华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
2025 年年度报告

2025 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告期自 2025 年 1 月 1 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 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 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 9

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 12
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.10 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遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 15

§6 审计报告 15

6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 16

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 19
7.3 净资产变动表 20
7.4 报表附注 23

§8 投资组合报告 53

8.1 期末基金资产组合情况.....53
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....54
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....54
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....55
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....58
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....61
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....61
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....61
8.11 投资组合报告附注.....61

§9 基金份额持有人信息.....62

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....62
9.2 期末上市基金前十名持有人.....63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....63
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....63

§10 开放式基金份额变动.....63

§11 重大事件揭示.....64

11.1 基金份额持有人大会决议.....64
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.....64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....64
11.4 基金投资策略的改变.....64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....64
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....66
11.8 其他重大事件.....68

§12 影响投资者决策的其他重要信息.....71

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.....71

§13 备查文件目录.....71

13.1 备查文件目录.....71
13.2 存放地点.....72
13.3 查阅方式.....72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金简称	华安恒生科技 ETF
场内简称	HS 科技（扩位简称：恒生科技 ETF 华安）
基金主代码	513580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 20 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	7,148,118,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 5 月 27 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。本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
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 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	恒生科技指数收益率（经汇率调整后）
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金为主要投资于香港市场的证券投资基金，需要承担汇率风险、香港证券市场投资所面临的特别投资风险。

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 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	徐勇	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	290,984,556.65	62,181,355.99	33,907,649.03
本期利润	32,796,769.21	385,642,974.88	-68,419,127.17

加权平均基金份额本期利润	0.0077	0.1171	-0.0263
本期加权平均净值利润率	1.03%	22.87%	-4.88%
本期基金份额净值增长率	19.48%	20.29%	-8.64%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-1,953,893,538.48	-1,389,137,241.39	-1,660,869,242.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2733	-0.3918	-0.4944
期末基金资产净值	5,194,224,461.52	2,155,980,758.61	1,698,248,757.13
期末基金份额净值	0.7267	0.6082	0.5056
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	-27.33%	-39.18%	-49.44%

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）。

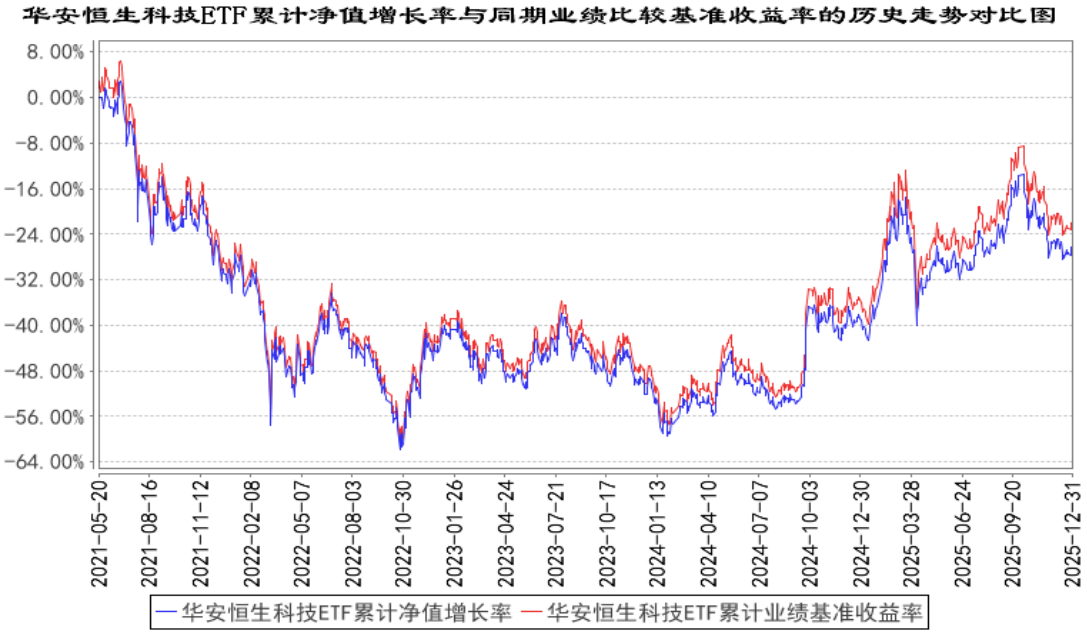
3.2 基金净值表现

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

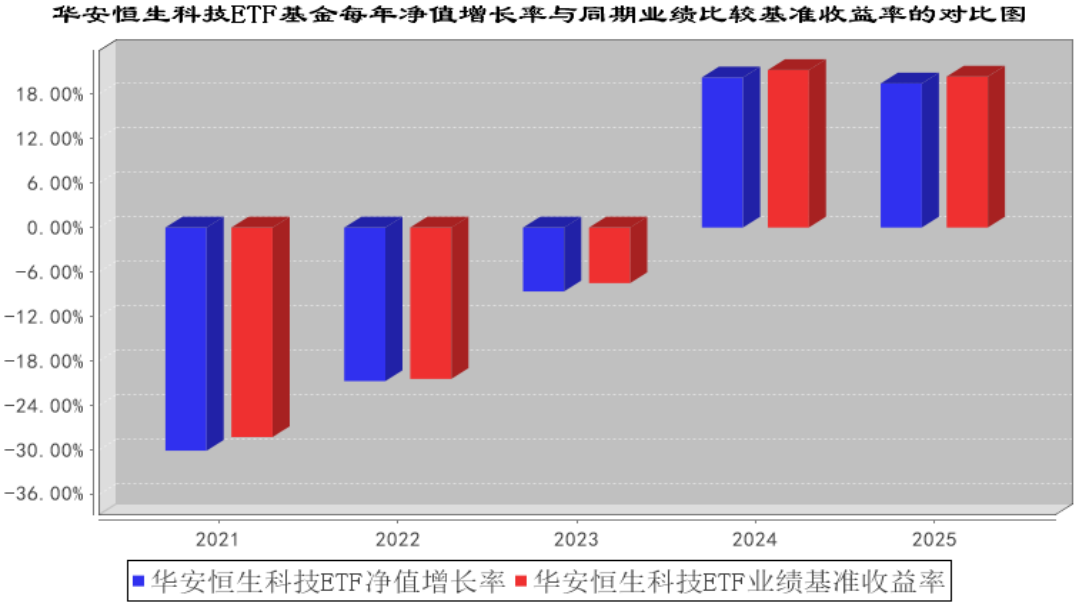
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-15.74%	1.63%	-15.60%	1.63%	-0.14%	0.00%
过去六个月	2.63%	1.56%	3.02%	1.56%	-0.39%	0.00%

过去一年	19.48%	2.18%	20.41%	2.20%	-0.93%	-0.02%
过去三年	31.32%	2.10%	35.09%	2.11%	-3.77%	-0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-27.33%	2.44%	-22.98%	2.45%	-4.35%	-0.01%

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



3.2.3 自基金合同生效以来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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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 2025 年 12 月 31 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 293 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,141.24 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		
倪斌	指数投资部副总监、本基金的基金经理	2021 年 5 月 20 日	-	15 年	硕士研究生，15 年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起，同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）、华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月至 2025 年 3 月，同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月至 2022 年 12 月，同时担任华安纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)(由华安纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来）的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经

					理。2020 年 5 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 1 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至 2023 年 11 月，同时担任华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 6 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月至 2025 年 3 月，同时担任华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 4 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 2 月起，同时担任华安恒生互联网科技业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2024 年 4 月起，同时担任华安恒生港股通中国央企红利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 5 月起，同时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。2024 年 6 月起，同时担任华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 11 月至 2024 年 12

					月，同时担任华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2024 年 12 月起，同时担任华安恒生生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）（由华安恒生香港上市生物科技指数型发起式证券投资基金（QDII）转型而来）的基金经理。2025 年 5 月起，同时担任华安恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月起，同时担任华安恒生生物科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
王超	本基金的基金经理	2025 年 3 月 31 日	-	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经验，2014 年应届毕业加入华安基金，历任基金运营部基金会计，指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2025 年 3 月起，王超先生同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、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、华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）及其联接基金的基金经理。2025 年 6 月起，同时担任华安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、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。2025 年 8 月起，同时担任华安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起，同时担任华安国证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 11 月至 2025 年 12 月，同时担任华安恒生港股通科技主题指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 12 月起，同时担任华安恒生港股通科技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（由华安恒生港股通科技主题指数型发起式证券投资基金转型而来）。
王超	本基金的基金经理助理	2025 年 3 月 3 日	2025 年 3 月 31 日	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经验，2014 年应届毕业加入华安基金，历任基金运营部基金会计，指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2025 年 3 月起，担任指数与量化投资部基金经理。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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，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。

4.4.2 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。

4.4.3 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 2 次，未出现异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 年，港股宏观环境显著改善，海外美联储三次降息累计 75 个基点，全球流动性相对宽松；国内经济持续温和复苏，企业盈利预期逐步上修。年初由 DeepSeek 引爆 AI 行情，推动港股 AI 产业链全线爆发，包括算力、大模型、云服务、半导体等集体走强。年中平台经济业绩回暖，AI 应用落地与硬科技国产替代持续推进。四季度以来，受美联储释放鹰派信号、美债收益率上行、海外对于 AI 泡沫担忧等影响，全球科技股波动加大，指数出现明显回调；全年看，指数整体表现较好。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7267 元，本报告期份额净值增长率为 19.48%，同期业绩比较基准增长率为 20.41%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026，国内进入“十五五”开局之年，扩内需与产业升级政策持续加码，经济有望维持稳步上行趋势。海外方面，美联储预计延续降息周期，整体看，国内宏观与海外流动性环境整体对港股偏有利，国内数字经济、人工智能、半导体国产化政策预计持续加码，产业资本投入力度加大，AI 浪潮逐步商业化与业绩验证的关键阶段。AI 应用、大模型商业化、半导体设备与材料、

互联网广告与云业务等将成为港股科技与互联网板块业绩的核心驱动力。但也需要密切关注一些风险因素，包括海外地缘事件冲击、美联储超预期的货币政策收紧、海外 AI 产业链泡沫担忧等，都可能对于港股市场，尤其是科技板块带来较大的冲击和扰动。

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。

4.7 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。

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。坚持全流程合规与风险管控，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。通过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。

公司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有效提升，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，不断提高合规与风险管理水平，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。

4.8 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。

4.9 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。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（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）、投资组合报告等财务数据真实、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	毕马威华振审字第 2604055 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	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的

	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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (1)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。 (2)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。 (3)评价该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。 (4)对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。 (5)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。 我们与该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。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	虞京京　　朱伊俐
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	143,548,050.95	148,854,554.11
结算备付金		96,629,232.89	37,595,141.23
存出保证金		39,335,284.44	29,764,729.75
交易性金融资产	7.4.7.2	4,944,485,826.59	1,950,228,341.30
其中：股票投资		4,944,485,826.59	1,950,228,341.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	-
应收股利		337.38	345.04
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		5,223,998,732.25	2,166,443,111.43
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**	**上年度末 2024 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		26,162,902.76	8,536,438.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,206,980.26	944,392.25
应付托管费		441,396.06	188,878.46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	408,957.27

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	962,991.65	383,686.51
负债合计		29,774,270.73	10,462,352.82
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	7,148,118,000.00	3,545,118,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-1,953,893,538.48	-1,389,137,241.39
净资产合计		5,194,224,461.52	2,155,980,758.61
负债和净资产总计		5,223,998,732.25	2,166,443,111.43

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7267 元，基金份额总额 7,148,118,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		52,441,724.27	396,199,842.25
1.利息收入		622,862.28	414,027.08
其中：存款利息收入	7.4.7.9	622,862.28	414,027.08
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）		300,652,402.63	71,637,055.99
其中：股票投资收益	7.4.7.10	257,417,338.25	40,206,241.77
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	22,157,267.08	18,702,785.70
股利收益	7.4.7.15	21,077,797.30	12,728,028.52

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）	7.4.7.16	-258,187,787.44	323,461,618.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,731,830.61	1,976,960.28
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,086,077.41	-1,289,819.99
减：二、营业总支出		19,644,955.06	10,556,867.37
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	15,824,269.99	8,452,581.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	3,164,854.04	1,690,516.37
3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.18	-	-
7．税金及附加		203,975.56	67,762.30
8．其他费用	7.4.7.19	451,855.47	346,007.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,796,769.21	385,642,974.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,796,769.21	385,642,974.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		32,796,769.21	385,642,974.88

7.3 净资产变动表

会计主体：华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	3,545,118,000.00	-	-1,389,137,241.1	2,155,980,758.61

			39	
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,545,118,000.00	-	-1,389,137,241.39	2,155,980,758.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,603,000,000.00	-	-564,756,297.09	3,038,243,702.91
（一）、综合收益总额	-	-	32,796,769.21	32,796,769.21
（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）	3,603,000,000.00	-	-597,553,066.30	3,005,446,933.70
其中：1.基金申购款	5,933,000,000.00	-	-1,369,543,542.80	4,563,456,457.20
2.基金赎回款	-2,330,000,000.00	-	771,990,476.50	-1,558,009,523.50
（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	7,148,118,000.00	-	-1,953,893,538.48	5,194,224,461.52

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,359,118,000.00	-	-1,660,869,242.87	1,698,248,757.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,359,118,000.00	-	-1,660,869,242.87	1,698,248,757.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	186,000,000.00	-	271,732,001.48	457,732,001.48
（一）、综合收益总额	-	-	385,642,974.88	385,642,974.88
（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）	186,000,000.00	-	-113,910,973.40	72,089,026.60
其中：1.基金申购款	2,080,000,000.00	-	-1,001,766,762.15	1,078,233,237.85
2.基金赎回款	-1,894,000,000.00	-	887,855,788.75	-1,006,144,211.25
（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	3,545,118,000.00	-	-1,389,137,241.39	2,155,980,758.61

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1546 号《关于准予华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》的核准，由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 5 月 20 日生效，首次设立募集规模为 455,118,000.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外托管人为中国银行（香港）有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2021]213 号文核准，本基金 455,118,000.00 份基金份额于 2021 年 5 月 27 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》和《华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书》的有关规定，本基金可投资于境内、境外市场。具体而言：针对境外投资，基金可投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；

远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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。针对境内投资，本基金可投资于其他股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、短期融资券等）、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）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：恒生科技指数收益率（经汇率调整后）。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）。华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

价值变动计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可以进行收益分配；

在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式为现金分红；

基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基

金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。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。

(d) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

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

(f) 对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区

现行税法规定缴纳印花税。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	143,548,050.95	148,854,554.11
等于：本金	143,537,565.64	148,839,710.56
加：应计利息	10,485.31	14,843.55
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	143,548,050.95	148,854,554.11

注：于 2025 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 103,798,760.56 元，港币活期存款 40,185,963.83 元(折合人民币 36,296,766.25 元)，美元活期存款 491,196.81 元(折合人民币 3,452,524.14 元)（于 2024 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 110,388,230.70 元，港币活期存款 37,855,448.94 元(折合人民币 35,055,659.94 元)，美元活期存款 474,467.68 元(折合人民币 3,410,663.47 元)）。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,024,968,654.58	-	4,944,485,826.59	-80,482,827.99
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	5,024,968,654.58	-	4,944,485,826.59	-80,482,827.99

项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,773,999,765.07	-	1,950,228,341.30	176,228,576.23
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		1,773,999,765.07	-	1,950,228,341.30	176,228,576.23

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	239,522,749.22	-	-	-
其中：股指期货投资	239,522,749.22	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	239,522,749.22	-	-	-

项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍	-	-	-	-

生工具				
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	187,588,490.76	-	-	-
其中：股指期货投资	187,588,490.76	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	187,588,490.76	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
HTI2603	HTI2603	952.00	238,397,693.24	-1,125,055.98
合计				-1,125,055.98
减:可抵销期货暂收款				-1,125,055.98
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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	779,991.65	320,686.51
其中：交易所市场	779,991.65	320,686.51
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提审计费	63,000.00	63,000.00
预提信息披露费	120,000.00	-
合计	962,991.65	383,686.51

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,545,118,000.00	3,545,118,000.00
本期申购	5,933,000,000.00	5,933,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,330,000,000.00	-2,330,000,000.00
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	7,148,118,000.00	7,148,118,000.00

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。

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	-118,033,476.44	-1,271,103,764.95	-1,389,137,241.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-118,033,476.44	-1,271,103,764.95	-1,389,137,241.39
本期利润	290,984,556.65	-258,187,787.44	32,796,769.21
本期基金份额交易产生的变动数	320,005,963.95	-917,559,030.25	-597,553,066.30
其中：基金申购款	327,478,489.04	-1,697,022,031.84	-1,369,543,542.80
基金赎回款	-7,472,525.09	779,463,001.59	771,990,476.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	492,957,044.16	-2,446,850,582.64	-1,953,893,538.48

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	525,676.53	301,708.01
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	95,633.21	108,097.04
其他	1,552.54	4,222.03
合计	622,862.28	414,027.08

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	257,417,338.25	40,206,241.77
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	257,417,338.25	40,206,241.77

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,210,569,609.70	1,396,204,943.91
减：卖出股票成本总额	1,942,612,219.14	1,351,628,369.89
减：交易费用	10,540,052.31	4,370,332.25
买卖股票差价收入	257,417,338.25	40,206,241.77

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间

		2024年1月1日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,558,009,523.50	1,006,144,211.25
减：现金支付赎回款总额	1,558,009,523.50	1,006,144,211.25
减：赎回股票成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	22,157,267.08	18,702,785.70

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

股票投资产生的股利收益	21,077,797.30	12,728,028.52
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	21,077,797.30	12,728,028.52

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-256,711,404.22	323,471,406.50
股票投资	-256,711,404.22	323,471,406.50
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	-1,476,383.22	-9,787.61
权证投资	-	-
期货投资	-1,476,383.22	-9,787.61
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	-258,187,787.44	323,461,618.89

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	15,086,077.41	-1,289,819.99
合计	15,086,077.41	-1,289,819.99

7.4.7.18 信用减值损失

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	63,000.00	63,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	66,286.70	21,416.92
证券组合费	185,198.87	91,362.97
其他	17,369.90	50,227.20
合计	451,855.47	346,007.09

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”)	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外托管人
国泰海通证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海国际集团投资有限公司	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
华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(“华安恒生科技 ETF 联接基金”)	该基金是本基金的联接基金

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

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

2、本公司股东“上海上国投资产管理有限公司”自 2025 年 8 月 26 日起更名为“上海国际集团投资有限公司”。

3、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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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（%）
国泰海通证券股份有限公司	432,080,298.21	5.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	1,300,766,224.92	46.71

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025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（%）
国泰海通证券股份有限公司	112,340.13	4.99	112,340.13	14.40
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	687,549.32	54.78	131,765.71	41.09

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》，自 2024 年 7 月 1 日起，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。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,824,269.99	8,452,581.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	768,659.14	183,729.27
应支付基金管理人的净管理费	15,055,610.85	8,268,852.34
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,164,854.04	1,690,516.37

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额 的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
中国银行股份有限公司－华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	4,842,321,000.00	67.74	1,284,779,600.00	36.24

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国银行	103,799,210.88	525,676.53	110,388,662.91	301,708.01
中银香港	39,748,840.07	-	38,465,891.20	-

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金是股票型指数基金，预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金；本基金主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。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(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，从而能够紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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、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。

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及其委托的境外托管行，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。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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，通过对投资品种的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。

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。

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》(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 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。

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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	143,548,050.95	-	-	-	143,548,050.95
结算备付金	20,303,981.98	-	-	76,325,250.91	96,629,232.89
存出保证金	104,826.60	-	-	39,230,457.84	39,335,284.44
交易性金融资产	-	-	-	4,944,485,826.59	4,944,485,826.59
应收股利	-	-	-	337.38	337.38
资产总计	163,956,859.53	-	-	5,060,041,872.72	5,223,998,732.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,206,980.26	2,206,980.26
应付托管费	-	-	-	441,396.06	441,396.06
应付清算款	-	-	-	26,162,902.76	26,162,902.76
其他负债	-	-	-	962,991.65	962,991.65
负债总计	-	-	-	29,774,270.73	29,774,270.73
利率敏感度缺口	163,956,859.53	-	-	5,030,267,601.99	5,194,224,461.52
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	148,854,554.11	-	-	-	148,854,554.11
结算备付金	3,342.90	-	-	37,591,798.33	37,595,141.23
存出保证金	21.52	-	-	29,764,708.23	29,764,729.75
交易性金融资产	-	-	-	1,950,228,341.30	1,950,228,341.30
应收股利	-	-	-	345.04	345.04
资产总计	148,857,918.53	-	-	2,017,585,192.90	2,166,443,111.43
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	944,392.25	944,392.25
应付托管费	-	-	-	188,878.46	188,878.46
应付清算款	-	-	-	8,536,438.33	8,536,438.33
应交税费	-	-	-	408,957.27	408,957.27
其他负债	-	-	-	383,686.51	383,686.51
负债总计	-	-	-	10,462,352.82	10,462,352.82

利率敏感度缺口	148,857,918.53	-	-	2,007,122,840.08	2,155,980,758.61

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 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 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(2024 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	3,452,524.14	36,296,766.25	-	39,749,290.39
结算备付金	-	76,325,250.91	-	76,325,250.91
存出保证金	-	39,230,457.84	-	39,230,457.84
交易性金融资产	-	4,944,485,826.59	-	4,944,485,826.59
应收股利	337.38	-	-	337.38
资产合计	3,452,861.52	5,096,338,301.59	-	5,099,791,163.11
以外币计价的负债				
应付清算款	-	4,904,781.89	-	4,904,781.89
负债合计	-	4,904,781.89	-	4,904,781.89

资产负债表外汇风险敞口净额	3,452,861.52	5,091,433,519.70	-	5,094,886,381.22
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	3,410,663.47	35,055,659.94	-	38,466,323.41
结算备付金	-	37,591,798.33	-	37,591,798.33
存出保证金	-	29,764,708.23	-	29,764,708.23
交易性金融资产	-	1,950,228,341.30	-	1,950,228,341.30
应收股利	345.04	-	-	345.04
资产合计	3,411,008.51	2,052,640,507.80	-	2,056,051,516.31
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	3,411,008.51	2,052,640,507.80	-	2,056,051,516.31

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	所有外币相对人民币升值 5%	254,744,319.06	102,802,575.82
	所有外币相对人民币贬值 5%	-254,744,319.06	-102,802,575.82

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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	4,944,485,826.59	95.19	1,950,228,341.30	90.46
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	4,944,485,826.59	95.19	1,950,228,341.30	90.46

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 （2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	257,843,920.95	107,513,182.52
	业绩比较基准下降 5%	-257,843,920.95	-107,513,182.52

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	4,944,485,826.59	1,950,228,341.30
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	4,944,485,826.59	1,950,228,341.30

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。

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

无。

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

无。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 03 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§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	4,944,485,826.59	94.65
	其中：普通股	4,944,485,826.59	94.65
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	240,177,283.84	4.60
8	其他各项资产	39,335,621.82	0.75
9	合计	5,223,998,732.25	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,891,376,716.88 元，占基金资产净值比例为 74.92%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	4,944,485,826.59	95.19
合计	4,944,485,826.59	95.19

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	2,147,013,229.15	41.33
日常消费品	122,198,507.98	2.35
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	1,318,180,000.53	25.38
通信服务	1,357,094,088.93	26.13
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	4,944,485,826.59	95.19

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

8.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	MEITUAN-CLASS B	美团	3690 HK	香港	中国香港	4,622,800	431,319,379.47	8.30
2	SEMICONDUCTOR MANUFACTURI-H	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港	中国香港	6,425,000	414,637,818.33	7.98
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港	中国香港	723,000	391,163,807.94	7.53
4	XIAOMI CORP-CLASS B	小米集团	1810 HK	香港	中国香港	10,960,600	389,063,442.09	7.49
5	NETEASE INC	网易股份有限公司	9999 HK	香港	中国香港	1,988,000	385,336,051.86	7.42
6	BYD CO LTD-H	比亚迪股份有限公司	1211 HK	香港	中国香港	4,456,500	383,802,813.33	7.39
7	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港	中国香港	2,841,400	366,483,249.18	7.06
8	JD.COM INC-	京东集团股份有限公	9618 HK	香港	中国香港	2,503,116	252,312,470.78	4.86

	CLASS A	司						
9	KUAISHOU TECHNOLOGY	快手科技	1024 HK	香港	中国香港	4,319,600	249,504,065.71	4.80
10	BAIDU INC-CLASS A	百度集团股份有限公司	9888 HK	香港	中国香港	1,767,000	209,872,650.81	4.04
11	TRIP.COM GROUP LTD	携程集团有限公司	9961 HK	香港	中国香港	344,550	172,407,265.85	3.32
12	XPENG INC - CLASS A SHARES	小鹏汽车有限公司	9868 HK	香港	中国香港	2,317,700	166,110,734.07	3.20
13	LI AUTO INC-CLASS A	理想汽车	2015 HK	香港	中国香港	1,986,900	116,380,317.00	2.24
14	HORIZON ROBOTICS INC	地平綫	9660 HK	香港	中国香港	14,864,400	116,267,630.37	2.24
15	SENSETIME GROUP INC-CLASS B	商汤集团股份有限公司	20 HK	香港	中国香港	46,935,000	93,263,787.54	1.80
16	LENOVO GROUP LTD	联想集团有限公司	992 HK	香港	中国香港	10,626,000	88,873,921.57	1.71
17	JD HEALTH INTERNATIO	京东健康股份有限公司	6618 HK	香港	中国香港	1,599,850	80,198,416.69	1.54

	NAL INC							
18	BILIBILI INC-CLASS Z	哔哩哔哩股份有限公司	9626 HK	香港	中国香港	442,980	77,180,909.51	1.49
19	HAIER SMART HOME CO LTD-H	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港	中国香港	3,467,800	76,049,483.75	1.46
20	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD-H	华虹半导体有限公司	1347 HK	香港	中国香港	1,043,000	69,994,943.58	1.35
21	MIDEA GROUP CO LTD-H	美的集团股份有限公司	300 HK	香港	中国香港	881,100	67,605,515.71	1.30
22	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港	中国香港	1,016,000	60,153,368.14	1.16
23	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港	中国香港	4,308,000	51,712,343.69	1.00
24	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOL-H	浙江零跑科技股份有限公司	9863 HK	香港	中国香港	1,049,700	46,097,109.85	0.89
25	ALIBABA HEALTH INFORMATIO	阿里健康信息技术有限公司	241 HK	香港	中国香港	9,208,000	42,000,091.29	0.81

	N T							
26	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	同程旅行控股有限公司	780 HK	香港	中国香港	2,012,000	40,779,732.68	0.79
27	KINGSOFT CORP LTD	金山软件有限公司	3888 HK	香港	中国香港	1,499,600	38,521,090.17	0.74
28	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港	中国香港	1,126,000	34,212,745.22	0.66
29	NIO INC-CLASS A	蔚来集团	9866 HK	香港	中国香港	747,790	27,665,157.48	0.53
30	TENCENT MUSIC ENT - CLASS A	腾讯音乐娱乐集团	1698 HK	香港	中国香港	88,500	5,515,512.93	0.11

8.4.2 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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	472,938,912.75	21.94
2	BYD CO LTD-H	1211 HK	472,022,375.39	21.89
3	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	466,035,934.03	21.62
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	378,662,604.71	17.56

5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	360,724,942.15	16.73
6	SEMICONDUCTOR MANUFACTURI-H	981 HK	339,089,063.43	15.73
7	NETEASE INC	9999 HK	331,403,755.55	15.37
8	JD.COM INC-CLASS A	9618 HK	290,663,293.70	13.48
9	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	268,136,854.25	12.44
10	LI AUTO INC-CLASS A	2015 HK	179,901,104.87	8.34
11	XPENG INC - CLASS A SHARES	9868 HK	177,617,354.77	8.24
12	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	170,722,353.54	7.92
13	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	159,965,799.38	7.42
14	HORIZON ROBOTICS INC	9660 HK	143,536,313.62	6.66
15	LENOVO GROUP LTD	992 HK	116,161,010.71	5.39
16	SENSETIME GROUP INC-CLASS B	20 HK	86,959,068.63	4.03
17	HAIER SMART HOME CO LTD-H	6690 HK	81,923,243.58	3.80
18	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	76,729,154.11	3.56
19	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	74,677,567.06	3.46
20	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	74,002,186.82	3.43
21	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	60,507,989.13	2.81
22	MIDEA GROUP CO LTD-H	300 HK	58,870,894.73	2.73
23	ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOL-H	9863 HK	50,171,345.62	2.33
24	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	48,854,048.57	2.27
25	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD-H	1347 HK	47,093,810.05	2.18
26	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	46,716,464.38	2.17

27	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	43,441,898.59	2.01

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	233,978,687.03	10.85
2	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	216,419,842.22	10.04
3	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	166,317,055.72	7.71
4	SEMICONDUCTOR MANUFACTURI-H	981 HK	163,427,757.52	7.58
5	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	147,461,558.49	6.84
6	LI AUTO INC-CLASS A	2015 HK	128,704,391.11	5.97
7	JD.COM INC-CLASS A	9618 HK	120,874,287.57	5.61
8	XPENG INC - CLASS A SHARES	9868 HK	101,668,630.48	4.72
9	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	97,277,383.50	4.51
10	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	89,967,610.55	4.17
11	LENOVO GROUP LTD	992 HK	81,502,508.24	3.78
12	NETEASE INC	9999 HK	72,104,166.32	3.34
13	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	56,509,557.48	2.62
14	HAIER SMART HOME CO LTD-H	6690 HK	56,154,172.39	2.60
15	ASMPT LTD	522 HK	52,238,936.51	2.42
16	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	50,869,243.30	2.36
17	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	41,912,472.43	1.94
18	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	39,474,447.78	1.83
19	SENSETIME GROUP INC-CLASS B	20 HK	36,265,881.69	1.68

20	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	35,413,445.02	1.64

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,193,581,108.65
卖出收入（成交）总额	2,210,569,609.70

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货品种_股指	HTI2603	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为人民币-1,125,055.98 元，已包含在结算备付金中。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	39,335,284.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	337.38
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	39,335,621.82

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 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。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票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

9.1.1 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（%）
21,987	325,106.56	5,738,005,396.00	80.27	1,410,112,604.00	19.73

9.1.2 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－华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	4,842,321,000.00	67.74

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司－分红－个险分红	207,117,700.00	2.90
2	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	206,228,800.00	2.89
3	中国平安人寿保险股份有限公司－万能－个险万能	205,569,300.00	2.88
4	新华人寿保险股份有限公司	192,435,000.00	2.69
5	王大敏	22,895,900.00	0.32
6	UBS AG	16,615,471.00	0.23
7	黎旭晖	12,671,900.00	0.18
8	BARCLAYS BANK PLC	10,840,987.00	0.15
9	王卫刚	10,100,000.00	0.14
10	国联信托股份有限公司	10,000,000.00	0.14
11	中国银行股份有限公司－华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）	4,842,321,000.00	67.74

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 5 月 20 日）基金份额总额	455,118,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,545,118,000.00
本报告期基金总申购份额	5,933,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,330,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,148,118,000.00

§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：

2025 年 8 月 28 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，朱学华先生离任本基金管理人的董事长，徐勇先生新任本基金管理人的董事长。

2025 年 9 月 27 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，谷媛媛女士离任本基金管理人的副总经理。

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：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

报告年度本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 63,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2024 年 11 月 9 日起至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人

受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正、暂停受理固定收益类公募基金产品注册申请 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、人员管理、公司治理、其他问题：基金销售、财务管理
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》、《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》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、优化管理机制、加强事后检查等多种方式完成整改并通过监管机构检查验收。目前已恢复受理公司固定收益类公募基金产品注册。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3；高级管理人员 4；
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函；出具警示函；
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、人员管理、其他问题：基金销售、财务管理；投资运作、合规内控；其他问题：基金销售、财务管理；其他问题：财务管理；
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》、《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》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、优化管理机制、加强事后检查等多种方式完成整改并通过监管机构检查验收。目前已恢复受理公司固定收益类公募基金产品注册。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

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(%)	
国信证券	1	3,436,250,561.58	46.41	893,424.19	39.68	-
华泰证券	1	2,175,243,121.10	29.38	565,562.12	25.12	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Ltd	-	833,786,223.41	11.26	416,893.10	18.52	-
Instinet	-	525,513,268.56	7.10	262,756.67	11.67	-
国泰海通	4	432,080,298.21	5.84	112,340.13	4.99	-
Morgan Stanley	-	1,277,245.50	0.02	638.62	0.03	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-

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：无。

撤销交易单元的证券公司：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		基金交易	
	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiwa Capital Markets Hong Kong Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 1 月 8 日

2	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中航证券有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 1 月 8 日
3	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024 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	2025 年 1 月 22 日
4	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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	2025 年 1 月 22 日
5	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西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	2025 年 2 月 27 日
6	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（2025 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	2025 年 2 月 28 日
7	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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	2025 年 2 月 28 日
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 20 日
9	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 20 日
10	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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	2025 年 3 月 29 日
11	华安基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 29 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
13	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2024 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	2025 年 3 月 31 日
14	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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	2025 年 4 月 2 日
15	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（2025 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	2025 年 4 月 2 日
16	华安基金管理有限公司关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规	2025 年 4 月 7 日

	基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告-盘中	定媒介	
17	华安基金管理有限公司关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 8 日
18	关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 15 日
19	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日
20	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日
21	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 6 月 16 日
22	关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 6 月 26 日
23	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 2 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	2025 年 7 月 21 日
24	华安基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 28 日
25	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 30 日
26	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 27 日
27	华安基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 27 日
28	关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 24 日
29	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 3 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	2025 年 10 月 28 日
30	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规	2025 年 10 月 28 日

	告	定媒介	
31	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金变更扩位证券简称的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 29 日
32	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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	2025 年 10 月 29 日
33	华安基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 11 月 10 日
34	华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书（2025 年第 3 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 11 月 13 日
35	关于华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 19 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。

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
联接基金	1	20250101~20251231	1,284,779,600.00	5,718,920,100.00	2,161,378,700.00	4,842,321,000.00	67.74
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。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、《华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

2、《华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》

3、《华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

4、中国证监会批准华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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

2026 年 3 月 31 日