华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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 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 11
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
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 41
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 41
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 41

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 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.3 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 43
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 44
10.8 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 47
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 47
§12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深证 100ETF 华安
场内简称	深证 100ETF 华安
基金主代码	159706
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 9 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,386,800.00 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	2021 年 12 月 20 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。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资策略	1、组合复制策略 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
业绩比较基准	深证 100 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66596688
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	徐勇	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	6,140,492.87
本期利润	8,990,550.29
加权平均基金份额本期利润	0.1677
本期加权平均净值利润率	17.76%
本期基金份额净值增长率	19.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-10,358,808.71
期末可供分配基金份额利润	-0.2282
期末基金资产净值	48,353,556.01
期末基金份额净值	1.0654
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.54%

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）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	21.47%	1.69%	21.31%	1.71%	0.16%	-0.02%
过去六个月	19.43%	1.43%	19.19%	1.46%	0.24%	-0.03%
过去一年	53.41%	1.34%	52.60%	1.37%	0.81%	-0.03%
过去三年	46.97%	1.42%	40.51%	1.45%	6.46%	-0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.54%	1.38%	-0.49%	1.41%	7.03%	-0.03%

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



§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、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份

有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金 ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等 303 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,198.27 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		
周泓灏	本基金的基金经理	2026 年 4 月 7 日	-	5 年	硕士研究生，5 年基金行业从业经验，2020 年 7 月应届毕业加入华安基金，历任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2026 年 3 月起，担任华安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起，同时担任华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、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。
刘璇子	本基金的基金经理	2021 年 12 月 9 日	2026 年 4 月 7 日	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经验。2014 年 7 月应届毕业加入华安基金，曾任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020 年 11 月至 2023 年 2 月，同时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。2023 年 2 月至 2026 年 4 月，同时担任华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金（由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转型而来）的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安创业板 50 指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起，同时担任华安 CES 半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月至 2024 年 9 月，同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

					发起式联接基金（由华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金转型而来）的基金经理。2021 年 12 月至 2026 年 4 月，同时担任华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月至 2024 年 12 月，同时担任华安中证内地新能源主题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，同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 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。2022 年 9 月起，同时担任华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月至 2025 年 10 月，同时担任华安中证上海环交所碳中和指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月至 2025 年 11 月，同时担任华安中证基建指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安上证科创板芯片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 3 月起，同时担任华安国证机器人产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 7 月至 2026 年 4 月，同时担任华安深证 100 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 10 月起，同时担任华安中证信息技术应用创新产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 3 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、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。2025 年 7 月起，同时担任华安国证航天航空行业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起，同时担任华安创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起，同时担任华安国证航天航空行业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。2026 年 6 月起，同时担任华安国证机器人产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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

行业协会《证券基金经营机构董事、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

上半年国内经济温和修复，外部地缘冲击明显缓和。经济亮点集中在出口和科技制造方向，外需保持强劲韧性，出口链表现亮眼；高技术制造业等“新质生产力”加速成长，有效对冲传统动能变化，经济结构持续优化。随着油价扰动逐步退潮，消费与基建投资数据也有所企稳。

市场表现方面，景气度成为资金的重点关注视角。上半年呈现结构性分化，通信、电子等科技板块表现突出，资金聚焦 AI 产业链与国产替代主线，带动宽基指数稳步上行。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0654 元，本报告期份额净值增长率为 19.43%，同期业绩比较基准增长率为 19.19%。

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，国内宏观政策预计将继续保持积极有为，扩大内需、稳定增长与推动高质量发展仍是政策重点，科技创新和新质生产力有望成为经济结构转型的重要驱动力。随着各项稳增长政策逐步落地，国内经济有望延续平稳修复态势。

我们认为，下半年的权益资产配置主线一方面将围绕内需修复及行业供需格局改善等方向展开，关注基本面改善带来的盈利修复机会；另一方面仍将高度关注新质生产力方向，人工智能、半导体、高端制造、创新药等产业趋势有望持续演进。深证 100 指数囊括了深市市场的优质核心资产，是新经济蓝筹的代表，在内需修复及科技创新发展的前景下，具备较好的投资配置价值。

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，本基金已出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形，报告期内的具体时间范围如下：

2026 年 5 月 14 日-2026 年 6 月 30 日。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	702,514.60	1,545,883.34
结算备付金		1,989.84	-
存出保证金		691.74	177.07
交易性金融资产	6.4.7.2	47,875,662.48	50,203,423.20
其中：股票投资		47,875,662.48	50,203,423.20
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	-	-
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		-	-
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		48,580,858.66	51,749,483.61

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		168,100.51	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,592.90	6,556.18
应付托管费		1,864.28	2,185.40
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	51,744.96	101,172.17
负债合计		227,302.65	109,913.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	45,386,800.00	57,886,800.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,966,756.01	-6,247,230.14
净资产合计		48,353,556.01	51,639,569.86
负债和净资产总计		48,580,858.66	51,749,483.61

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0654 元，基金份额总额 45,386,800.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,090,476.86	-626,475.80
1.利息收入		2,038.29	2,496.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,038.29	2,496.24
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“-”		6,238,872.12	-504,967.47

填列）			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,816,460.87	-1,191,103.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	3,735.02
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	422,411.25	682,401.37
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	2,850,057.42	-124,082.35
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	-490.97	77.78
减：二、营业总支出		99,926.57	103,822.16
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	37,689.76	40,603.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	12,563.24	13,534.63
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		-	-
8．其他费用	6.4.7.17	49,673.57	49,683.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,990,550.29	-730,297.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,990,550.29	-730,297.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,990,550.29	-730,297.96

6.3 净资产变动表

会计主体：华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	57,886,800.00	-	-6,247,230.14	51,639,569.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	57,886,800.00	-	-6,247,230.14	51,639,569.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,500,000.00	-	9,213,986.15	-3,286,013.85
（一）、综合收益总额	-	-	8,990,550.29	8,990,550.29
（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）	-12,500,000.00	-	223,435.86	-12,276,564.14
其中：1.基金申购款	12,500,000.00	-	-164,527.83	12,335,472.17
2.基金赎回款	-25,000,000.00	-	387,963.69	-24,612,036.31
（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	45,386,800.00	-	2,966,756.01	48,353,556.01
项目	上年度可比期间 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	85,386,800.00	-	-25,265,625.99	60,121,174.01

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,386,800.00	-	-25,265,625.99	60,121,174.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,000,000.00	-	2,237,223.91	-7,762,776.09
（一）、综合收益总额	-	-	-730,297.96	-730,297.96
（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）	-10,000,000.00	-	2,967,521.87	-7,032,478.13
其中：1.基金申购款	7,500,000.00	-	-2,385,882.79	5,114,117.21
2.基金赎回款	-17,500,000.00	-	5,353,404.66	-12,146,595.34
（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	75,386,800.00	-	-23,028,402.08	52,358,397.92

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：

徐勇	任志浩	童欣
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

华安深证 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[2021]706 号文《关于准予华安深证 100 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向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 12 月 9 日正式生效，首次设立募集规模为 295,386,800.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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。

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：深证 100 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募

集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运

用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.6.3　城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4　企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

6.4.6.5　个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	702,514.60
等于：本金	702,458.82
加：应计利息	55.78
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	702,514.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		36,467,231.29	-	47,875,662.48	11,408,431.19
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		36,467,231.29	-	47,875,662.48	11,408,431.19

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 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,156.39
其中：交易所市场	2,156.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	9,916.99
预提信息披露费	39,671.58
合计	51,744.96

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,886,800.00	57,886,800.00
本期申购	12,500,000.00	12,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,000,000.00	-25,000,000.00

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	45,386,800.00	45,386,800.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,543,919.59	14,296,689.45	-6,247,230.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-20,543,919.59	14,296,689.45	-6,247,230.14
本期利润	6,140,492.87	2,850,057.42	8,990,550.29
本期基金份额交易产生的变动数	4,044,618.01	-3,821,182.15	223,435.86
其中：基金申购款	-3,691,971.78	3,527,443.95	-164,527.83
基金赎回款	7,736,589.79	-7,348,626.10	387,963.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,358,808.71	13,325,564.72	2,966,756.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,026.48
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	11.28
其他	0.53
合计	2,038.29

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	497,671.62
股票投资收益——赎回差价收入	5,318,789.25
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	5,816,460.87

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,415,984.62
减：卖出股票成本总额	3,913,242.19
减：交易费用	5,070.81
买卖股票差价收入	497,671.62

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	24,612,036.31
减：现金支付赎回款总额	-349,494.69
减：赎回股票成本总额	19,642,741.75
减：交易费用	-
赎回差价收入	5,318,789.25

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	422,411.25
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	422,411.25

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	2,850,057.42
股票投资	2,850,057.42
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	2,850,057.42

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-490.97
合计	-490.97

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	85.00
合计	49,673.57

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、关联关系

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”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
华安深证 100 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：（1）关联方国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通”）是由原国泰君安证券股份有限公司与原海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日合并组建而成。

（2）下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰海通证券股份有限公司	6,993,372.62	63.51	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
国泰海通证券股份有限公司	1,369.62	63.51	1,369.62	63.51
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
-	-	-	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 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	37,689.76	40,603.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,874.74	6,711.32
应支付基金管理人的净管理费	32,815.02	33,892.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 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	12,563.24	13,534.63

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.05%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2026年6月30日	上年度末 2025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（%）
中国银行股份有限公司－华安深证100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	16,549,700.00	36.46	17,132,200.00	29.60

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国银行	702,514.60	2,026.48	1,150,747.25	2,490.10

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（2026 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

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、审计委员会、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。

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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	702,514.60	-	-	-	702,514.60
结算备付金	1,989.84	-	-	-	1,989.84
存出保证金	691.74	-	-	-	691.74
交易性金融资产	-	-	-	47,875,662.48	47,875,662.48
资产总计	705,196.18	-	-	47,875,662.48	48,580,858.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,592.90	5,592.90
应付托管费	-	-	-	1,864.28	1,864.28
应付清算款	-	-	-	168,100.51	168,100.51
其他负债	-	-	-	51,744.96	51,744.96
负债总计	-	-	-	227,302.65	227,302.65
利率敏感度缺口	705,196.18	-	-	47,648,359.83	48,353,556.01
上年度末 2025 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	1,545,883.34	-	-	-	1,545,883.34
存出保证金	177.07	-	-	-	177.07
交易性金融资产	-	-	-	50,203,423.20	50,203,423.20
资产总计	1,546,060.41	-	-	50,203,423.20	51,749,483.61
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,556.18	6,556.18

应付托管费	-	-	-	2,185.40	2,185.40
其他负债	-	-	-	101,172.17	101,172.17
负债总计	-	-	-	109,913.75	109,913.75
利率敏感度缺口	1,546,060.41	-	-	50,093,509.45	51,639,569.86

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采取完全复制法，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。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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025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	47,875,662.48	99.01	50,203,423.20	97.22
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	47,875,662.48	99.01	50,203,423.20	97.22

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	2,372,798.17	2,516,041.83
	业绩比较基准下降5%	-2,372,798.17	-2,516,041.83

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	47,875,662.48	49,902,369.00
第二层次	-	301,054.20
第三层次	-	-
合计	47,875,662.48	50,203,423.20

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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2026年08月26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	47,875,662.48	98.55
	其中：股票	47,875,662.48	98.55
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	704,504.44	1.45
8	其他各项资产	691.74	0.00
9	合计	48,580,858.66	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	677,268.00	1.40
B	采矿业	172,490.00	0.36
C	制造业	41,658,972.64	86.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,633.00	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	92,796.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	447,284.00	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,215,142.00	2.51
J	金融业	2,926,390.00	6.05
K	房地产业	181,892.00	0.38
L	租赁和商务服务业	213,444.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	161,350.84	0.33

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,875,662.48	99.01

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	300308	中际旭创	3,840	4,876,800.00	10.09
2	300750	宁德时代	11,480	4,511,754.80	9.33
3	300502	新易盛	5,428	3,294,796.00	6.81
4	000333	美的集团	21,200	1,601,236.00	3.31
5	002371	北方华创	1,770	1,565,671.20	3.24
6	002475	立讯精密	20,600	1,450,240.00	3.00
7	002384	东山精密	5,500	1,442,925.00	2.98
8	000725	京东方 A	142,300	1,235,164.00	2.55
9	300059	东方财富	56,300	1,147,394.00	2.37
10	300274	阳光电源	6,480	1,030,449.60	2.13
11	300476	胜宏科技	2,700	935,361.00	1.93
12	300408	三环集团	5,500	917,950.00	1.90
13	002463	沪电股份	6,000	916,800.00	1.90
14	002594	比亚迪	11,100	884,670.00	1.83
15	300394	天孚通信	2,728	825,711.04	1.71
16	000651	格力电器	18,800	705,000.00	1.46
17	301308	江波龙	1,000	703,800.00	1.46
18	000988	华工科技	3,700	683,057.00	1.41
19	000338	潍柴动力	22,100	602,225.00	1.25
20	000858	五粮液	7,900	584,600.00	1.21
21	300124	汇川技术	8,800	583,704.00	1.21
22	002415	海康威视	16,200	554,040.00	1.15
23	000063	中兴通讯	13,900	503,041.00	1.04
24	002916	深南电路	1,090	499,111.00	1.03
25	000100	TCL 科技	83,900	488,298.00	1.01
26	300433	蓝思科技	8,500	456,110.00	0.94
27	002142	宁波银行	14,900	442,381.00	0.91
28	000792	盐湖股份	14,500	437,755.00	0.91

29	002028	思源电气	2,500	432,500.00	0.89
30	002050	三花智控	9,400	412,002.00	0.85
31	300014	亿纬锂能	6,300	409,689.00	0.85
32	002353	杰瑞股份	2,600	396,500.00	0.82
33	000657	中钨高新	4,100	392,452.00	0.81
34	002714	牧原股份	10,800	377,892.00	0.78
35	000001	平安银行	37,000	371,850.00	0.77
36	300760	迈瑞医疗	2,700	366,741.00	0.76
37	002602	世纪华通	25,100	353,910.00	0.73
38	002230	科大讯飞	8,500	347,140.00	0.72
39	002352	顺丰控股	10,500	328,230.00	0.68
40	002460	赣锋锂业	4,900	320,460.00	0.66
41	000977	浪潮信息	4,500	315,000.00	0.65
42	000776	广发证券	13,200	308,880.00	0.64
43	002709	天赐材料	6,000	308,580.00	0.64
44	002938	鹏鼎控股	2,900	305,602.00	0.63
45	300498	温氏股份	24,300	299,376.00	0.62
46	300033	同花顺	1,240	298,840.00	0.62
47	000425	徐工机械	36,900	298,521.00	0.62
48	002466	天齐锂业	4,500	275,940.00	0.57
49	000938	紫光股份	9,300	268,398.00	0.56
50	002049	紫光国微	2,920	259,150.00	0.54
51	000568	泸州老窖	3,300	255,816.00	0.53
52	002837	英维克	3,200	254,592.00	0.53
53	300442	润泽科技	3,000	249,210.00	0.52
54	002241	歌尔股份	11,000	247,830.00	0.51
55	002600	领益智造	13,900	241,026.00	0.50
56	002179	中航光电	5,016	231,739.20	0.48
57	000408	藏格矿业	3,200	221,824.00	0.46
58	002027	分众传媒	44,100	213,444.00	0.44
59	002625	光启技术	7,000	212,240.00	0.44
60	000630	铜陵有色	33,100	210,516.00	0.44
61	000807	云铝股份	9,100	201,474.00	0.42
62	002001	新和成	6,780	192,687.60	0.40
63	002422	科伦药业	5,000	192,600.00	0.40
64	002648	卫星化学	7,600	178,524.00	0.37
65	300015	爱尔眼科	19,534	161,350.84	0.33
66	000166	申万宏源	36,600	161,040.00	0.33
67	300418	昆仑万维	3,900	157,404.00	0.33
68	000538	云南白药	3,240	153,478.80	0.32
69	000625	长安汽车	20,930	150,068.10	0.31
70	000157	中联重科	21,300	148,461.00	0.31
71	002311	海大集团	3,300	147,213.00	0.30

72	002236	大华股份	8,300	136,867.00	0.28
73	000975	山金国际	7,400	125,800.00	0.26
74	002493	荣盛石化	11,400	122,550.00	0.25
75	002736	国信证券	12,100	120,879.00	0.25
76	003816	中国广核	30,500	119,255.00	0.25
77	000768	中航西飞	5,700	116,736.00	0.24
78	002601	龙佰集团	6,900	113,712.00	0.24
79	000301	东方盛虹	9,600	109,920.00	0.23
80	301269	华大九天	900	107,478.00	0.22
81	002920	德赛西威	1,300	105,950.00	0.22
82	000895	双汇发展	4,700	105,280.00	0.22
83	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.22
84	002304	洋河股份	2,600	99,190.00	0.21
85	001979	招商蛇口	14,800	95,164.00	0.20
86	000963	华东医药	3,300	92,796.00	0.19
87	000002	万科 A	29,300	86,728.00	0.18
88	000617	中油资本	11,400	75,126.00	0.16
89	001965	招商公路	8,200	75,112.00	0.16
90	302132	中航成飞	1,200	69,984.00	0.14
91	000999	华润三九	2,770	62,297.30	0.13
92	300999	金龙鱼	2,500	58,150.00	0.12
93	000596	古井贡酒	600	47,880.00	0.10
94	000708	中信特钢	3,700	46,694.00	0.10
95	001280	中国铀业	700	46,690.00	0.10
96	300765	石药创新	1,600	43,568.00	0.09
97	001391	国货航	6,500	26,455.00	0.05
98	300979	华利集团	800	23,800.00	0.05
99	001872	招商港口	900	17,487.00	0.04
100	001289	龙源电力	600	9,378.00	0.02

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

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	000988	华工科技	530,395.00	1.03
2	301308	江波龙	528,654.00	1.02
3	002353	杰瑞股份	390,692.00	0.76
4	300750	宁德时代	377,396.00	0.73
5	002602	世纪华通	351,307.00	0.68
6	000657	中钨高新	340,243.00	0.66

7	300308	中际旭创	297,191.00	0.58
8	002709	天赐材料	284,953.00	0.55
9	000807	云铝股份	245,207.00	0.47
10	000630	铜陵有色	235,484.00	0.46
11	002475	立讯精密	215,279.00	0.42
12	002837	英维克	213,594.00	0.41
13	000333	美的集团	156,685.00	0.30
14	002463	沪电股份	122,048.00	0.24
15	300502	新易盛	116,256.00	0.23
16	300476	胜宏科技	99,761.00	0.19
17	002384	东山精密	84,593.00	0.16
18	002916	深南电路	84,175.00	0.16
19	300014	亿纬锂能	74,735.00	0.14
20	000651	格力电器	69,060.00	0.13

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	300308	中际旭创	423,436.00	0.82
2	300502	新易盛	360,612.00	0.70
3	300750	宁德时代	336,396.00	0.65
4	002475	立讯精密	193,559.00	0.37
5	300661	圣邦股份	190,045.92	0.37
6	002384	东山精密	164,810.00	0.32
7	000333	美的集团	123,214.00	0.24
8	300394	天孚通信	118,507.00	0.23
9	002252	上海莱士	104,572.00	0.20
10	000786	北新建材	88,198.00	0.17
11	300408	三环集团	87,182.00	0.17
12	000661	长春高新	85,152.00	0.16
13	300896	爱美客	77,901.60	0.15
14	300628	亿联网络	76,412.60	0.15
15	000725	京东方 A	75,200.00	0.15
16	002463	沪电股份	74,178.00	0.14
17	300059	东方财富	72,965.00	0.14
18	301308	江波龙	70,386.00	0.14
19	300832	新产业	69,853.00	0.14
20	300122	智飞生物	62,845.50	0.12

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	6,594,848.80
卖出股票收入（成交）总额	4,415,984.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约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	691.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	691.74

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）	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（%）
582	77,984.19	29,567,700.00	65.15	15,819,100.00	34.85

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（%）
中国银行股份有限公司－华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	16,549,700.00	36.46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

8.3 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（2021 年 12 月 9 日）基金份额总额	295,386,800.00
本报告期期初基金份额总额	57,886,800.00
本报告期基金总申购份额	12,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,386,800.00

§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：

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生离任本基金管理人的总经理，方一天先生新任本基金管理人的总经理。

2026 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，严涛先生新任本基金管理人的首席市场官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国泰海通	4	6,993,372.62	63.51	1,369.62	63.51	-
平安证券	1	4,017,460.80	36.49	786.77	36.49	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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；

（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）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）证券公司的准入评估

对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）证券公司的审批程序

公司领导对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：招商证券（64684）。

撤销交易单元的证券公司：无。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 22 日
3	华安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 1 月 30 日
4	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
5	华安基金管理有限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（2025 年度）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
6	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 3 月 31 日
7	华安深证 100 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和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 4 日
8	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 9 日
9	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 9 日
10	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2026 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和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 22 日
11	华安深证 100 交易型开放式指数证券	中国证监会基金电子披	2026 年 4 月 22 日

	投资基金 2026 年第 1 季度报告	露网站和公司网站等规定媒介	
12	华安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
13	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
14	2025 年度华安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 4 月 30 日
15	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华源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和公司网站等规定媒介	2026 年 6 月 2 日
16	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 6 月 26 日
17	华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第 2 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2026 年 6 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	20260101~20260630	17,132,200.00	787,900.00	1,370,400.00	16,549,700.00	36.46
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、《华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

2、《华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安深证 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深证 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

2026 年 8 月 31 日