

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	81
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3 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	82
§ 10 开放式基金份额变动	83
§ 11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	86
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	88
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	88
§ 13 备查文件目录	88
13.1 备查文件目录	88
13.2 存放地点	88
13.3 查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称	华安中国 A 股增强指数
基金主代码	040002
前端交易代码	040002
后端交易代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,415,635,151.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。为控制因增强型投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金将日均跟踪误差最大容忍值设定为 0.5%。
业绩比较基准	95%*MSCI 中国 A 股指数收益率+5%*金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
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 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	陈四清

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-186,798,486.11	-189,377,791.03	346,496,610.63
本期利润	-162,977,550.49	-376,367,866.92	144,569,832.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1145	-0.2559	0.0749
本期加权平均净值利润率	-14.49%	-29.02%	7.26%
本期基金份额净值增长率	-14.06%	-22.83%	5.58%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	563,953,885.29	737,758,836.79	1,240,482,757.83
期末可供分配基金份额利润	0.3984	0.5138	0.7555

期末基金资产净值	995,331,283.01	1,175,336,317.49	1,740,840,564.87
期末基金份额净值	0.703	0.818	1.060
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	382.61%	461.56%	627.69%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

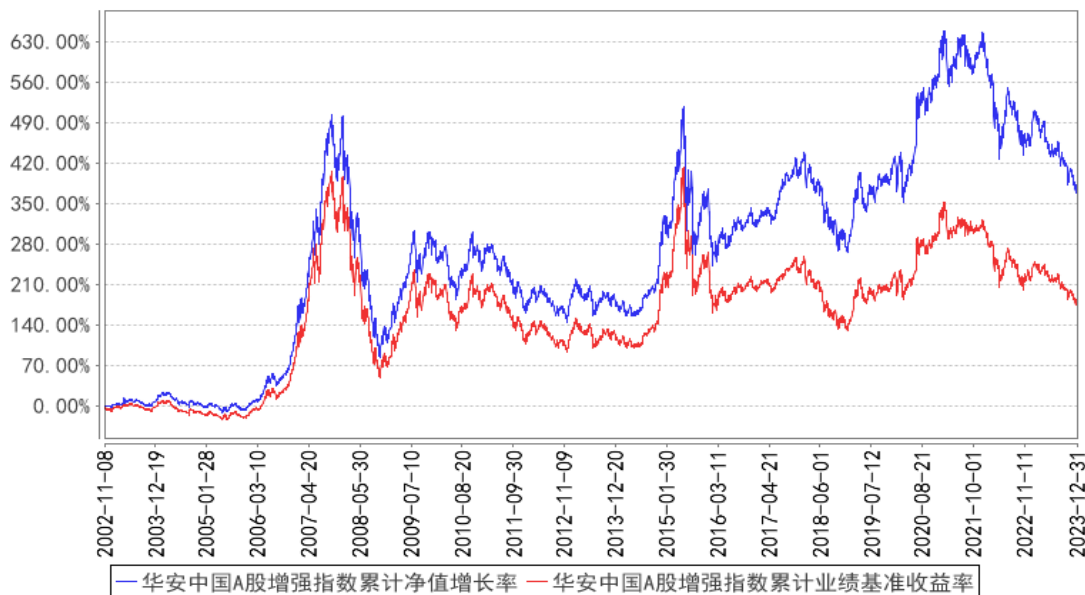
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.13%	0.81%	-5.73%	0.77%	-1.40%	0.04%
过去六个月	-10.45%	0.85%	-10.03%	0.81%	-0.42%	0.04%
过去一年	-14.06%	0.84%	-11.03%	0.79%	-3.03%	0.05%
过去三年	-29.98%	1.15%	-29.53%	1.05%	-0.45%	0.10%
过去五年	30.24%	1.23%	21.06%	1.16%	9.18%	0.07%
自基金合同生效起至今	382.61%	1.51%	184.29%	1.48%	198.32%	0.03%

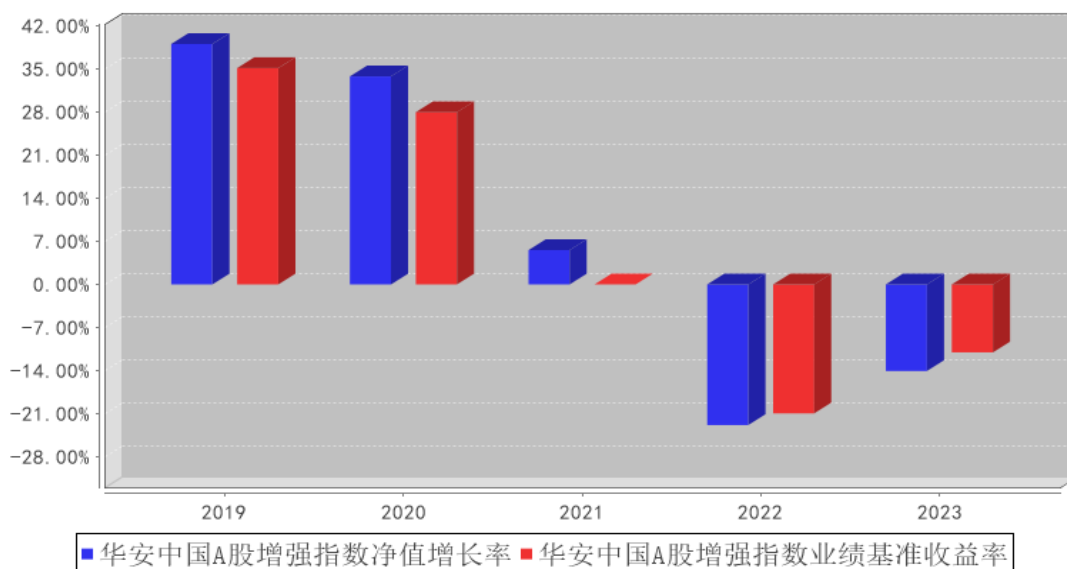
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中国A股增强指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中国A股增强指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是

国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2023 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 248 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,040.77 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	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	2017 年 12 月 25 日	-	20 年	理学博士，20 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

					<p>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月起,同时担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金、华安沪深300量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018年11月起,同时担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年12月起,同时担任华安沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年8月起,同时担任华安沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020年11月起,同时担任华安中证电子50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年10月至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月起,同时担任华安中证电子50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022年12月起,同时担任华安沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
马韬	本基金的基金经理	2018年1月15日	-	9年	<p>硕士研究生,9年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017年2月加入华安基金,历任指数与量化投资部数量分析师。2018年1月起担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021年1月至2023年2月,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022年5月起,同时担任华安中证500指数增强型证券投资基金的基金经理。2022年7月起,同时担任华安中证1000指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
许之彦	公募基金	13	62,725,192,179.47	2008年04月25日
	私募资产管理计划	1	68,101,490.72	2021年1月22日
	其他组合	-	-	-
	合计	14	62,793,293,670.19	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

投资研究部负责宏观、策略、行业以及上市公司的研究，研究员在为公司各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、投资研究会议讨论、研究报告登录在研究报告管理系统中等方式，确保公募基金基金经理与私募资产管理计划投资经理可以公平享有信息获取机会。

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

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

风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对各类投资组合间的同日反向交易、同一基金经理管理的各投资组合间的隔日反向交易、同一基金经理管

理的各投资组合不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的同向交易价差进行检查与分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 8 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

2023 年全年来看，国内宏观环境呈弱复苏态势。市场对经济的疫后强复苏预期逐渐向温和的现实状况回归。地产方面，在下半年出台了系列提振楼市的政策，但整体的政策效果并没有马上显现，地产销售没有明显的起色，长端利率再度下行。货币政策方面，2023 年维持了货币宽松环境，全年 MLF 降低了 25bps，降准两次共 0.5 个百分点。下半年受汇率压力、资金防空转等影响，狭义资金面有所收敛，但整体货币流动性保持在合理充裕状态。

从 2023 年权益市场的表现来看，主要宽基指数均呈现不同程度下跌，其中创业板跌幅明显，微盘股、中证 2000 取得正收益，特别是微盘股指数上涨接近 50%，小微盘风格演绎较为极致。行业板块来看，受 AI 主题催化，传媒、通信、计算机、汽车、电子领涨。从大类风格风格表现来看，“小市值+红利+低波”是全年表现最强的三大类因子，高盈利、高成长则相对弱势。另外，深度学习类的量价因子表现仍然较为稳定，维持了较高的收益及胜率。

策略方面采取适当降低股票持仓集中度，通过扩大选股空间提升小盘因子的权重，力争在获取收益的同时能控制住产品的波动和回撤。本基金配置上整体均衡，坚持配置基本面较好、景气度提升且具有估值性价比的股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.703 元，本报告期份额净值增长率为-14.06%，

同期业绩比较基准增长率为-11.03%。

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 2024 年，国内经济仍将保持温和修复走势。楼市放松政策将持续推进，但地产端复苏效果有待观察。在 12 月底经济工作会议“以进促稳”、“先立后破”等指导方针下，财政政策方面跨周期、适度加力的政策端发力是今年稳经济的重要抓手。货币政策将继续保持稳健，配合财政政策发力。

从 ERP 的指标来看，当前权益资产赔率再次达到历史极值位置，主要大类宽基指数估值均处于历史较低水平，权益资产的配置性价比是比较高的。前期压制市场情绪的一些外生变量，也都有了不同程度的缓和，我们仍然相对看好权益资产的投资机会。

作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作：

在合规风控方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在内审稽核方面，定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、

确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、绝对收益投资部负责人、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配每年至少一次；基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

本报告期基金投资出现净亏损，不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确

和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21176 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理</p>

	<p>人管理层计划清算华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安 MSCI 中国 A 股指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰 楼茜蓉</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 22 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	59,194,773.80	43,214,524.67
结算备付金		5,174,344.83	1,903,828.31
存出保证金		119,320.18	168,522.87
交易性金融资产	7.4.7.2	935,925,635.53	1,134,785,272.71
其中：股票投资		935,925,635.53	1,108,706,355.24
基金投资		-	-
债券投资		-	26,078,917.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		8,800,515.56	431,710.55
应收股利		-	-
应收申购款		233,044.63	374,976.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,009,447,634.53	1,180,878,835.85
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,823,094.76	-
应付赎回款		776,535.33	737,655.94

应付管理人报酬		841,203.40	996,049.94
应付托管费		168,240.69	199,209.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	5,507,277.34	3,609,601.03
负债合计		14,116,351.52	5,542,518.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	431,377,397.72	437,577,480.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	563,953,885.29	737,758,836.79
净资产合计		995,331,283.01	1,175,336,317.49
负债和净资产总计		1,009,447,634.53	1,180,878,835.85

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.703 元，基金份额总额 1,415,635,151.49 份。

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-149,213,193.04	-360,513,486.98
1. 利息收入		272,739.99	145,463.27
其中：存款利息收入	7.4.7.9	272,739.99	145,463.27
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）		-173,316,758.98	-173,678,654.05
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-193,352,736.47	-188,980,166.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	169,843.16	2,177,511.92
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	19,866,134.33	13,124,000.89
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）	7.4.7.14	23,820,935.62	-186,990,075.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	9,890.33	9,779.69
减：二、营业总支出		13,764,357.45	15,854,379.94
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,271,602.20	13,013,196.56
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,254,320.48	2,602,639.36
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1.29	6.82
8. 其他费用	7.4.7.17	238,433.48	238,537.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-162,977,550.49	-376,367,866.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-162,977,550.49	-376,367,866.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-162,977,550.49	-376,367,866.92

7.3 净资产变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,200,082.98	-	173,804,951.50	-180,005,034.48
(一)、综合收益总额	-	-	162,977,550.49	-162,977,550.49
(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)	-6,200,082.98	-	-10,827,401.01	-17,027,483.99
其中：1. 基金申购款	51,214,696.83	-	81,428,499.35	132,643,196.18
2. 基金赎回款	-57,414,779.81	-	-92,255,900.36	-149,670,680.17
(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	431,377,397.72	-	563,953,885.29	995,331,283.01
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	500,357,807.04	-	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	500,357,807.04	-	1,240,482,757.83	1,740,840,564.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-62,780,326.34	-	502,723,921.04	-565,504,247.38
(一)、综合收益总额	-	-	376,367,866.92	-376,367,866.92
(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)	-62,780,326.34	-	126,356,054.12	-189,136,380.46
其中：1. 基金申购款	75,123,379.65	-	142,986,780.00	218,110,159.65
2. 基金赎回款	-	-	-	-407,246,540.11
(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	437,577,480.70	-	737,758,836.79	1,175,336,317.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

基金管理人负责人

朱学华

主管会计工作负责人

陈松一

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增

强型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起，并于 2002 年 11 月 8 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,094,001,258.61 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 126 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金，跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 3.281806547，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)。本基金投资于股票(含存托凭证)的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票(含存托凭证)一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票(含存托凭证)投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率 \times 95%+金融同业存款利率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2024 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	59,194,773.80	43,214,524.67
等于：本金	59,189,095.67	43,210,078.52
加：应计利息	5,678.13	4,446.15
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	59,194,773.80	43,214,524.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		997,734,537.08	-	935,925,635.53	- 61,808,901.55
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		997,734,537.08	-	935,925,635.53	- 61,808,901.55
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,194,283,909.66	-	1,108,706,355.24	- 85,577,554.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,616,643.95	514,556.27	26,078,917.47	-52,282.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	25,616,643.95	514,556.27	26,078,917.47	-52,282.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	1,219,900,553.61	514,556.27	1,134,785,272.71	85,629,837.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,787,277.34	2,889,601.03
其中：交易所市场	4,784,846.15	2,887,169.84
银行间市场	2,431.19	2,431.19
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	5,507,277.34	3,609,601.03

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,435,985,601.62	437,577,480.70
本期申购	168,070,391.28	51,214,696.83
本期赎回（以“-”号填列）	-188,420,841.41	-57,414,779.81
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	1,415,635,151.49	431,377,397.72
-----	------------------	----------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	899,151,209.15	-161,392,372.36	737,758,836.79
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	899,151,209.15	-161,392,372.36	737,758,836.79
本期利润	-186,798,486.11	23,820,935.62	-162,977,550.49
本期基金份额交易产生的变动数	-12,282,381.34	1,454,980.33	-10,827,401.01
其中：基金申购款	101,281,917.92	-19,853,418.57	81,428,499.35
基金赎回款	-113,564,299.26	21,308,398.90	-92,255,900.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	700,070,341.70	-136,116,456.41	563,953,885.29

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	231,111.53	109,385.77
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	38,834.99	32,505.40
其他	2,793.47	3,572.10
合计	272,739.99	145,463.27

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-193,352,736.47	-188,980,166.86
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-193,352,736.47	-188,980,166.86

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,323,903,387.35	2,849,353,963.41
减：卖出股票成本总额	4,505,248,939.62	3,029,876,469.57
减：交易费用	12,007,184.20	8,457,660.70
买卖股票差价收入	-193,352,736.47	-188,980,166.86

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	18,547.91	1,007,515.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	151,295.25	1,169,996.11
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	169,843.16	2,177,511.92

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	27,228,722.60	140,091,403.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,544,243.95	136,329,278.09
减：应计利息总额	533,114.92	2,591,780.73
减：交易费用	68.48	348.19
买卖债券差价收入	151,295.25	1,169,996.11

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	19,866,134.33	13,124,000.89
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	19,866,134.33	13,124,000.89

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	23,820,935.62	-186,990,075.89
股票投资	23,768,652.87	-186,771,393.14
债券投资	52,282.75	-218,682.75
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	23,820,935.62	-186,990,075.89

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	7,550.32	8,607.76
基金转换费收入	2,340.01	1,171.93
合计	9,890.33	9,779.69

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	433.48	537.20
账户维护费	18,000.00	18,000.00

合计	238,433.48	238,537.20
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
国泰君安证券股份有限公司	3,586,580,678.49	41.64	1,969,870,349.07	35.75

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	1,433,077.60	54.38	8,110,061.26	6.80

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	3,359,772.10	41.80	1,540,504.41	32.20
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	1,834,150.30	36.02	1,407,333.14	48.74

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,271,602.20	13,013,196.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,333,773.14	3,605,179.15

应支付基金管理人的净管理费	7,937,829.06	9,408,017.41
---------------	--------------	--------------

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 1.0% 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 × 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,254,320.48	2,602,639.36

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	59,194,773.80	231,111.53	43,214,524.67	109,385.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	601916	浙商银行	老股东配售	30	60.60
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	4,061	154,155.56
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688347	华虹公司	网下申购	39,887	2,074,124.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	9,813	274,764.00
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	12,630	142,087.50
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

国泰君安证券股份有限公司	603170	宝立食品	网下申购	542	5,447.10
国泰君安证券股份有限公司	688459	哈铁科技	网下申购	17,259	235,549.11
国泰君安证券股份有限公司	603182	嘉华股份	网下申购	546	5,760.30
国泰君安证券股份有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813	135,783.09
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759	562,375.50
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368	75,207.44
国泰君安证券股份有限公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920	75,569.60
国泰君安证券股份有限公司	688031	星环科技	网下申购	12,047	573,156.50
国泰君安证券股份有限公司	001238	浙江正特	网下申购	374	6,002.70

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 1,600 股国泰君安证券股份有限公司的普通股，成本总额为人民币 28,565.47 元，估值总额为人民币 23,808.00 元，占基金净资产的比例为 0.002% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 1,600 股国泰君安证券股份有限公司的普通股，成本总额为人民币 28,565.47 元，估值总额为人民币 21,744.00 元，占基金净资产的比例为 0.002%)。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 36,900 股托管人工商银行的普通股，成本总额为人民币 184,500.00 元，估值总额为人民币 176,382.00 元，占基金净资产的比例为 0.02% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 36,900 股托管人工商银行的普通股，成本总额为人民币 184,500.00 元，估值总额为人民币 160,146.00 元，占基金净资产的比例为 0.01%)。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流	认购	期	数量	期末	期末估值总额	备

代码	券名称	认购日	期	通受限类型	价格	末估值单价	(单位:股)	成本总额		注
001239	永达股份	2023年12月4日	1-6个月(含)	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	1-6个月(含)	新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	1-6个月(含)	新股限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	1-6个月(含)	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	新股限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精	2023年6月	1-6个月(含)	新股限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

	密	29		售						
	日									
301329	信音电子	2023年7月5日	1-6个月(含)	新股限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	1-6个月(含)	新股限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023年8月3日	1-6个月(含)	新股限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023年12月11日	1-6个月(含)	新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	1-6个月(含)	新股限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	1-6个月(含)	新股限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	1-6个月(含)	新股限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	1-6个月(含)	新股限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

		日								
301468	博盈特焊	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	1-6个月(含)	新股限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1-6个月(含)	新股限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	1-6个月(含)	新股限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维科精密	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	1-6个月(含)	新股限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	1-6个月(含)	新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301511	德	2023	1-6个月	新	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-

	福科技	年 8 月 8 日	月 (含)	股限售						
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	1-6 个月 (含)	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	1-6 个月 (含)	新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	1-6 个月 (含)	新股限售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	1-6 个月 (含)	新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	1-6 个月 (含)	新股限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	1-6 个月 (含)	新股限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	1-6 个月 (含)	新股限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	1-6 个月 (含)	新股限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏	2023 年	1-6 个月	新股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	新材	10月24日	(含)	限售						
301558	三态股份	2023年9月21日	1-6个月(含)	新股限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023年9月26日	1-6个月(含)	新股限售	24.22	18.24	1,090	26,399.80	19,881.60	-
301568	思泰克	2023年11月21日	1-6个月(含)	新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	1-6个月(含)	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	1-6个月(含)	新股限售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	1-6个月(含)	新股限售	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603075	热威股份	2023年9月1日	1-6个月(含)	新股限售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海	2023年	1-6个月	新股	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-

	汽配	10月25日	(含)	限售						
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	1-6个月(含)	新股限售	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	1-6个月(含)	新股限售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	1-6个月(含)	新股限售	80.80	77.75	356	28,764.80	27,679.00	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	1-6个月(含)	新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	1-6个月(含)	新股限售	52.00	42.06	27,921	1,451,892.00	1,174,357.26	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	1-6个月(含)	新股限售	9.87	12.75	3,688	36,400.56	47,022.00	-
688563	航	2023	1-6个	新	78.99	60.49	692	54,661.08	41,859.08	-

	材股份	年7月12日	月(含)	股限售						
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	1-6个月(含)	新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	1-6个月(含)	新股限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	1-6个月(含)	新股限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月	1-6个月(含)	新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-

		10 日								
688657	浩辰软件	2023 年9 月25 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688702	盛科通信	2023 年9 月6 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688719	爱科赛博	2023 年9 月20 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023 年11 月29 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘单	数量(股)	期末成本总	期末估值	备注
------	------	------	------	------	------	-------	-------	-------	------	----

				单价		价		额	总额	
000540	中天金融	2023年5月19日	重大事项停牌	0.01	-	-	100	297.00	1.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资（2022 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.05%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	59,194,773.80	-	-	-	59,194,773.80
结算备付金	5,174,344.83	-	-	-	5,174,344.83
存出保证金	119,320.18	-	-	-	119,320.18
交易性金融资产	-	-	-	935,925,635.53	935,925,635.53
应收申购款	-	-	-	233,044.63	233,044.63
应收清算款	-	-	-	8,800,515.56	8,800,515.56
资产总计	64,488,438.81	-	-	944,959,195.72	1,009,447,634.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	776,535.33	776,535.33
应付管理人报酬	-	-	-	841,203.40	841,203.40
应付托管费	-	-	-	168,240.69	168,240.69
应付清算款	-	-	-	6,823,094.76	6,823,094.76
其他负债	-	-	-	5,507,277.34	5,507,277.34
负债总计	-	-	-	14,116,351.52	14,116,351.52
利率敏感度缺口	64,488,438.81	-	-	930,842,844.20	995,331,283.01
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	43,214,524.67	-	-	-	43,214,524.67
结算备付金	1,903,828.31	-	-	-	1,903,828.31
存出保证金	168,522.87	-	-	-	168,522.87
交易性金融资产	26,078,917.47	-	-	1,108,706,355.24	1,134,785,272.71
应收清算款	-	-	-	431,710.55	431,710.55
应收申购款	-	-	-	374,976.74	374,976.74
资产总计	71,365,793.32	-	-	1,109,513,042.53	1,180,878,835.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	737,655.94	737,655.94
应付管理人报酬	-	-	-	996,049.94	996,049.94
应付托管费	-	-	-	199,209.99	199,209.99
应交税费	-	-	-	1.46	1.46
其他负债	-	-	-	3,609,601.03	3,609,601.03
负债总计	-	-	-	5,542,518.36	5,542,518.36
利率敏感度缺口	71,365,793.32	-	-	1,103,970,524.17	1,175,336,317.49

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：2.22%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股(含存托凭证)，投资组合中股票(含存托凭证)投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、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，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	935,925,635.53	94.03	1,108,706,355.24	94.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	577,758.58	0.05
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	935,925,635.53	94.03	1,109,284,113.82	94.38

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	51,442,476.02	62,140,000.00
	业绩比较基准下降5%	-51,442,476.02	-62,140,000.00

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	933,963,610.40	1,108,188,197.90
第二层次	-	25,501,158.89
第三层次	1,962,025.13	1,095,915.92
合计	935,925,635.53	1,134,785,272.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,095,915.92	1,095,915.92
当期购买	-	3,636,396.11	3,636,396.11
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	1.00	1.00
转出第三层次	-	8,600,728.71	8,600,728.71
当期利得或损失总额	-	5,830,440.81	5,830,440.81
其中：计入损益的利得或损失	-	5,830,440.81	5,830,440.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00
期末余额	-	1,962,025.13	1,962,025.13
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-208,942.96	-208,942.96
	上年度可比期间		

项目	2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,962,009.50	2,962,009.50
当期购买	-	2,621,428.98	2,621,428.98
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,796,092.47	7,796,092.47
当期利得或损失总额	-	3,308,569.91	3,308,569.91
其中：计入损益的利得或损失	-	3,308,569.91	3,308,569.91
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,095,915.92	1,095,915.92
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-81,755.25	-81,755.25

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,962,024.13	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-217.75%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,095,915.92	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2319-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	935,925,635.53	92.72
	其中：股票	935,925,635.53	92.72
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	64,369,118.63	6.38
8	其他各项资产	9,152,880.37	0.91
9	合计	1,009,447,634.53	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	3,203,867.00	0.32
B	采矿业	36,890,457.68	3.71
C	制造业	446,602,193.83	44.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,036,107.00	2.82
E	建筑业	13,287,740.30	1.34
F	批发和零售业	10,890,936.15	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	32,031,020.88	3.22
H	住宿和餐饮业	4,722,406.00	0.47

I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,340,352.11	6.56
J	金融业	104,895,236.20	10.54
K	房地产业	6,433,120.78	0.65
L	租赁和商务服务业	7,371,896.30	0.74
M	科学研究和技术服务业	8,676,331.26	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	1,338.00	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	940,032.00	0.09
Q	卫生和社会工作	12,175,131.61	1.22
R	文化、体育和娱乐业	529,758.72	0.05
S	综合	2,805,924.00	0.28
	合计	784,833,849.82	78.85

8.2.2 报告期末积极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	986,271.00	0.10
B	采矿业	3,868,642.00	0.39
C	制造业	86,422,358.30	8.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,810,843.00	0.38
E	建筑业	4,104,800.00	0.41
F	批发和零售业	4,009,368.60	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	7,419,151.24	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,235,881.08	1.53
J	金融业	986,102.00	0.10
K	房地产业	932,716.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,959,988.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	6,553,713.82	0.66
N	水利、环境和公	6,837,708.67	0.69

	共设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,096,130.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	868,112.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	151,091,785.71	15.18

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	21,133	36,475,558.00	3.66
2	300750	宁德时代	79,212	12,932,151.12	1.30
3	600036	招商银行	437,700	12,176,814.00	1.22
4	601318	中国平安	226,734	9,137,380.20	0.92
5	000725	京东方 A	2,294,200	8,947,380.00	0.90
6	000333	美的集团	157,585	8,608,868.55	0.86
7	601939	建设银行	1,292,800	8,416,128.00	0.85
8	601288	农业银行	2,295,100	8,354,164.00	0.84
9	603259	药明康德	98,757	7,185,559.32	0.72
10	600809	山西汾酒	29,200	6,737,316.00	0.68
11	600030	中信证券	322,833	6,576,108.21	0.66
12	000858	五粮液	45,644	6,404,309.64	0.64
13	000100	TCL 科技	1,468,880	6,316,184.00	0.63
14	601333	广深铁路	2,251,500	5,831,385.00	0.59
15	000661	长春高新	39,100	5,700,780.00	0.57
16	000932	华菱钢铁	1,092,500	5,626,375.00	0.57
17	002129	TCL 中环	348,400	5,448,976.00	0.55
18	600256	广汇能源	753,700	5,381,418.00	0.54
19	601717	郑煤机	407,800	5,158,670.00	0.52
20	601615	明阳智能	411,000	5,153,940.00	0.52
21	000513	丽珠集团	144,900	5,072,949.00	0.51
22	601555	东吴证券	676,130	4,942,510.30	0.50
23	600009	上海机场	149,500	4,900,610.00	0.49
24	600019	宝钢股份	816,600	4,842,438.00	0.49
25	601006	大秦铁路	670,000	4,830,700.00	0.49

26	688180	君实生物	114,706	4,798,151.98	0.48
27	603882	金域医学	76,400	4,780,348.00	0.48
28	601728	中国电信	879,000	4,755,390.00	0.48
29	603444	吉比特	19,200	4,706,304.00	0.47
30	603338	浙江鼎力	90,600	4,636,002.00	0.47
31	002019	亿帆医药	313,000	4,626,140.00	0.46
32	002938	鹏鼎控股	207,100	4,622,472.00	0.46
33	600938	中国海油	212,100	4,447,737.00	0.45
34	002683	广东宏大	221,400	4,445,712.00	0.45
35	603659	璞泰来	212,145	4,440,194.85	0.45
36	601688	华泰证券	310,124	4,326,229.80	0.43
37	000997	新大陆	219,100	4,296,551.00	0.43
38	688521	芯原股份	85,336	4,263,386.56	0.43
39	002602	世纪华通	825,200	4,258,032.00	0.43
40	603185	弘元绿能	127,525	4,244,032.00	0.43
41	600582	天地科技	775,700	4,219,808.00	0.42
42	000032	深桑达 A	198,600	4,206,348.00	0.42
43	000559	万向钱潮	806,600	4,186,254.00	0.42
44	000937	冀中能源	585,800	4,182,612.00	0.42
45	002595	豪迈科技	138,700	4,129,099.00	0.41
46	000425	徐工机械	754,300	4,118,478.00	0.41
47	002506	协鑫集成	1,502,800	4,117,672.00	0.41
48	603179	新泉股份	80,400	4,077,084.00	0.41
49	000750	国海证券	1,144,300	4,050,822.00	0.41
50	601231	环旭电子	268,039	4,050,069.29	0.41
51	600808	马钢股份	1,488,900	4,049,808.00	0.41
52	601608	中信重工	1,044,400	4,031,384.00	0.41
53	002078	太阳纸业	330,400	4,020,968.00	0.40
54	600369	西南证券	980,500	4,010,245.00	0.40
55	688005	容百科技	100,549	4,001,850.20	0.40
56	600155	华创云信	479,100	3,995,694.00	0.40
57	601658	邮储银行	915,800	3,983,730.00	0.40
58	300357	我武生物	137,200	3,978,800.00	0.40
59	002648	卫星化学	269,600	3,976,600.00	0.40
60	601077	渝农商行	972,500	3,967,800.00	0.40
61	600879	航天电子	513,000	3,955,230.00	0.40
62	002850	科达利	46,800	3,952,728.00	0.40
63	600500	中化国际	892,700	3,945,734.00	0.40
64	603599	广信股份	271,200	3,932,400.00	0.40
65	600456	宝钛股份	124,700	3,914,333.00	0.39
66	300395	菲利华	106,900	3,908,264.00	0.39
67	601162	天风证券	1,263,000	3,902,670.00	0.39
68	000157	中联重科	597,100	3,899,063.00	0.39

69	600511	国药股份	136,000	3,892,320.00	0.39
70	600546	山煤国际	222,200	3,890,722.00	0.39
71	688779	长远锂科	532,309	3,885,855.70	0.39
72	603826	坤彩科技	65,800	3,884,174.00	0.39
73	000893	亚钾国际	147,517	3,870,846.08	0.39
74	601000	唐山港	1,087,600	3,806,600.00	0.38
75	600754	锦江酒店	126,700	3,788,330.00	0.38
76	601088	中国神华	120,300	3,771,405.00	0.38
77	002153	石基信息	387,155	3,770,889.70	0.38
78	002065	东华软件	608,700	3,755,679.00	0.38
79	002541	鸿路钢构	172,300	3,744,079.00	0.38
80	600959	江苏有线	1,140,900	3,582,426.00	0.36
81	002025	航天电器	73,700	3,539,074.00	0.36
82	000951	中国重汽	261,340	3,491,502.40	0.35
83	688385	复旦微电	89,613	3,461,750.19	0.35
84	601111	中国国航	466,532	3,424,344.88	0.34
85	688536	思瑞浦	22,543	3,298,040.90	0.33
86	002027	分众传媒	520,400	3,288,928.00	0.33
87	600642	申能股份	503,950	3,235,359.00	0.33
88	000408	藏格矿业	127,100	3,220,714.00	0.32
89	600733	北汽蓝谷	520,600	3,191,278.00	0.32
90	600763	通策医疗	41,700	3,187,965.00	0.32
91	600057	厦门象屿	470,300	3,155,713.00	0.32
92	600820	隧道股份	547,500	3,153,600.00	0.32
93	000960	锡业股份	220,200	3,153,264.00	0.32
94	688200	华峰测控	25,665	3,151,662.00	0.32
95	600028	中国石化	562,200	3,137,076.00	0.32
96	300017	网宿科技	399,400	3,135,290.00	0.31
97	600900	长江电力	133,300	3,111,222.00	0.31
98	000050	深天马 A	291,000	3,099,150.00	0.31
99	600873	梅花生物	324,100	3,095,155.00	0.31
100	600674	川投能源	204,300	3,089,016.00	0.31
101	002092	中泰化学	505,700	3,084,770.00	0.31
102	600755	厦门国贸	441,200	3,075,164.00	0.31
103	002841	视源股份	67,000	3,065,920.00	0.31
104	002353	杰瑞股份	109,000	3,063,990.00	0.31
105	603486	科沃斯	73,800	3,058,272.00	0.31
106	603993	洛阳钼业	582,600	3,029,520.00	0.30
107	002456	欧菲光	347,700	3,028,467.00	0.30
108	002984	森麒麟	104,300	3,009,055.00	0.30
109	600023	浙能电力	652,600	3,008,486.00	0.30
110	300442	润泽科技	118,300	3,001,271.00	0.30
111	300003	乐普医疗	185,600	2,999,296.00	0.30

112	000598	兴蓉环境	525,700	2,991,233.00	0.30
113	600765	中航重机	156,000	2,981,160.00	0.30
114	601966	玲珑轮胎	154,800	2,976,804.00	0.30
115	000686	东北证券	419,000	2,974,900.00	0.30
116	600795	国电电力	715,000	2,974,400.00	0.30
117	688516	奥特维	32,739	2,962,879.50	0.30
118	300122	智飞生物	48,250	2,948,557.50	0.30
119	300999	金龙鱼	88,300	2,947,454.00	0.30
120	000338	潍柴动力	215,600	2,942,940.00	0.30
121	002131	利欧股份	1,290,500	2,942,340.00	0.30
122	002044	美年健康	489,400	2,941,294.00	0.30
123	601108	财通证券	378,400	2,936,384.00	0.30
124	000825	太钢不锈	785,600	2,930,288.00	0.29
125	600050	中国联通	668,700	2,928,906.00	0.29
126	300009	安科生物	285,720	2,920,058.40	0.29
127	600967	内蒙一机	352,400	2,910,824.00	0.29
128	600004	白云机场	295,700	2,891,946.00	0.29
129	601198	东兴证券	350,500	2,884,615.00	0.29
130	600271	航天信息	271,100	2,884,504.00	0.29
131	600563	法拉电子	31,100	2,879,860.00	0.29
132	601919	中远海控	299,900	2,873,042.00	0.29
133	603027	千禾味业	177,144	2,864,418.48	0.29
134	601995	中金公司	75,000	2,853,750.00	0.29
135	600673	东阳光	382,800	2,805,924.00	0.28
136	300595	欧普康视	124,180	2,803,984.40	0.28
137	688120	华海清科	14,825	2,782,652.50	0.28
138	002373	千方科技	247,600	2,775,596.00	0.28
139	688235	百济神州	19,942	2,772,735.68	0.28
140	603198	迎驾贡酒	41,400	2,744,406.00	0.28
141	002507	涪陵榨菜	191,030	2,729,818.70	0.27
142	300285	国瓷材料	114,100	2,637,992.00	0.27
143	603218	日月股份	206,800	2,558,116.00	0.26
144	601800	中国交建	336,000	2,553,600.00	0.26
145	002555	三七互娱	132,000	2,482,920.00	0.25
146	000629	钒钛股份	734,800	2,410,144.00	0.24
147	300059	东方财富	162,898	2,287,087.92	0.23
148	688556	高测股份	57,588	2,245,356.12	0.23
149	300498	温氏股份	110,400	2,214,624.00	0.22
150	600985	淮北矿业	131,900	2,193,497.00	0.22
151	688561	奇安信	54,454	2,183,060.86	0.22
152	600690	海尔智家	100,920	2,119,320.00	0.21
153	601985	中国核电	281,300	2,109,750.00	0.21
154	000027	深圳能源	324,100	2,090,445.00	0.21

155	003816	中国广核	670,700	2,085,877.00	0.21
156	600132	重庆啤酒	31,300	2,079,885.00	0.21
157	000630	铜陵有色	634,100	2,079,848.00	0.21
158	002497	雅化集团	157,600	2,062,984.00	0.21
159	601058	赛轮轮胎	175,500	2,062,125.00	0.21
160	600352	浙江龙盛	242,300	2,035,320.00	0.20
161	001979	招商蛇口	213,500	2,034,655.00	0.20
162	600498	烽火通信	122,000	2,030,080.00	0.20
163	601127	赛力斯	26,600	2,026,920.00	0.20
164	600895	张江高科	104,036	2,007,894.80	0.20
165	002185	华天科技	234,400	1,997,088.00	0.20
166	600839	四川长虹	377,500	1,996,975.00	0.20
167	300223	北京君正	30,800	1,991,220.00	0.20
168	600166	福田汽车	729,200	1,990,716.00	0.20
169	688012	中微公司	12,951	1,989,273.60	0.20
170	000636	风华高科	145,200	1,983,432.00	0.20
171	601997	贵阳银行	385,200	1,979,928.00	0.20
172	600909	华安证券	404,530	1,974,106.40	0.20
173	000933	神火股份	117,300	1,970,640.00	0.20
174	600383	金地集团	451,700	1,969,412.00	0.20
175	600547	山东黄金	85,600	1,957,672.00	0.20
176	600282	南钢股份	529,000	1,957,300.00	0.20
177	000988	华工科技	65,700	1,955,232.00	0.20
178	002432	九安医疗	51,800	1,951,306.00	0.20
179	600745	闻泰科技	46,000	1,946,260.00	0.20
180	002594	比亚迪	9,800	1,940,400.00	0.19
181	600018	上港集团	395,000	1,935,500.00	0.19
182	002007	华兰生物	87,300	1,931,949.00	0.19
183	002436	兴森科技	131,000	1,929,630.00	0.19
184	002736	国信证券	221,200	1,889,048.00	0.19
185	603893	瑞芯微	29,400	1,863,960.00	0.19
186	002405	四维图新	204,000	1,815,600.00	0.18
187	600177	雅戈尔	271,900	1,780,945.00	0.18
188	601319	中国人保	367,300	1,777,732.00	0.18
189	600489	中金黄金	177,900	1,771,884.00	0.18
190	300760	迈瑞医疗	5,888	1,711,052.80	0.17
191	601618	中国中冶	557,700	1,706,562.00	0.17
192	600660	福耀玻璃	40,600	1,518,034.00	0.15
193	600803	新奥股份	89,600	1,507,072.00	0.15
194	002916	深南电路	21,200	1,504,988.00	0.15
195	300012	华测检测	100,132	1,421,874.40	0.14
196	000581	威孚高科	94,100	1,418,087.00	0.14
197	600588	用友网络	78,100	1,389,399.00	0.14

198	000568	泸州老窖	7,300	1,309,766.00	0.13
199	688111	金山办公	4,072	1,287,566.40	0.13
200	603290	斯达半导	7,000	1,267,000.00	0.13
201	688099	晶晨股份	19,499	1,221,222.37	0.12
202	002142	宁波银行	56,710	1,140,438.10	0.11
203	002557	洽洽食品	32,600	1,135,132.00	0.11
204	600015	华夏银行	196,800	1,106,016.00	0.11
205	002865	钧达股份	14,100	1,092,468.00	0.11
206	603000	人民网	37,700	1,054,846.00	0.11
207	601360	三六零	117,000	1,054,170.00	0.11
208	002831	裕同科技	38,100	1,048,131.00	0.11
209	300568	星源材质	67,600	1,042,392.00	0.10
210	300383	光环新网	106,600	1,036,152.00	0.10
211	603345	安井食品	9,800	1,025,178.00	0.10
212	300088	长信科技	153,200	1,024,908.00	0.10
213	600183	生益科技	55,800	1,021,698.00	0.10
214	300433	蓝思科技	77,000	1,016,400.00	0.10
215	600131	国网信通	66,700	1,010,505.00	0.10
216	300124	汇川技术	16,000	1,010,240.00	0.10
217	600863	内蒙华电	257,800	1,005,420.00	0.10
218	000980	众泰汽车	336,900	1,003,962.00	0.10
219	603899	晨光股份	26,700	1,002,585.00	0.10
220	000516	国际医学	123,500	1,001,585.00	0.10
221	600378	昊华科技	32,800	999,744.00	0.10
222	600521	华海药业	68,000	997,560.00	0.10
223	000617	中油资本	184,100	994,140.00	0.10
224	600606	绿地控股	431,731	992,981.30	0.10
225	000921	海信家电	48,600	991,440.00	0.10
226	002926	华西证券	127,700	990,952.00	0.10
227	600968	海油发展	347,300	989,805.00	0.10
228	600598	北大荒	82,500	987,525.00	0.10
229	300529	健帆生物	44,300	984,789.00	0.10
230	600688	上海石化	343,200	981,552.00	0.10
231	688396	华润微	21,717	970,532.73	0.10
232	601975	招商南油	345,300	966,840.00	0.10
233	000983	山西焦煤	96,700	955,396.00	0.10
234	000860	顺鑫农业	44,600	949,534.00	0.10
235	600637	东方明珠	126,100	948,272.00	0.10
236	002607	中公教育	230,400	940,032.00	0.09
237	600258	首旅酒店	59,800	934,076.00	0.09
238	300274	阳光电源	10,600	928,454.00	0.09
239	601888	中国中免	10,170	851,127.30	0.09
240	300438	鹏辉能源	26,488	749,345.52	0.08

241	002439	启明星辰	26,800	723,600.00	0.07
242	601238	广汽集团	81,900	716,625.00	0.07
243	601390	中国中铁	118,500	673,080.00	0.07
244	601012	隆基绿能	27,991	640,993.90	0.06
245	002371	北方华创	2,400	589,704.00	0.06
246	600021	上海电力	62,700	530,442.00	0.05
247	300413	芒果超媒	20,890	526,428.00	0.05
248	002475	立讯精密	15,132	521,297.40	0.05
249	000060	中金岭南	119,500	516,240.00	0.05
250	600309	万华化学	6,400	491,648.00	0.05
251	688301	奕瑞科技	1,348	438,450.48	0.04
252	600867	通化东宝	38,100	412,623.00	0.04
253	300601	康泰生物	15,000	407,250.00	0.04
254	000002	万 科 A	33,813	353,683.98	0.04
255	601001	晋控煤业	28,400	350,172.00	0.04
256	603885	吉祥航空	27,600	331,200.00	0.03
257	002156	通富微电	13,000	300,560.00	0.03
258	300502	新易盛	5,696	280,926.72	0.03
259	601689	拓普集团	3,800	279,300.00	0.03
260	600011	华能国际	34,400	264,880.00	0.03
261	601577	长沙银行	38,800	264,616.00	0.03
262	600919	江苏银行	38,100	254,889.00	0.03
263	603019	中科曙光	6,300	248,787.00	0.02
264	300308	中际旭创	2,135	241,062.85	0.02
265	002410	广联达	13,680	234,475.20	0.02
266	000021	深科技	14,200	230,182.00	0.02
267	002747	埃斯顿	12,300	228,657.00	0.02
268	002179	中航光电	5,782	225,498.00	0.02
269	688256	寒武纪	1,650	222,684.00	0.02
270	002812	恩捷股份	3,900	221,598.00	0.02
271	600885	宏发股份	8,000	221,120.00	0.02
272	600522	中天科技	16,800	209,832.00	0.02
273	603392	万泰生物	2,400	180,312.00	0.02
274	002463	沪电股份	8,010	177,181.20	0.02
275	601398	工商银行	36,900	176,382.00	0.02
276	600346	恒力石化	11,880	156,459.60	0.02
277	300015	爱尔眼科	9,416	148,961.12	0.01
278	601857	中国石油	21,000	148,260.00	0.01
279	002493	荣盛石化	14,250	147,487.50	0.01
280	603707	健友股份	9,340	140,100.00	0.01
281	002311	海大集团	3,100	139,221.00	0.01
282	603986	兆易创新	1,500	138,585.00	0.01
283	000651	格力电器	4,300	138,331.00	0.01

284	601872	招商轮船	23,300	137,004.00	0.01
285	300604	长川科技	3,600	136,764.00	0.01
286	601377	兴业证券	22,640	132,896.80	0.01
287	300408	三环集团	4,400	129,580.00	0.01
288	600016	民生银行	32,900	123,046.00	0.01
289	601899	紫金矿业	9,483	118,158.18	0.01
290	600000	浦发银行	17,800	117,836.00	0.01
291	600438	通威股份	4,700	117,641.00	0.01
292	601166	兴业银行	7,100	115,091.00	0.01
293	300244	迪安诊断	4,829	114,978.49	0.01
294	002352	顺丰控股	2,400	96,960.00	0.01
295	603501	韦尔股份	895	95,505.45	0.01
296	603712	七一二	2,800	88,228.00	0.01
297	300558	贝达药业	1,700	87,635.00	0.01
298	002368	太极股份	2,900	85,637.00	0.01
299	000729	燕京啤酒	9,700	83,711.00	0.01
300	002415	海康威视	2,400	83,328.00	0.01
301	300782	卓胜微	556	78,396.00	0.01
302	688617	惠泰医疗	200	77,700.00	0.01
303	600415	小商品城	10,400	76,128.00	0.01
304	603658	安图生物	1,330	75,823.30	0.01
305	600316	洪都航空	3,400	71,978.00	0.01
306	600848	上海临港	6,620	66,531.00	0.01
307	603127	昭衍新药	2,674	63,400.54	0.01
308	688599	天合光能	2,163	61,710.39	0.01
309	603288	海天味业	1,585	60,150.75	0.01
310	600566	济川药业	1,903	59,811.29	0.01
311	002444	巨星科技	2,600	58,552.00	0.01
312	300454	深信服	800	57,832.00	0.01
313	300628	亿联网络	1,880	55,554.00	0.01
314	000538	云南白药	1,120	55,048.00	0.01
315	000895	双汇发展	1,800	48,078.00	0.00
316	002518	科士达	1,600	44,160.00	0.00
317	600372	中航机载	3,266	43,045.88	0.00
318	688037	芯源微	296	39,548.56	0.00
319	002625	光启技术	2,600	38,428.00	0.00
320	600399	抚顺特钢	3,800	36,936.00	0.00
321	601991	大唐发电	12,500	30,250.00	0.00
322	600380	健康元	2,400	29,832.00	0.00
323	600392	盛和资源	2,900	29,522.00	0.00
324	000876	新希望	2,900	27,028.00	0.00
325	300418	昆仑万维	700	26,180.00	0.00
326	002008	大族激光	1,200	24,864.00	0.00

327	600436	片仔癀	100	24,199.00	0.00
328	601211	国泰君安	1,600	23,808.00	0.00
329	000596	古井贡酒	100	23,280.00	0.00
330	300014	亿纬锂能	500	21,100.00	0.00
331	603596	伯特利	300	20,790.00	0.00
332	300751	迈为股份	160	20,721.60	0.00
333	600535	天士力	1,200	20,424.00	0.00
334	000400	许继电气	800	17,568.00	0.00
335	300033	同花顺	100	15,687.00	0.00
336	002372	伟星新材	1,000	14,470.00	0.00
337	688220	翱捷科技	200	14,088.00	0.00
338	601799	星宇股份	100	13,111.00	0.00
339	002049	紫光国微	185	12,478.25	0.00
340	300748	金力永磁	600	12,132.00	0.00
341	688008	澜起科技	200	11,752.00	0.00
342	002422	科伦药业	400	11,620.00	0.00
343	002821	凯莱英	100	11,610.00	0.00
344	300661	圣邦股份	130	11,571.30	0.00
345	002304	洋河股份	100	10,990.00	0.00
346	600941	中国移动	100	9,948.00	0.00
347	600998	九州通	1,417	9,933.17	0.00
348	600702	舍得酒业	100	9,670.00	0.00
349	300567	精测电子	100	8,762.00	0.00
350	600486	扬农化工	130	8,205.60	0.00
351	300487	蓝晓科技	150	7,959.00	0.00
352	600536	中国软件	208	7,542.08	0.00
353	600600	青岛啤酒	100	7,475.00	0.00
354	000799	酒鬼酒	100	7,315.00	0.00
355	603939	益丰药房	182	7,287.28	0.00
356	300763	锦浪科技	100	6,990.00	0.00
357	603737	三棵树	140	6,665.40	0.00
358	000977	浪潮信息	190	6,308.00	0.00
359	600893	航发动力	166	6,205.08	0.00
360	300803	指南针	100	6,026.00	0.00
361	002460	赣锋锂业	140	5,992.00	0.00
362	600584	长电科技	200	5,972.00	0.00
363	600779	水井坊	100	5,877.00	0.00
364	603613	国联股份	261	5,744.61	0.00
365	300347	泰格医药	100	5,497.00	0.00
366	601100	恒立液压	100	5,468.00	0.00
367	002738	中矿资源	140	5,223.40	0.00
368	002028	思源电气	100	5,204.00	0.00
369	000999	华润三九	100	4,973.00	0.00

370	000423	东阿阿胶	100	4,932.00	0.00
371	603369	今世缘	100	4,875.00	0.00
372	002568	百润股份	196	4,823.56	0.00
373	002230	科大讯飞	100	4,638.00	0.00
374	603589	口子窖	100	4,530.00	0.00
375	600276	恒瑞医药	100	4,523.00	0.00
376	603233	大参林	173	4,307.70	0.00
377	601877	正泰电器	200	4,302.00	0.00
378	603606	东方电缆	100	4,275.00	0.00
379	000963	华东医药	100	4,146.00	0.00
380	300450	先导智能	157	4,019.20	0.00
381	300073	当升科技	100	3,820.00	0.00
382	603799	华友钴业	114	3,754.02	0.00
383	002236	大华股份	200	3,690.00	0.00
384	603806	福斯特	140	3,397.80	0.00
385	688188	柏楚电子	13	3,290.43	0.00
386	002603	以岭药业	140	3,229.80	0.00
387	002151	北斗星通	100	3,158.00	0.00
388	601336	新华保险	100	3,113.00	0.00
389	600188	兖矿能源	150	2,971.50	0.00
390	002050	三花智控	100	2,940.00	0.00
391	600570	恒生电子	100	2,876.00	0.00
392	600332	白云山	100	2,860.00	0.00
393	000831	中国稀土	100	2,767.00	0.00
394	600426	华鲁恒升	100	2,759.00	0.00
395	600999	招商证券	200	2,728.00	0.00
396	002262	恩华药业	100	2,712.00	0.00
397	603517	绝味食品	100	2,686.00	0.00
398	600887	伊利股份	100	2,675.00	0.00
399	300363	博腾股份	100	2,515.00	0.00
400	600196	复星医药	100	2,503.00	0.00
401	600079	人福医药	100	2,486.00	0.00
402	601601	中国太保	100	2,378.00	0.00
403	601066	中信建投	100	2,366.00	0.00
404	300142	沃森生物	100	2,351.00	0.00
405	000786	北新建材	100	2,336.00	0.00
406	600460	士兰微	100	2,283.00	0.00
407	002180	纳思达	100	2,263.00	0.00
408	600585	海螺水泥	100	2,256.00	0.00
409	600559	老白干酒	100	2,255.00	0.00
410	002268	电科网安	100	2,246.00	0.00
411	000768	中航西飞	100	2,237.00	0.00
412	601699	潞安环能	100	2,191.00	0.00

413	002508	老板电器	100	2,178.00	0.00
414	002241	歌尔股份	100	2,101.00	0.00
415	000738	航发控制	100	1,990.00	0.00
416	002459	晶澳科技	96	1,989.12	0.00
417	600111	北方稀土	100	1,934.00	0.00
418	002414	高德红外	255	1,861.50	0.00
419	002389	航天彩虹	100	1,860.00	0.00
420	600141	兴发集团	100	1,825.00	0.00
421	002384	东山精密	100	1,818.00	0.00
422	600482	中国动力	100	1,801.00	0.00
423	600362	江西铜业	100	1,786.00	0.00
424	002299	圣农发展	100	1,718.00	0.00
424	600549	厦门钨业	100	1,718.00	0.00
425	002601	龙佰集团	100	1,713.00	0.00
426	300146	汤臣倍健	100	1,703.00	0.00
427	603858	步长制药	100	1,701.00	0.00
428	601607	上海医药	100	1,673.00	0.00
429	600741	华域汽车	100	1,628.00	0.00
430	600859	王府井	100	1,597.00	0.00
431	002572	索菲亚	100	1,595.00	0.00
432	601788	光大证券	100	1,542.00	0.00
433	000739	普洛药业	100	1,539.00	0.00
434	601233	桐昆股份	100	1,513.00	0.00
435	000975	银泰黄金	100	1,500.00	0.00
436	600989	宝丰能源	100	1,477.00	0.00
437	300207	欣旺达	100	1,476.00	0.00
438	600875	东方电气	100	1,462.00	0.00
439	601168	西部矿业	100	1,427.00	0.00
440	000519	中兵红箭	100	1,404.00	0.00
441	600089	特变电工	100	1,380.00	0.00
442	600031	三一重工	100	1,377.00	0.00
443	600884	杉杉股份	100	1,362.00	0.00
444	600066	宇通客车	100	1,325.00	0.00
445	600886	国投电力	100	1,318.00	0.00
446	600801	华新水泥	100	1,243.00	0.00
447	600233	圆通速递	100	1,229.00	0.00
448	002152	广电运通	100	1,226.00	0.00
449	600026	中远海能	100	1,224.00	0.00
449	600977	中国电影	100	1,224.00	0.00
450	601881	中国银河	100	1,205.00	0.00
451	600487	亨通光电	100	1,194.00	0.00
452	600739	辽宁成大	100	1,178.00	0.00
453	601838	成都银行	100	1,126.00	0.00

454	002739	万达电影	86	1,119.72	0.00
455	002203	海亮股份	100	1,115.00	0.00
456	002558	巨人网络	100	1,114.00	0.00
457	600958	东方证券	128	1,113.60	0.00
458	000987	越秀资本	182	1,095.64	0.00
459	000878	云南铜业	100	1,089.00	0.00
460	601456	国联证券	100	1,084.00	0.00
461	601878	浙商证券	100	1,043.00	0.00
462	002221	东华能源	100	1,030.00	0.00
463	600061	国投资本	152	1,024.48	0.00
464	000066	中国长城	100	1,012.00	0.00
465	000830	鲁西化工	100	1,003.00	0.00
466	600926	杭州银行	100	1,001.00	0.00
467	300070	碧水源	200	998.00	0.00
468	300144	宋城演艺	100	987.00	0.00
469	600176	中国巨石	100	983.00	0.00
470	600153	建发股份	100	963.00	0.00
471	000301	东方盛虹	100	960.00	0.00
472	601958	金铂股份	100	945.00	0.00
473	000001	平安银行	100	939.00	0.00
474	600837	海通证券	100	937.00	0.00
475	601989	中国重工	200	826.00	0.00
476	600737	中粮糖业	100	824.00	0.00
477	601901	方正证券	100	806.00	0.00
478	002202	金风科技	100	800.00	0.00
478	002252	上海莱士	100	800.00	0.00
478	002939	长城证券	100	800.00	0.00
479	600143	金发科技	100	799.00	0.00
480	601990	南京证券	100	798.00	0.00
481	002120	韵达股份	100	746.00	0.00
482	600398	海澜之家	100	742.00	0.00
483	601009	南京银行	100	738.00	0.00
483	601519	大智慧	100	738.00	0.00
484	600100	同方股份	100	735.00	0.00
485	002244	滨江集团	100	727.00	0.00
486	600918	中泰证券	100	686.00	0.00
487	000728	国元证券	100	683.00	0.00
488	000776	广发证券	45	643.05	0.00
489	002673	西部证券	100	637.00	0.00
489	300376	易事特	100	637.00	0.00
490	601117	中国化学	100	636.00	0.00
491	002532	天山铝业	100	601.00	0.00
492	601229	上海银行	100	597.00	0.00

493	600583	海油工程	100	594.00	0.00
494	002797	第一创业	100	581.00	0.00
495	600029	南方航空	100	576.00	0.00
496	601328	交通银行	100	574.00	0.00
496	601825	沪农商行	100	574.00	0.00
497	601600	中国铝业	100	564.00	0.00
498	002340	格林美	100	546.00	0.00
499	002500	山西证券	100	539.00	0.00
500	601766	中国中车	100	526.00	0.00
501	600516	方大炭素	100	524.00	0.00
502	600027	华电国际	100	514.00	0.00
503	600497	驰宏锌锗	100	505.00	0.00
504	601816	京沪高铁	100	492.00	0.00
505	601669	中国电建	100	489.00	0.00
506	600390	五矿资本	100	468.00	0.00
507	000166	申万宏源	100	444.00	0.00
508	600704	物产中大	100	443.00	0.00
509	000883	湖北能源	100	423.00	0.00
510	601727	上海电气	100	417.00	0.00
511	601988	中国银行	100	399.00	0.00
512	600115	中国东航	100	388.00	0.00
513	601375	中原证券	100	383.00	0.00
514	601216	君正集团	100	374.00	0.00
515	601099	太平洋	100	370.00	0.00
516	002266	浙富控股	100	340.00	0.00
517	601916	浙商银行	130	327.60	0.00
518	600705	中航产融	100	311.00	0.00
519	600219	南山铝业	100	294.00	0.00
520	601818	光大银行	100	290.00	0.00
521	601106	中国一重	100	288.00	0.00
522	002958	青农商行	100	262.00	0.00
523	603077	和邦生物	100	236.00	0.00
524	600170	上海建工	100	234.00	0.00
524	601866	中远海发	100	234.00	0.00
525	002936	郑州银行	110	221.10	0.00
526	600208	新湖中宝	100	217.00	0.00
527	000709	河钢股份	100	213.00	0.00
528	601868	中国能建	100	210.00	0.00
529	601992	金隅集团	100	191.00	0.00
530	600297	广汇汽车	100	172.00	0.00
531	600010	宝钢股份	100	146.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000967	盈峰环境	675,900	3,210,525.00	0.32
2	300900	广联航空	122,300	3,018,364.00	0.30
3	300741	华宝股份	137,900	2,952,439.00	0.30
4	003012	东鹏控股	352,900	2,911,425.00	0.29
5	002511	中顺洁柔	285,000	2,850,000.00	0.29
6	601158	重庆水务	498,000	2,823,660.00	0.28
7	688083	中望软件	28,060	2,793,092.40	0.28
8	300639	凯普生物	295,800	2,762,772.00	0.28
9	603713	密尔克卫	51,200	2,724,352.00	0.27
10	301029	怡合达	105,000	2,706,900.00	0.27
11	688023	安恒信息	23,912	2,651,601.68	0.27
12	603098	森特股份	191,200	2,602,232.00	0.26
13	300887	谱尼测试	218,400	2,579,304.00	0.26
14	002219	新里程	831,300	2,518,839.00	0.25
15	600480	凌云股份	271,300	2,471,543.00	0.25
16	002690	美亚光电	109,830	2,157,061.20	0.22
17	000822	山东海化	314,700	2,152,548.00	0.22
18	688558	国盛智科	74,075	2,103,730.00	0.21
19	600363	联创光电	60,100	2,043,400.00	0.21
20	688737	中自科技	60,791	2,012,182.10	0.20
21	600350	山东高速	289,600	2,009,824.00	0.20
22	300464	星徽股份	333,300	2,006,466.00	0.20
23	300627	华测导航	64,100	1,988,382.00	0.20
24	601369	陕鼓动力	248,800	1,985,424.00	0.20
25	000959	首钢股份	570,900	1,975,314.00	0.20
26	002344	海宁皮城	477,300	1,956,930.00	0.20
27	600216	浙江医药	179,300	1,923,889.00	0.19
28	603308	应流股份	134,100	1,921,653.00	0.19
29	002649	博彦科技	156,500	1,920,255.00	0.19
30	600395	盘江股份	310,800	1,917,636.00	0.19
31	002088	鲁阳节能	133,800	1,906,650.00	0.19
32	300358	楚天科技	178,100	1,905,670.00	0.19
33	301047	义翘神州	23,100	1,903,440.00	0.19
34	603301	振德医疗	77,300	1,893,850.00	0.19
35	002399	海普瑞	159,900	1,875,627.00	0.19
36	301267	华夏眼科	58,200	1,867,638.00	0.19
37	300768	迪普科技	125,000	1,847,500.00	0.19
38	000761	本钢板材	507,600	1,812,132.00	0.18
39	301200	大族数控	47,057	1,777,342.89	0.18
40	301239	普瑞眼科	20,000	1,720,000.00	0.17
41	002791	坚朗五金	42,400	1,716,776.00	0.17
42	601018	宁波港	445,700	1,586,692.00	0.16

43	603638	艾迪精密	93,740	1,523,275.00	0.15
44	002100	天康生物	172,200	1,510,194.00	0.15
45	600939	重庆建工	458,100	1,502,568.00	0.15
46	002035	华帝股份	240,200	1,491,642.00	0.15
47	300596	利安隆	49,700	1,469,132.00	0.15
48	300132	青松股份	279,900	1,461,078.00	0.15
49	688048	长光华芯	21,417	1,342,203.39	0.13
50	688347	华虹公司	27,921	1,174,357.26	0.12
51	688598	金博股份	16,536	1,155,866.40	0.12
52	002567	唐人神	135,800	1,018,500.00	0.10
53	301185	鸥玛软件	49,800	1,013,928.00	0.10
54	600389	江山股份	58,200	1,012,680.00	0.10
55	001270	铖昌科技	16,141	1,012,202.11	0.10
56	688768	容知日新	27,461	1,010,839.41	0.10
57	605376	博迁新材	35,500	1,001,100.00	0.10
58	300994	久祺股份	68,000	999,600.00	0.10
59	301017	漱玉平民	48,900	999,027.00	0.10
60	002565	顺灏股份	294,500	998,355.00	0.10
61	300143	盈康生命	93,100	989,653.00	0.10
62	300901	中胤时尚	96,600	989,184.00	0.10
63	002171	楚江新材	132,200	988,856.00	0.10
64	600116	三峡水利	131,100	987,183.00	0.10
65	002063	远光软件	159,700	986,946.00	0.10
66	002124	天邦食品	271,700	986,271.00	0.10
67	601665	齐鲁银行	252,200	986,102.00	0.10
68	688022	瀚川智能	44,932	985,808.08	0.10
69	688306	均普智能	176,786	984,698.02	0.10
70	300198	纳川股份	365,700	983,733.00	0.10
71	688699	明微电子	24,302	980,585.70	0.10
72	600338	西藏珠峰	80,500	978,880.00	0.10
73	300770	新媒股份	25,300	978,604.00	0.10
74	300593	新雷能	66,100	976,297.00	0.10
75	603533	掌阅科技	49,100	976,108.00	0.10
76	688238	和元生物	108,544	975,810.56	0.10
77	600713	南京医药	201,300	974,292.00	0.10
78	300164	通源石油	203,800	972,126.00	0.10
79	000930	中粮科技	145,300	964,792.00	0.10
80	600740	山西焦化	191,200	963,648.00	0.10
81	688466	金科环境	54,280	963,470.00	0.10
82	002573	清新环境	194,600	963,270.00	0.10
83	603113	金能科技	118,900	959,523.00	0.10
84	688319	欧林生物	60,578	957,132.40	0.10
85	600172	黄河旋风	255,300	954,822.00	0.10

86	300422	博世科	158,700	950,613.00	0.10
87	000088	盐田港	193,100	942,328.00	0.09
88	002987	京北方	50,300	934,574.00	0.09
89	300065	海兰信	91,800	933,606.00	0.09
90	600675	中华企业	296,100	932,715.00	0.09
91	002950	奥美医疗	97,900	928,092.00	0.09
92	300291	百纳千成	134,800	868,112.00	0.09
93	300829	金丹科技	38,600	805,968.00	0.08
94	688069	德林海	36,762	730,828.56	0.07
95	600478	科力远	140,000	688,800.00	0.07
96	300740	水羊股份	29,600	493,432.00	0.05
97	601083	锦江航运	12,630	155,955.24	0.02
98	688569	铁科轨道	5,429	149,894.69	0.02
99	688620	安凯微	10,157	120,055.74	0.01
100	301550	斯菱股份	2,600	119,857.40	0.01
101	688631	莱斯信息	3,357	118,334.25	0.01
102	688603	天承科技	1,391	104,179.58	0.01
103	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.01
104	301469	恒达新材	2,743	92,493.47	0.01
105	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.01
106	301520	万邦医药	1,596	87,849.20	0.01
107	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.01
108	301170	锡南科技	2,496	75,953.28	0.01
109	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.01
110	603107	上海汽配	2,920	66,438.76	0.01
111	001306	夏厦精密	631	56,221.59	0.01
112	603119	浙江荣泰	2,253	54,448.02	0.01
113	688548	广钢气体	3,688	47,022.00	0.00
114	688563	航材股份	692	41,859.08	0.00
115	603276	恒兴新材	1,336	34,970.56	0.00
116	603296	华勤技术	356	27,679.00	0.00
117	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
118	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
119	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
120	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
121	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
122	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
123	301559	中集环科	1,090	19,881.60	0.00
124	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
125	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
126	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
127	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
128	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00

129	301345	涛涛车业	266	16,199.40	0.00
130	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
131	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
132	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
133	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
134	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
135	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
136	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
137	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
138	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
139	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
140	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
141	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
142	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
143	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
144	301376	致欧科技	420	10,046.40	0.00
145	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
146	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
147	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
148	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
149	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
150	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
151	001256	炜冈科技	474	8,773.74	0.00
152	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
153	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
154	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
155	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
156	301232	飞沃科技	165	8,000.85	0.00
157	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
158	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
159	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
160	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
161	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
162	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
163	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
164	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
165	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
166	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
167	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
168	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
169	002382	蓝帆医疗	100	668.00	0.00
170	000540	中天金融	100	1.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603486	科沃斯	30,058,038.34	2.56
2	688099	晶晨股份	27,884,491.62	2.37
3	600276	恒瑞医药	25,385,798.48	2.16
4	000100	TCL 科技	24,422,952.00	2.08
5	601318	中国平安	23,974,777.00	2.04
6	603338	浙江鼎力	23,069,774.20	1.96
7	600011	华能国际	22,094,794.00	1.88
8	300308	中际旭创	21,610,560.04	1.84
9	002984	森麒麟	20,373,829.44	1.73
10	600763	通策医疗	19,451,908.44	1.66
11	600030	中信证券	19,120,348.40	1.63
12	600380	健康元	19,007,271.52	1.62
13	002044	美年健康	18,891,716.88	1.61
14	000425	徐工机械	18,786,259.00	1.60
15	002850	科达利	18,648,465.00	1.59
16	000301	东方盛虹	18,457,157.93	1.57
17	601169	北京银行	17,572,191.00	1.50
18	300450	先导智能	17,246,785.73	1.47
19	000063	中兴通讯	16,965,882.72	1.44
20	002019	亿帆医药	16,608,967.04	1.41

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	47,267,128.30	4.02
2	601111	中国国航	38,943,101.64	3.31
3	600011	华能国际	38,673,746.00	3.29
4	688111	金山办公	33,938,915.45	2.89
5	300454	深信服	32,857,534.80	2.80
6	300760	迈瑞医疗	32,173,822.00	2.74
7	300308	中际旭创	28,938,270.19	2.46
8	601888	中国中免	28,925,261.00	2.46
9	600547	山东黄金	27,938,139.34	2.38
10	002850	科达利	27,447,232.92	2.34
11	688099	晶晨股份	27,057,334.40	2.30

12	002138	顺络电子	26,298,478.00	2.24
13	002463	沪电股份	25,874,248.11	2.20
14	002371	北方华创	25,409,189.00	2.16
15	600030	中信证券	23,863,220.10	2.03
16	603486	科沃斯	23,648,942.40	2.01
17	000333	美的集团	23,368,178.00	1.99
18	300782	卓胜微	22,854,999.20	1.94
19	300274	阳光电源	22,697,120.16	1.93
20	002142	宁波银行	22,190,748.80	1.89

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,308,699,567.04
卖出股票收入（成交）总额	4,323,903,387.35

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

2023 年 11 月 27 日，招商银行因办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事项，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2023〕42 号）没收违法所得人民币 89.03 万元，罚款人民币 475 万元。2023 年 12 月 13 日，招商银行因未按规定承担小微企业押品评估费等违法违规事项，被国家金融监督管理总局深圳监管局（深金罚决字〔2023〕81 号）罚款 160 万元。

2023 年 2 月 16 日，建设银行因公司治理和内部控制制度与监管规定不符、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2023〕10 号）给予没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元的行政处罚，其中，总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。2023 年 11 月 22 日，建设银行因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作等违法违规事项，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕29 号）没收违法所得并处罚款合计 3791.879382 万元，其中，总行 2041.879382 万元，分支机构 1750 万元。

2023 年 8 月 15 日，农业银行因农户贷款发放后流入房地产企业、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位等违法违规行为，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕8 号）没收违法所得并处罚款合计 4420.184584 万元，其中，对总行罚款 1760.092292 万元，没收违法所得 60.092292 万元，对分支机构罚款 2600 万元。2023 年 11 月 17 日，农业银行因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事项，被国家外汇管理局北京市分局（京汇罚〔2023〕32 号）给予警告，没收违法所得 1,418,524.70 元人民币，并处 553 万元人民币罚款。2023 年 11 月 16 日，农业银行因流动资金贷款被用于固定资产投资等违法违规事项，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕21 号）没收违法所得并处罚款合计 2710.9738 万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	119,320.18
2	应收清算款	8,800,515.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	233,044.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,152,880.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
83,866	16,879.73	11,518,450.14	0.81	1,404,116,701.35	99.19

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	942,000.05	0.07

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究	-

部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 11 月 8 日） 基金份额总额	1,762,466,123.89
本报告期期初基金份额总额	1,435,985,601.62
本报告期基金总申购份额	168,070,391.28
减：本报告期基金总赎回份额	188,420,841.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,415,635,151.49

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
国泰君安	1	3,586,580,678.49	41.64	3,359,772.10	41.80	-
浙商证券	1	2,923,276,079.94	33.94	2,711,970.94	33.74	-
中信建投	1	714,859,653.30	8.30	673,906.10	8.38	-
银河证券	2	543,383,743.01	6.31	508,553.41	6.33	-
招商证券	1	422,403,449.67	4.90	389,317.75	4.84	-
申万宏源	2	216,933,431.01	2.52	202,029.28	2.51	-
广发证券	1	206,502,288.10	2.40	192,489.77	2.39	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，交易能力较强，近三年无重大违法违规行为，在业内有良好的声誉；内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

11.7.2 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 (%)
国泰君安	1,433,077.60	54.38	-	-	-	-
浙商证券	276,753.35	10.50	-	-	-	-
中信建投	387,975.65	14.72	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	222,600.00	8.45	-	-	-	-

申万宏源	315,000.00	11.95	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 20 日
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（亿道信息）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（多利科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 17 日
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（宿迁联盛）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 15 日
5	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 30 日
6	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 21 日
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（友车科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 5 日
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（中科飞测）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 13 日
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（盘古智能）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 7 日
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（维科精密）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 14 日
11	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（华虹公司）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 28 日
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（德	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2023 年 8 月 9 日

	福科技)	站	
14	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 22 日
15	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 30 日
16	关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 31 日
17	关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 1 日
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(恒兴新材)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 19 日
19	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 22 日
20	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 22 日
21	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 24 日
22	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 10 日
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(京仪装备)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 23 日
24	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(锦江航运)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 29 日
25	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告(永达股份)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 5 日
26	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日
27	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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；

13.2 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>。

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

2024 年 3 月 27 日