220.00	0.07
351	000623	吉林敖东	107,200	1,817,040.00	0.07
352	300568	星源材质	143,000	1,813,240.00	0.07
353	000733	振华科技	36,200	1,811,810.00	0.07
354	600765	中航重机	106,100	1,790,968.00	0.07
355	601238	广汽集团	238,900	1,789,361.00	0.07
356	600486	扬农化工	30,650	1,777,700.00	0.07
357	600704	物产中大	337,300	1,777,571.00	0.07
358	000738	航发控制	85,600	1,776,200.00	0.07
359	300413	芒果超媒	81,400	1,776,148.00	0.07
360	000009	中国宝安	199,400	1,770,672.00	0.07
361	300628	亿联网络	50,900	1,769,284.00	0.07
362	002025	航天电器	34,400	1,768,504.00	0.07
363	600118	中国卫星	61,700	1,762,769.00	0.07
364	600497	驰宏锌锗	332,600	1,759,454.00	0.07
365	603087	甘李药业	32,100	1,758,438.00	0.07
366	300315	掌趣科技	289,200	1,755,444.00	0.07
367	002044	美年健康	340,900	1,752,226.00	0.07
368	002812	恩捷股份	59,800	1,751,542.00	0.07
369	002152	广电运通	130,200	1,749,888.00	0.07
370	600141	兴发集团	84,000	1,724,520.00	0.07
371	300763	锦浪科技	30,000	1,721,700.00	0.07
372	002318	久立特材	73,300	1,714,487.00	0.07
373	000960	锡业股份	111,300	1,702,890.00	0.07
374	600018	上港集团	296,800	1,694,728.00	0.07
375	601567	三星医疗	75,200	1,685,984.00	0.07
376	603486	科沃斯	28,900	1,682,847.00	0.07
377	000400	许继电气	76,700	1,669,759.00	0.07
378	300073	当升科技	37,600	1,649,512.00	0.07
379	601607	上海医药	91,300	1,632,444.00	0.07
380	300088	长信科技	273,300	1,628,868.00	0.07

381	601677	明泰铝业	131,000	1,627,020.00	0.06
382	000039	中集集团	206,300	1,621,518.00	0.06
383	002607	中公教育	528,100	1,615,986.00	0.06
384	600637	东方明珠	215,100	1,606,797.00	0.06
385	300068	南都电源	100,400	1,598,368.00	0.06
386	600498	烽火通信	75,900	1,596,177.00	0.06
387	300676	华大基因	31,600	1,572,732.00	0.06
388	603979	金诚信	33,800	1,569,672.00	0.06
389	601018	宁波港	427,200	1,563,552.00	0.06
390	600529	山东药玻	70,400	1,558,656.00	0.06
391	300182	捷成股份	282,600	1,557,126.00	0.06
392	603939	益丰药房	63,500	1,553,845.00	0.06
393	600316	洪都航空	41,100	1,549,470.00	0.06
394	600026	中远海能	149,400	1,543,302.00	0.06
395	002739	万达电影	133,800	1,529,334.00	0.06
396	002245	蔚蓝锂芯	119,000	1,526,770.00	0.06
397	300919	中伟股份	46,400	1,525,632.00	0.06
398	603806	福斯特	117,700	1,525,392.00	0.06
399	000887	中鼎股份	86,200	1,516,258.00	0.06
400	600038	中直股份	39,000	1,513,590.00	0.06
401	002407	多氟多	124,100	1,512,779.00	0.06
402	300285	国瓷材料	86,800	1,505,980.00	0.06
403	603260	合盛硅业	31,600	1,497,840.00	0.06
404	300567	精测电子	24,700	1,497,067.00	0.06
405	688009	中国通号	288,070	1,480,679.80	0.06
406	300144	宋城演艺	171,700	1,468,035.00	0.06
407	688303	大全能源	68,359	1,457,413.88	0.06
408	600820	隧道股份	238,400	1,454,240.00	0.06
409	300296	利亚德	236,000	1,439,600.00	0.06
410	600008	首创环保	474,000	1,431,480.00	0.06
411	600998	九州通	276,800	1,422,752.00	0.06
412	688005	容百科技	63,489	1,417,074.48	0.06
413	600516	方大炭素	303,700	1,409,168.00	0.06
414	002064	华峰化学	212,700	1,405,947.00	0.06
415	600166	福田汽车	515,300	1,396,463.00	0.06
416	603568	伟明环保	73,000	1,392,840.00	0.06
417	000683	博源化工	290,400	1,391,016.00	0.06
418	600170	上海建工	580,400	1,387,156.00	0.06
419	600763	通策医疗	33,440	1,380,403.20	0.06
420	002176	江特电机	190,100	1,380,126.00	0.06
421	601155	新城控股	100,300	1,372,104.00	0.05
422	600312	平高电气	89,000	1,369,710.00	0.05
423	301358	湖南裕能	43,900	1,369,241.00	0.05

424	002841	视源股份	39,400	1,363,240.00	0.05
425	600208	衢州发展	457,200	1,353,312.00	0.05
426	002497	雅化集团	118,500	1,350,900.00	0.05
427	000708	中信特钢	114,500	1,346,520.00	0.05
428	002312	川发龙蟒	115,800	1,329,384.00	0.05
429	601179	中国西电	216,500	1,329,310.00	0.05
430	603885	吉祥航空	97,100	1,307,937.00	0.05
431	601000	唐山港	321,500	1,305,290.00	0.05
432	603833	欧派家居	23,100	1,303,995.00	0.05
433	000629	钒钛股份	508,500	1,301,760.00	0.05
434	002603	以岭药业	91,700	1,292,970.00	0.05
435	002432	九安医疗	35,201	1,282,372.43	0.05
436	002244	滨江集团	129,800	1,265,550.00	0.05
437	002439	启明星辰	79,000	1,263,210.00	0.05
438	605358	立昂微	53,900	1,255,870.00	0.05
439	600535	天士力	80,100	1,253,565.00	0.05
440	603816	顾家家居	48,600	1,240,272.00	0.05
441	300751	迈为股份	17,600	1,224,256.00	0.05
442	601880	辽港股份	814,700	1,222,050.00	0.05
443	000830	鲁西化工	117,200	1,207,160.00	0.05
444	000563	陕国投A	336,000	1,199,520.00	0.05
445	000818	航锦科技	53,200	1,197,000.00	0.05
446	600323	瀚蓝环境	49,000	1,193,150.00	0.05
447	603613	国联股份	50,100	1,186,869.00	0.05
448	600859	王府井	85,300	1,184,817.00	0.05
449	002145	中核钛白	285,100	1,183,165.00	0.05
450	603077	和邦生物	675,400	1,181,950.00	0.05
451	600499	科达制造	119,100	1,167,180.00	0.05
452	000998	隆平高科	117,200	1,154,420.00	0.05
453	600325	华发股份	236,600	1,152,242.00	0.05
454	600655	豫园股份	207,600	1,152,180.00	0.05
455	300390	天华新能	60,200	1,148,014.00	0.05
456	603000	人民网	56,600	1,143,886.00	0.05
457	601966	玲珑轮胎	77,900	1,142,793.00	0.05
458	000547	航天发展	134,200	1,127,280.00	0.04
459	600131	国网信通	63,400	1,122,180.00	0.04
460	300573	兴齐眼药	21,460	1,111,413.40	0.04
461	600004	白云机场	121,500	1,105,650.00	0.04
462	002756	永兴材料	34,600	1,098,550.00	0.04
463	601866	中远海发	432,500	1,068,275.00	0.04
464	300601	康泰生物	70,300	1,067,857.00	0.04
465	300070	碧水源	234,200	1,053,900.00	0.04
466	600667	太极实业	159,900	1,052,142.00	0.04

467	002120	韵达股份	154,700	1,036,490.00	0.04
468	600754	锦江酒店	45,200	1,014,288.00	0.04
469	300529	健帆生物	46,900	1,011,633.00	0.04
470	600867	通化东宝	121,900	999,580.00	0.04
471	600258	首旅酒店	70,700	998,991.00	0.04
472	000069	华侨城 A	443,600	998,100.00	0.04
473	600511	国药股份	34,100	994,356.00	0.04
474	300118	东方日升	102,700	983,866.00	0.04
475	603650	彤程新材	30,500	980,575.00	0.04
476	603899	晨光股份	33,600	974,064.00	0.04
477	688063	派能科技	21,503	969,355.24	0.04
478	002292	奥飞娱乐	99,000	962,280.00	0.04
479	300769	德方纳米	28,400	937,768.00	0.04
480	000967	盈峰环境	134,800	936,860.00	0.04
481	688390	固德威	21,450	932,002.50	0.04
482	000032	深桑达 A	44,600	902,258.00	0.04
483	002266	浙富控股	292,900	902,132.00	0.04
484	002508	老板电器	47,000	893,470.00	0.04
485	601636	旗滨集团	177,800	890,778.00	0.04
486	002544	普天科技	37,800	886,410.00	0.04
487	300438	鹏辉能源	31,500	869,715.00	0.03
488	002572	索菲亚	60,200	843,402.00	0.03
489	000035	中国天楹	195,600	839,124.00	0.03
490	300457	赢合科技	35,300	811,900.00	0.03
491	002091	江苏国泰	110,600	804,062.00	0.03
492	002831	裕同科技	34,200	800,964.00	0.03
493	600129	太极集团	36,500	777,815.00	0.03
494	600864	哈投股份	128,100	764,757.00	0.03
495	600315	上海家化	35,700	752,199.00	0.03
496	002372	伟星新材	67,600	700,336.00	0.03
497	600007	中国国贸	24,700	508,326.00	0.02
498	001914	招商积余	40,400	499,748.00	0.02
499	600335	国机汽车	63,700	410,865.00	0.02
500	301381	赛维时代	15,700	313,215.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	57,373,466.00	1.11

2	600036	招商银行	17,938,349.40	0.35
3	601318	中国平安	17,252,728.00	0.33
4	688041	海光信息	15,861,792.70	0.31
5	601166	兴业银行	15,008,238.00	0.29
6	300750	宁德时代	12,075,236.60	0.23
7	600900	长江电力	11,123,711.00	0.22
8	688981	中芯国际	8,955,112.43	0.17
9	601899	紫金矿业	8,832,804.00	0.17
10	601328	交通银行	8,799,257.06	0.17
11	600030	中信证券	8,456,804.70	0.16
12	601398	工商银行	7,908,344.00	0.15
13	688777	中控技术	7,500,062.27	0.15
14	600309	万华化学	7,122,526.00	0.14
15	600276	恒瑞医药	6,811,662.76	0.13
16	002371	北方华创	6,173,608.00	0.12
17	688008	澜起科技	6,090,897.60	0.12
18	600887	伊利股份	5,743,618.00	0.11
19	601288	农业银行	5,549,349.00	0.11
20	601816	京沪高铁	5,487,714.00	0.11

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	600519	贵州茅台	174,219,489.23	3.37
2	601318	中国平安	83,210,217.51	1.61
3	600036	招商银行	80,269,997.61	1.55
4	600900	长江电力	52,539,957.00	1.02
5	601166	兴业银行	46,424,328.97	0.90
6	601899	紫金矿业	42,767,206.50	0.83
7	600030	中信证券	40,173,114.48	0.78
8	601398	工商银行	36,861,629.00	0.71
9	688041	海光信息	34,016,611.61	0.66
10	688981	中芯国际	32,407,594.65	0.63
11	600276	恒瑞医药	31,866,479.88	0.62
12	601328	交通银行	26,815,215.00	0.52
13	600887	伊利股份	26,784,641.00	0.52
14	601288	农业银行	25,594,152.00	0.50
15	601816	京沪高铁	25,437,986.00	0.49
16	600919	江苏银行	22,738,000.00	0.44
17	600309	万华化学	22,715,325.53	0.44
18	601988	中国银行	22,362,456.00	0.43
19	603259	药明康德	22,060,782.00	0.43

20	600000	浦发银行	19,654,094.92	0.38

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	739,794,789.44
卖出股票收入（成交）总额	2,239,302,297.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	55,303.64	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,303.64	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	553	55,303.64	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的	持有人结构

（户）	基金份额	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（%）
3,761	653,852.81	2,221,694,720.00	90.34	237,445,704.00	9.66

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
招商银行股份有限公司－华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金联接基金	1,431,585,300.00	58.21

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国人寿保险股份有限公司	392,217,916.00	15.95
2	中国平安人寿保险股份有限公司－寿险传统低－自主	243,519,944.00	9.90
3	中国人寿再保险有限责任公司	28,734,200.00	1.17
4	中信建投证券股份有限公司	18,059,029.00	0.73
5	国信证券股份有限公司	17,810,775.00	0.72
6	华泰证券股份有限公司	16,150,073.00	0.66
7	华龙证券股份有限公司	11,232,820.00	0.46
8	方正证券股份有限公司	10,198,281.00	0.41
9	廖雪静	10,000,680.00	0.41
10	张会婷	9,800,485.00	0.40
11	招商银行股份有限公司－华安中证 A500 指数型发起式证券投资基金联接基金	1,431,585,300.00	58.21

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 11 月 19 日）基金份额总额	2,000,140,424.00
本报告期期初基金份额总额	5,150,140,424.00
本报告期基金总申购份额	693,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,384,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,459,140,424.00

§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(%)	
国信证券	4	2,979,097,086.67	100.00	553,843.24	100.00	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

（1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；

（2）提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；

（3）交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

（1）候选证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

（2）候选证券公司的准入评估

对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

（3）候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

（4）协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：国信证券。

撤销交易单元的证券公司：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国信证券	1,231,246.16	100.00	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 8 日
2	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东北证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 17 日
3	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 17 日
4	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联民生证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 27 日
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
6	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
7	华安基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
8	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
9	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025 年 4 月 22 日

		站	
10	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 16 日
11	华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 28 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	20250101~20250630	1,775,000,000.00	116,629,100.00	460,043,800.00	1,431,585,300.00	58.21
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

2、《华安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安中证 A500 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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 http://www.huaan.com.cn。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所

免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日