

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60

8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
9 开放式基金份额变动	62
10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	64
10.9 其他重大事件	64
11 影响投资者决策的其他重要信息	66
12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

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	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
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	2,002,582,519.27 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	<p>(1) 资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资:本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分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。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。

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 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
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	270,208,482.24
本期利润	191,561,363.81
加权平均基金份额本期利润	0.0905
本期加权平均净值利润率	8.81%
本期基金份额净值增长率	7.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	1,425,757,894.54
期末可供分配基金份额利润	0.7120
期末基金资产净值	2,160,190,461.58
期末基金份额净值	1.079
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	640.73%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于

所列数字。

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

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

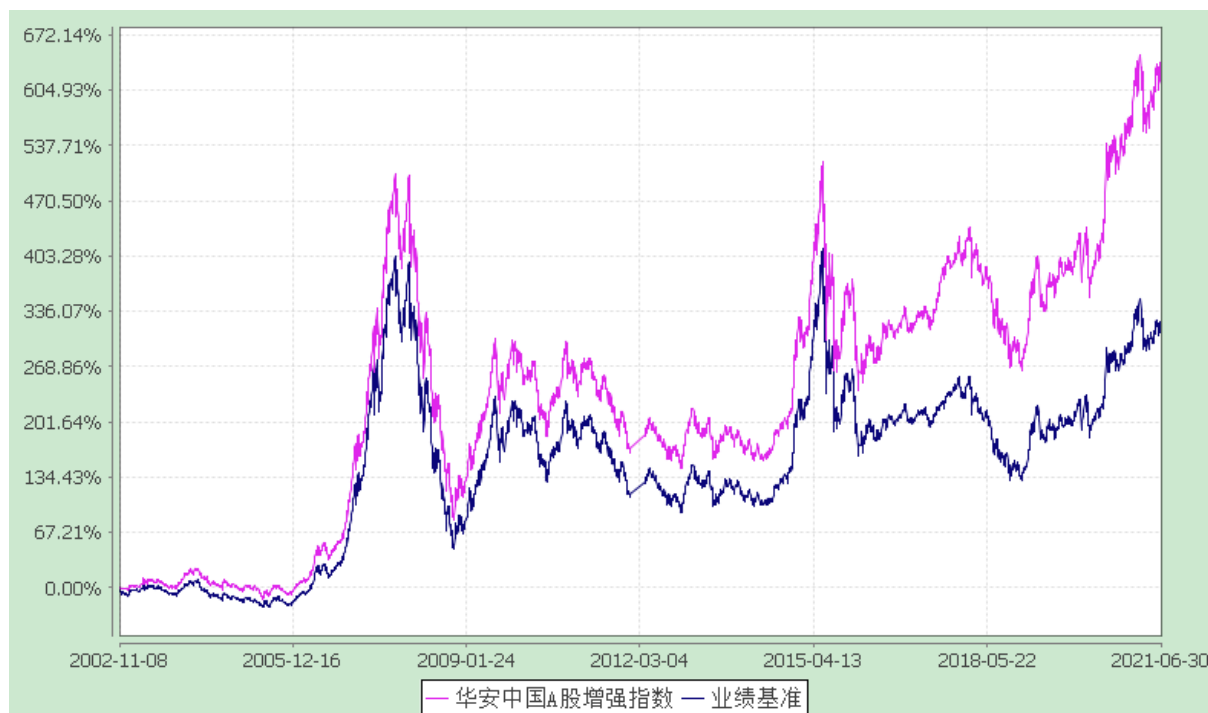
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.75%	0.87%	-0.66%	0.79%	1.41%	0.08%
过去三个月	10.33%	1.00%	6.07%	0.90%	4.26%	0.10%
过去六个月	7.47%	1.37%	2.73%	1.22%	4.74%	0.15%
过去一年	34.07%	1.38%	24.96%	1.26%	9.11%	0.12%
过去三年	68.52%	1.37%	51.10%	1.32%	17.42%	0.05%
自基金合同生效起至今	640.73%	1.56%	322.16%	1.54%	318.57%	0.02%

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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2002 年 11 月 8 日至 2021 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金	2017-12-2	-	17 年	理学博士，17 年证券、基金从业

	<p>经理、指数与 量化投资部高 级总监、总经 理助理</p>	<p>5</p>		<p>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，同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安中证全指证券公司指数型证券投资基金)、华安中证银行指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安中证银行指数型证券投资基金) 的基金经理。2015 年 7 月至 2021 年 1 月，担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金 (2021 年 1 月起转型为华安创业板 50 指数型证券投资基金) 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</p>
--	---	----------	--	--

					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。
马韬	本基金的基金经理	2018-01-15	-	6 年	硕士研究生，6 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 月起，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。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
许之彦	公募基金	11.00	59,074,195,142.53	2008-04-25
	私募资产管理计划	3.00	292,810,199.40	2021-01-22
	其他组合	-	-	-
	合计	14.00	59,367,005,341.93	

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日

反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 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

2021 年上半年欧美经济继续复苏，美国由于财政支出力度加大资金面非常宽松，美债收益率震荡下行。国内经济继续保持复苏，出口继续保持强劲增长，货币政策基调继续以稳为主，资金流动性相对宽松。在相对友好的宏观环境下，权益市场在 3 月底触底后开启了近 1 个季度的反弹，尤其以科创板、创业板为代表的新兴经济大幅跑赢市场。

从因子模型表现来看，上半年的大类因子风格与过去两年的风格表现较为不同，成长与估值的分化大幅缩小，分析师预期因子领跑全市场，与此同时盈利因子表现仍然强势。本基金配置上仍然坚持基本面较好且与技术面共振的价值股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.079 元，本报告期份额净值增长率为 7.47%，同期业绩比较基准增长率为 2.73%。

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 2021 年下半年，随着新冠疫苗不断推进全球宏观经济将相继回到正常化水平，虽然疫情的平息大概率还有波折，但正常化的预期不可逆。我们继续维持之前的判断，虽然近期宏观数据实证了工业企业处于景气周期之中，但应该已经逐渐接近短期顶点。国内资金面可能过了最宽松的时候，尤其需要担心海内外联动，出口在下半年可能也逐步度过景气高点。

对证券市场整体的判断应该是震荡偏防御的格局，估值存在一定的压力，配置上将重点考虑后周期板块以及通胀交易板块。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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，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，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方

面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金对基金份额持有人未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	34,877,813.26	98,191,224.13
结算备付金		5,556,236.26	8,508,396.57
存出保证金		603,022.92	645,178.99
交易性金融资产	6.4.7.2	2,127,186,743.79	2,646,839,805.63
其中：股票投资		2,038,790,401.43	2,566,265,890.43
基金投资		-	-
债券投资		88,396,342.36	80,573,915.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,585,732.17	16,167,417.92
应收利息	6.4.7.5	846,209.32	2,863,531.20
应收股利		-	-
应收申购款		1,799,228.95	376,965.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,176,454,986.67	2,773,592,520.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,963,221.84	12,483,495.12
应付赎回款		6,743,911.57	7,426,277.62
应付管理人报酬		1,747,989.48	2,373,578.14
应付托管费		349,597.88	474,715.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,850,686.48	8,648,989.14
应交税费		21.90	49.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	609,095.94	717,052.11
负债合计		16,264,525.09	32,124,157.56
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	610,277,661.63	832,068,832.68
未分配利润	6.4.7.10	1,549,912,799.95	1,909,399,530.17
所有者权益合计		2,160,190,461.58	2,741,468,362.85
负债和所有者权益总计		2,176,454,986.67	2,773,592,520.41

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.079 元，基金份额总额 2,002,582,519.27 份。

6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		215,610,986.47	203,063,297.42
1.利息收入		1,415,044.81	1,438,011.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	167,401.92	288,762.83
债券利息收入		1,247,642.89	1,149,248.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		292,819,500.17	209,743,141.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	283,257,818.14	186,699,620.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,317,729.98	3,733.73

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	11,879,412.01	23,039,787.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-78,647,118.43	-8,220,497.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	23,559.92	102,641.73
减：二、费用		24,049,622.66	25,643,881.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,801,071.50	12,702,258.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,160,214.27	2,540,451.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,969,602.57	10,282,279.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		5.41	6.33
7. 其他费用	6.4.7.19	118,728.91	118,885.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		191,561,363.81	177,419,416.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		191,561,363.81	177,419,416.07

6.3 所有者权益（基金净值）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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	832,068,832.68	1,909,399,530.17	2,741,468,362.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	191,561,363.81	191,561,363.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-221,791,171.05	-551,048,094.03	-772,839,265.08
其中：1.基金申购款	56,925,047.99	134,983,984.79	191,909,032.78
2.基金赎回款	-278,716,219.04	-686,032,078.82	-964,748,297.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	610,277,661.63	1,549,912,799.95	2,160,190,461.58
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	967,114,844.88	1,710,061,547.64	2,677,176,392.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	177,419,416.07	177,419,416.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-81,062,784.71	-143,730,987.44	-224,793,772.15
其中: 1.基金申购款	111,949,602.95	189,072,827.69	301,022,430.64
2.基金赎回款	-193,012,387.66	-332,803,815.13	-525,816,202.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	886,052,060.17	1,743,749,976.27	2,629,802,036.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 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×95%+金融同业存款利率×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 2021 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间

的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	34,877,813.26
定期存款	-
其他存款	-
合计	34,877,813.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,816,578,145.20	2,038,790,401.43	222,212,256.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,348,342.36	2,237,242.36
	银行间市场	80,048,000.00	190,400.00
	合计	88,396,342.36	2,427,642.36
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,902,546,845.20	2,127,186,743.79	224,639,898.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,183.67
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,250.36
应收债券利息	839,531.03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	244.26
合计	846,209.32

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,847,905.29
银行间市场应付交易费用	2,781.19
合计	3,850,686.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	49,588.57
其他	500,000.00
合计	609,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,730,307,040.56	832,068,832.68
本期申购	186,799,774.11	56,925,047.99
本期赎回（以“-”号填列）	-914,524,295.40	-278,716,219.04
本期末	2,002,582,519.27	610,277,661.63

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	1,608,705,501.03	300,694,029.14	1,909,399,530.17
本期利润	270,208,482.24	-78,647,118.43	191,561,363.81
本期基金份额交易产生的变动数	-453,156,088.73	-97,892,005.30	-551,048,094.03
其中：基金申购款	122,363,164.82	12,620,819.97	134,983,984.79
基金赎回款	-575,519,253.55	-110,512,825.27	-686,032,078.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,425,757,894.54	124,154,905.41	1,549,912,799.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	123,018.11

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	38,753.73
其他	5,630.08
合计	167,401.92

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	3,869,585,997.14
减：卖出股票成本总额	3,586,328,179.00
买卖股票差价收入	283,257,818.14

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	83,958,446.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	82,644,120.00
减：应收利息总额	3,632,056.28
买卖债券差价收入	-2,317,729.98

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,879,412.01
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	11,879,412.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-78,647,118.43
——股票投资	-83,113,965.59
——债券投资	4,466,847.16
——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	-78,647,118.43

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	21,175.57
转换费收入	2,384.35
合计	23,559.92

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	10,969,252.57
银行间市场交易费用	350.00
合计	10,969,602.57

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	49,588.57

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	632.97
账户维护费	9,000.00
合计	118,728.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	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(“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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	3,252,506,393.49	46.48%	915,304,377.86	13.66%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	310,808.30	95.21%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	3,029,059.64	47.01%	433,754.30	11.27%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	852,421.00	13.84%	852,421.00	13.84%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,801,071.50	12,702,258.81
其中：支付销售机构的客户维护费	2,805,570.24	567,339.08

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司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 X 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,160,214.27	2,540,451.80

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 X 0.2% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	34,877,813.26	123,018.11	61,674,456.54	247,302.29

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。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
国泰君安	113042	上银转债	老股东配售	310.00	31,000.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688686	奥普特	2020-12-24	2021-07-01	新股限售	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688660	电气风电	2021-05-11	2021-11-19	新股限售	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-
688183	生益电子	2021-02-10	2021-08-25	新股限售	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	新股限售	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	新股限售	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股限售	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-

300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-10-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-10-11	新股限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-10-24	新股限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-

301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-

				市						
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	625	62,500.00	62,500.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	配债未上市	100.00	100.00	5,772	577,200.00	577,200.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项或临时停牌	5.59	2021-07-06	6.15	100	717.00	559.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项或临时停牌	56.35	2021-07-01	59.49	100	2,725.00	5,635.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 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，属于高风险品种。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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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上市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%。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,877,813.26	-	-	-	34,877,813.26

结算备付金	5,556,236.26	-	-	-	5,556,236.26
存出保证金	603,022.92	-	-	-	603,022.92
交易性金融资产	88,396,342.36	-	-	2,038,790,401.43	2,127,186,743.79
应收证券清算款	-	-	-	5,585,732.17	5,585,732.17
应收利息	-	-	-	846,209.32	846,209.32
应收申购款	-	-	-	1,799,228.95	1,799,228.95
资产总计	129,433,414.80	-	-	2,047,021,571.87	2,176,454,986.67
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,963,221.84	2,963,221.84
应付赎回款	-	-	-	6,743,911.57	6,743,911.57
应付管理人报酬	-	-	-	1,747,989.48	1,747,989.48
应付托管费	-	-	-	349,597.88	349,597.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,850,686.48	3,850,686.48
应交税费	-	-	-	21.90	21.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	609,095.94	609,095.94
负债总计	-	-	-	16,264,525.09	16,264,525.09
利率敏感度缺口	129,433,414.80	-	-	2,030,757,046.78	2,160,190,461.58
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	98,191,224.13	-	-	-	98,191,224.13
结算备付金	8,508,396.57	-	-	-	8,508,396.57
存出保证金	645,178.99	-	-	-	645,178.99
交易性金融资产	80,573,915.20	-	-	2,566,265,890.43	2,646,839,805.59

					63
应收证券清算款	-	-	-	16,167,417.92	16,167,417.92
应收利息	-	-	-	2,863,531.20	2,863,531.20
应收申购款	-	-	-	376,965.97	376,965.97
资产总计	187,918,714.89	-	-	2,585,673,805.52	2,773,592,520.41
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	12,483,495.12	12,483,495.12
应付赎回款	-	-	-	7,426,277.62	7,426,277.62
应付管理人报酬	-	-	-	2,373,578.14	2,373,578.14
应付托管费	-	-	-	474,715.63	474,715.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,648,989.14	8,648,989.14
应交税费	-	-	-	49.80	49.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	717,052.11	717,052.11
负债总计	-	-	-	32,124,157.56	32,124,157.56
利率敏感度缺口	187,918,714.89	-	-	2,553,549,647.96	2,741,468,362.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2021 年 06 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日持有的交易性债券资产比例较低，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采取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。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，投资组合中股票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%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,038,790,401.43	94.38	2,566,265,890.43	93.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,038,790,401.43	94.38	2,566,265,890.43	93.61

	43		.43	
--	----	--	-----	--

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 11,781	增加约 14,204
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 11,781	减少约 14,204

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,038,790,401.43	93.67
	其中：股票	2,038,790,401.43	93.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	88,396,342.36	4.06
	其中：债券	88,396,342.36	4.06
	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	40,434,049.52	1.86
8	其他各项资产	8,834,193.36	0.41
9	合计	2,176,454,986.67	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	203,274.40	0.01
B	采矿业	43,086,931.75	1.99
C	制造业	964,659,848.14	44.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,643,803.00	0.17
E	建筑业	5,079.00	0.00
F	批发和零售业	24,531,624.90	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	44,928,467.89	2.08
H	住宿和餐饮业	40,405.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,572,879.76	3.59
J	金融业	269,988,856.42	12.50
K	房地产业	32,814,918.53	1.52
L	租赁和商务服务业	79,962,755.09	3.70
M	科学研究和技术服务业	26,185,173.63	1.21
N	水利、环境和公共设施管理业	8,602.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,598,037.67	1.14
Q	卫生和社会工作	31,080,062.02	1.44
R	文化、体育和娱乐业	15,544,207.94	0.72
S	综合	2,276.00	0.00
	合计	1,638,857,203.14	75.87

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	24,630,325.80	1.14
B	采矿业	648.00	0.00
C	制造业	312,197,509.98	14.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,105,886.50	0.75
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	16,189,762.06	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	8,541,920.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,120,131.13	1.02
J	金融业	35,187.10	0.00
K	房地产业	404.00	0.00
L	租赁和商务服务业	242.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	85,810.35	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	399,933,198.29	18.51

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	58,533	120,384,821.10	5.57
2	600036	招商银行	1,583,700	85,820,703.00	3.97
3	300750	宁德时代	104,251	55,753,434.80	2.58
4	601888	中国中免	158,770	47,646,877.00	2.21

5	601012	隆基股份	486,851	43,251,842.84	2.00
6	000725	京东方 A	6,926,718	43,222,720.32	2.00
7	300059	东方财富	1,107,895	36,327,877.05	1.68
8	601318	中国平安	541,334	34,796,949.52	1.61
9	601717	郑煤机	2,920,515	33,965,589.45	1.57
10	000858	五粮液	111,444	33,198,053.16	1.54
11	300122	智飞生物	176,800	33,013,864.00	1.53
12	000002	万 科 A	1,377,313	32,793,822.53	1.52
13	002027	分众传媒	3,429,337	32,270,061.17	1.49
14	601899	紫金矿业	3,071,675	29,764,530.75	1.38
15	000333	美的集团	413,485	29,510,424.45	1.37
16	601111	中国国航	3,704,932	28,824,370.96	1.33
17	603501	韦尔股份	84,141	27,093,402.00	1.25
18	601688	华泰证券	1,688,624	26,680,259.20	1.24
19	000636	风华高科	847,000	25,596,340.00	1.18
20	002049	紫光国微	163,918	25,274,516.42	1.17
21	002607	中公教育	1,177,503	24,598,037.67	1.14
22	600690	海尔智家	945,620	24,501,014.20	1.13
23	002727	一心堂	739,600	24,488,156.00	1.13
24	002050	三花智控	997,800	23,927,244.00	1.11
25	002044	美年健康	2,603,780	23,720,435.80	1.10
26	600166	福田汽车	6,861,400	23,671,830.00	1.10
27	600529	山东药玻	674,100	22,885,695.00	1.06
28	603259	药明康德	145,157	22,730,134.63	1.05
29	601636	旗滨集团	1,194,544	22,170,736.64	1.03
30	601166	兴业银行	1,072,600	22,041,930.00	1.02
31	002475	立讯精密	475,815	21,887,490.00	1.01
32	600409	三友化工	2,122,173	21,455,169.03	0.99
33	002601	龙佰集团	612,100	21,166,418.00	0.98
34	601058	赛轮轮胎	2,012,200	20,101,878.00	0.93
35	600030	中信证券	794,342	19,810,889.48	0.92
36	002415	海康威视	300,621	19,390,054.50	0.90
37	000001	平安银行	832,421	18,829,363.02	0.87
38	300408	三环集团	414,339	17,576,260.38	0.81
39	601233	桐昆股份	665,956	16,042,880.04	0.74
40	300413	芒果超媒	225,100	15,441,860.00	0.71
41	300482	万孚生物	238,312	15,416,403.28	0.71
42	600276	恒瑞医药	222,679	15,135,491.63	0.70
43	603005	晶方科技	247,008	14,630,283.84	0.68
44	002706	良信股份	642,900	14,490,966.00	0.67
45	600845	宝信软件	282,400	14,374,160.00	0.67
46	002372	伟星新材	653,400	13,505,778.00	0.63
47	603707	健友股份	316,000	13,193,000.00	0.61
48	002624	完美世界	546,000	13,054,860.00	0.60

49	600348	华阳股份	1,665,800	12,360,236.00	0.57
50	300274	阳光电源	105,799	12,173,232.94	0.56
51	688111	金山办公	30,516	12,047,716.80	0.56
52	300003	乐普医疗	340,037	10,921,988.44	0.51
53	600570	恒生电子	116,628	10,875,561.00	0.50
54	601658	邮储银行	2,158,000	10,833,160.00	0.50
55	600029	南方航空	1,697,600	10,219,552.00	0.47
56	688036	传音控股	48,748	10,212,706.00	0.47
57	603613	国联股份	102,000	10,196,940.00	0.47
58	300253	卫宁健康	618,500	10,062,995.00	0.47
59	000568	泸州老窖	41,200	9,720,728.00	0.45
60	000661	长春高新	24,568	9,507,816.00	0.44
61	300760	迈瑞医疗	19,488	9,355,214.40	0.43
62	600887	伊利股份	240,951	8,874,225.33	0.41
63	000739	普洛药业	283,553	8,336,458.20	0.39
64	002142	宁波银行	202,491	7,891,074.27	0.37
65	688005	容百科技	62,970	7,631,964.00	0.35
66	000733	振华科技	118,400	7,230,688.00	0.33
67	000513	丽珠集团	136,900	6,847,738.00	0.32
68	000516	国际医学	359,542	6,762,985.02	0.31
69	002064	华峰化学	423,700	6,016,540.00	0.28
70	002241	歌尔股份	137,289	5,867,731.86	0.27
71	600009	上海机场	116,281	5,596,604.53	0.26
72	600926	杭州银行	314,380	4,637,105.00	0.21
73	600346	恒力石化	176,200	4,623,488.00	0.21
74	300285	国瓷材料	89,500	4,363,125.00	0.20
75	300529	健帆生物	50,300	4,343,908.00	0.20
76	300496	中科创达	25,400	3,989,324.00	0.18
77	600176	中国巨石	242,873	3,766,960.23	0.17
78	600900	长江电力	176,100	3,634,704.00	0.17
79	300014	亿纬锂能	34,800	3,616,764.00	0.17
80	603290	斯达半导	11,100	3,552,000.00	0.16
81	300012	华测检测	107,800	3,436,664.00	0.16
82	603986	兆易创新	16,868	3,169,497.20	0.15
83	002541	鸿路钢构	51,700	3,016,695.00	0.14
84	300454	深信服	10,797	2,801,605.56	0.13
85	300601	康泰生物	17,521	2,610,629.00	0.12
86	600309	万华化学	12,700	1,382,014.00	0.06
87	600885	宏发股份	19,800	1,241,460.00	0.06
88	601128	常熟银行	179,200	1,111,040.00	0.05
89	300001	特锐德	36,430	1,096,907.30	0.05
90	600028	中国石化	147,300	642,228.00	0.03
91	002460	赣锋锂业	4,900	593,341.00	0.03
92	603799	华友钴业	3,891	444,352.20	0.02

93	300015	爱尔眼科	5,575	395,713.50	0.02
94	600741	华域汽车	10,354	271,999.58	0.01
95	002444	巨星科技	6,900	235,152.00	0.01
96	601939	建设银行	30,000	199,500.00	0.01
97	002714	牧原股份	3,220	195,840.40	0.01
98	601398	工商银行	36,900	190,773.00	0.01
99	300244	迪安诊断	4,829	184,950.70	0.01
100	601229	上海银行	22,300	182,860.00	0.01
101	601021	春秋航空	3,200	182,080.00	0.01
102	600000	浦发银行	17,800	178,000.00	0.01
103	601288	农业银行	56,700	171,801.00	0.01
104	000977	浪潮信息	5,562	156,459.06	0.01
105	603288	海天味业	1,201	154,868.95	0.01
106	600016	民生银行	32,900	145,089.00	0.01
107	000975	银泰黄金	15,100	143,601.00	0.01
108	601857	中国石油	21,000	111,090.00	0.01
109	603444	吉比特	200	106,000.00	0.00
110	601766	中国中车	16,200	98,496.00	0.00
111	300782	卓胜微	180	96,750.00	0.00
112	601006	大秦铁路	14,600	96,068.00	0.00
113	002739	万达电影	5,886	92,939.94	0.00
114	000538	云南白药	800	92,576.00	0.00
115	300450	先导智能	1,357	81,609.98	0.00
116	600352	浙江龙盛	5,700	78,318.00	0.00
117	300661	圣邦股份	300	75,819.00	0.00
118	603019	中科曙光	2,500	69,025.00	0.00
119	000401	冀东水泥	5,500	67,925.00	0.00
120	688981	中芯国际	1,000	61,820.00	0.00
121	000776	广发证券	4,045	61,241.30	0.00
122	000895	双汇发展	1,800	57,240.00	0.00
123	002683	宏大爆破	1,900	52,763.00	0.00
124	002080	中材科技	1,844	48,257.48	0.00
125	002127	南极电商	4,496	43,925.92	0.00
126	000876	新希望	2,900	42,543.00	0.00
127	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.00
128	002001	新和成	1,039	29,798.52	0.00
129	300595	欧普康视	280	28,994.00	0.00
130	600754	锦江酒店	500	28,475.00	0.00
131	000800	一汽解放	2,600	28,132.00	0.00
132	601211	国泰君安	1,600	27,424.00	0.00
133	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.00
134	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.00
135	002841	视源股份	200	24,858.00	0.00
136	002812	恩捷股份	100	23,410.00	0.00

137	603486	科沃斯	100	22,808.00	0.00
138	600132	重庆啤酒	100	19,795.00	0.00
139	603659	璞泰来	140	19,124.00	0.00
140	603127	昭衍新药	100	18,375.00	0.00
141	601360	三六零	1,500	18,315.00	0.00
142	603899	晨光文具	200	16,912.00	0.00
143	603882	金域医学	100	15,977.00	0.00
144	002568	百润股份	140	13,270.60	0.00
145	603267	鸿远电子	100	12,792.00	0.00
146	600779	水井坊	100	12,635.00	0.00
147	600258	首旅酒店	500	11,930.00	0.00
148	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.00
149	600600	青岛啤酒	100	11,565.00	0.00
150	300747	锐科激光	100	11,406.00	0.00
151	300033	同花顺	100	11,278.00	0.00
152	002916	深南电路	100	11,113.00	0.00
153	002920	德赛西威	100	11,008.00	0.00
154	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.00
155	300223	北京君正	100	10,092.00	0.00
156	300037	新宙邦	100	10,010.00	0.00
157	603658	安图生物	130	9,850.10	0.00
158	300474	景嘉微	100	9,792.00	0.00
159	600745	闻泰科技	100	9,690.00	0.00
160	600438	通威股份	200	8,654.00	0.00
161	300999	金龙鱼	100	8,496.00	0.00
162	600760	中航沈飞	140	8,442.00	0.00
163	603517	绝味食品	100	8,429.00	0.00
164	300363	博腾股份	100	8,412.00	0.00
165	300628	亿联网络	100	8,380.00	0.00
166	002409	雅克科技	100	8,100.00	0.00
167	002179	中航光电	100	7,902.00	0.00
168	300618	寒锐钴业	100	7,884.00	0.00
169	603816	顾家家居	100	7,728.00	0.00
170	300699	光威复材	100	7,595.00	0.00
171	600584	长电科技	200	7,536.00	0.00
172	603939	益丰药房	130	7,291.70	0.00
173	300726	宏达电子	100	7,049.00	0.00
174	603589	口子窖	100	6,769.00	0.00
175	002146	荣盛发展	1,200	6,768.00	0.00
176	603678	火炬电子	100	6,750.00	0.00
177	601877	正泰电器	200	6,676.00	0.00
178	002925	盈趣科技	170	6,614.70	0.00
179	300357	我武生物	100	6,412.00	0.00
180	002466	天齐锂业	100	6,202.00	0.00

181	300142	沃森生物	100	6,170.00	0.00
182	300567	精测电子	100	6,140.00	0.00
183	603233	大参林	120	6,133.20	0.00
184	600315	上海家化	100	6,014.00	0.00
185	603638	艾迪精密	140	6,001.80	0.00
186	300433	蓝思科技	200	5,882.00	0.00
187	600536	中国软件	100	5,693.00	0.00
188	600460	士兰微	100	5,635.00	0.00
189	300073	当升科技	100	5,619.00	0.00
190	600660	福耀玻璃	100	5,585.00	0.00
191	002690	美亚光电	100	5,576.00	0.00
192	002648	卫星石化	140	5,486.60	0.00
193	603369	今世缘	100	5,416.00	0.00
194	300251	光线传媒	500	5,405.00	0.00
195	603883	老百姓	100	5,268.00	0.00
196	300316	晶盛机电	100	5,050.00	0.00
197	002459	晶澳科技	100	4,900.00	0.00
198	002508	老板电器	100	4,650.00	0.00
199	000963	华东医药	100	4,601.00	0.00
200	002353	杰瑞股份	100	4,470.00	0.00
201	002626	金达威	100	4,470.00	0.00
202	300502	新易盛	140	4,375.00	0.00
203	601966	玲珑轮胎	100	4,374.00	0.00
204	603866	桃李面包	140	4,368.00	0.00
205	600323	瀚蓝环境	200	4,358.00	0.00
206	002074	国轩高科	100	4,356.00	0.00
207	002557	洽洽食品	100	4,310.00	0.00
208	002151	北斗星通	100	4,307.00	0.00
209	603927	中科软	100	4,295.00	0.00
210	002236	大华股份	200	4,220.00	0.00
211	000860	顺鑫农业	100	4,218.00	0.00
212	300463	迈克生物	100	4,209.00	0.00
213	600085	同仁堂	100	4,085.00	0.00
214	002747	埃斯顿	100	3,905.00	0.00
215	002138	顺络电子	100	3,877.00	0.00
216	002414	高德红外	140	3,861.20	0.00
217	002129	中环股份	100	3,860.00	0.00
218	300308	中际旭创	100	3,852.00	0.00
219	600316	洪都航空	100	3,848.00	0.00
220	002223	鱼跃医疗	100	3,813.00	0.00
221	600999	招商证券	200	3,804.00	0.00
222	002507	涪陵榨菜	100	3,766.00	0.00
223	603712	七一二	100	3,610.00	0.00
224	000423	东阿阿胶	100	3,591.00	0.00

225	002938	鹏鼎控股	100	3,588.00	0.00
226	002430	杭氧股份	100	3,459.00	0.00
227	600161	天坛生物	100	3,425.00	0.00
228	002030	达安基因	160	3,398.40	0.00
229	600332	白云山	100	3,385.00	0.00
230	000063	中兴通讯	100	3,323.00	0.00
231	600511	国药股份	100	3,306.00	0.00
232	002153	石基信息	140	3,291.40	0.00
233	002294	信立泰	100	3,290.00	0.00
234	300146	汤臣倍健	100	3,290.00	0.00
235	300207	欣旺达	100	3,256.00	0.00
236	002242	九阳股份	100	3,249.00	0.00
237	002180	纳思达	100	3,220.00	0.00
238	603027	千禾味业	120	3,154.80	0.00
239	601066	中信建投	100	3,143.00	0.00
240	300298	三诺生物	100	3,132.00	0.00
241	600862	中航高科	100	3,078.00	0.00
242	600998	九州通	200	3,074.00	0.00
243	002831	裕同科技	100	2,969.00	0.00
244	600118	中国卫星	100	2,926.00	0.00
245	002603	以岭药业	100	2,916.00	0.00
246	002439	启明星辰	100	2,901.00	0.00
247	600859	王府井	100	2,888.00	0.00
248	603156	养元饮品	100	2,858.00	0.00
249	600079	人福医药	100	2,827.00	0.00
250	300773	拉卡拉	100	2,823.00	0.00
251	002250	联化科技	100	2,790.00	0.00
252	002511	中顺洁柔	100	2,755.00	0.00
253	603218	日月股份	100	2,708.00	0.00
254	000951	中国重汽	100	2,706.00	0.00
255	300212	易华录	100	2,691.00	0.00
256	000999	华润三九	100	2,675.00	0.00
257	002595	豪迈科技	100	2,670.00	0.00
258	600559	老白干酒	100	2,630.00	0.00
259	000768	中航西飞	100	2,628.00	0.00
260	002705	新宝股份	100	2,625.00	0.00
261	603228	景旺电子	100	2,620.00	0.00
262	002493	荣盛石化	150	2,590.50	0.00
263	600089	特变电工	200	2,570.00	0.00
264	600699	均胜电子	100	2,552.00	0.00
265	000400	许继电气	200	2,532.00	0.00
266	002281	光迅科技	100	2,460.00	0.00
267	002572	索菲亚	100	2,420.00	0.00
268	002156	通富微电	100	2,404.00	0.00

269	002299	圣农发展	100	2,388.00	0.00
270	000988	华工科技	100	2,352.00	0.00
271	600183	生益科技	100	2,341.00	0.00
272	601231	环旭电子	139	2,336.59	0.00
273	600884	杉杉股份	100	2,332.00	0.00
274	603568	伟明环保	100	2,283.00	0.00
275	002497	雅化集团	100	2,278.00	0.00
276	603858	步长制药	100	2,249.00	0.00
277	600362	江西铜业	100	2,238.00	0.00
278	001979	招商蛇口	200	2,190.00	0.00
279	000938	紫光股份	100	2,188.00	0.00
280	002389	航天彩虹	100	2,183.00	0.00
281	600848	上海临港	120	2,148.00	0.00
282	601607	上海医药	100	2,113.00	0.00
283	600521	华海药业	100	2,088.00	0.00
284	600143	金发科技	100	2,086.00	0.00
285	002382	蓝帆医疗	100	2,085.00	0.00
286	002384	东山精密	100	2,084.00	0.00
287	000581	威孚高科	100	2,083.00	0.00
288	000738	航发控制	100	2,083.00	0.00
289	600549	厦门钨业	100	2,083.00	0.00
290	002625	光启技术	100	2,081.00	0.00
291	600739	辽宁成大	100	2,081.00	0.00
292	600685	中船防务	100	2,080.00	0.00
293	600111	北方稀土	100	2,070.00	0.00
294	600827	百联股份	100	2,015.00	0.00
295	002422	科伦药业	100	1,995.00	0.00
296	002212	天融信	100	1,977.00	0.00
297	601088	中国神华	100	1,952.00	0.00
298	002268	卫士通	100	1,948.00	0.00
299	000831	五矿稀土	100	1,930.00	0.00
300	300271	华宇软件	100	1,925.00	0.00
301	000021	深科技	100	1,914.00	0.00
302	600305	恒顺醋业	100	1,912.00	0.00
303	000547	航天发展	100	1,887.00	0.00
304	000830	鲁西化工	100	1,873.00	0.00
305	600498	烽火通信	100	1,863.00	0.00
306	000009	中国宝安	100	1,827.00	0.00
307	600895	张江高科	100	1,827.00	0.00
308	000039	中集集团	100	1,818.00	0.00
309	002216	三全食品	110	1,811.70	0.00
310	600566	济川药业	100	1,790.00	0.00
311	300009	安科生物	120	1,788.00	0.00
312	000338	潍柴动力	100	1,787.00	0.00

313	601098	中南传媒	200	1,764.00	0.00
314	600801	华新水泥	100	1,757.00	0.00
315	000672	上峰水泥	100	1,748.00	0.00
316	600201	生物股份	100	1,745.00	0.00
317	600482	中国动力	100	1,742.00	0.00
318	300188	美亚柏科	100	1,740.00	0.00
319	600392	盛和资源	100	1,736.00	0.00
320	002019	亿帆医药	100	1,725.00	0.00
321	603000	人民网	100	1,719.00	0.00
322	001914	招商积余	100	1,718.00	0.00
323	600060	海信视像	100	1,690.00	0.00
324	002373	千方科技	100	1,670.00	0.00
325	000997	新大陆	100	1,659.00	0.00
326	600372	中航电子	100	1,655.00	0.00
327	600150	中国船舶	100	1,651.00	0.00
328	600803	新奥股份	100	1,651.00	0.00
329	300418	昆仑万维	100	1,638.00	0.00
330	600637	东方明珠	200	1,638.00	0.00
331	600835	上海机电	100	1,625.00	0.00
332	601615	明阳智能	100	1,619.00	0.00
333	000998	隆平高科	100	1,604.00	0.00
334	000960	锡业股份	100	1,603.00	0.00
335	002399	海普瑞	100	1,593.00	0.00
336	000623	吉林敖东	100	1,549.00	0.00
337	002463	沪电股份	100	1,547.00	0.00
338	601456	国联证券	100	1,540.00	0.00
339	002185	华天科技	100	1,539.00	0.00
340	600188	兖州煤业	100	1,536.00	0.00
341	002262	恩华药业	100	1,535.00	0.00
342	600019	宝钢股份	200	1,528.00	0.00
343	603885	吉祥航空	100	1,526.00	0.00
344	600562	国睿科技	100	1,507.00	0.00
345	600267	海正药业	100	1,505.00	0.00
346	600598	北大荒	100	1,496.00	0.00
347	000069	华侨城 A	200	1,488.00	0.00
348	600535	天士力	100	1,481.00	0.00
349	300070	碧水源	200	1,462.00	0.00
350	000066	中国长城	100	1,460.00	0.00
351	000555	神州信息	100	1,447.00	0.00
352	600597	光明乳业	100	1,441.00	0.00
353	300383	光环新网	100	1,439.00	0.00
354	300498	温氏股份	100	1,437.00	0.00
355	000050	深天马 A	100	1,418.00	0.00
356	600380	健康元	100	1,373.00	0.00

357	002120	韵达股份	100	1,353.00	0.00
358	002078	太阳纸业	100	1,335.00	0.00
359	002558	巨人网络	100	1,330.00	0.00
360	600131	国网信通	100	1,324.00	0.00
361	601878	浙商证券	100	1,308.00	0.00
362	002152	广电运通	100	1,303.00	0.00
363	002056	横店东磁	100	1,300.00	0.00
364	600061	国投资本	152	1,290.48	0.00
365	000878	云南铜业	100	1,283.00	0.00
366	000987	越秀金控	100	1,266.00	0.00
367	601838	成都银行	100	1,264.00	0.00
368	600977	中国电影	100	1,253.00	0.00
369	600066	宇通客车	100	1,249.00	0.00
370	600418	江淮汽车	100	1,243.00	0.00
371	600674	川投能源	100	1,233.00	0.00
372	002157	正邦科技	100	1,195.00	0.00
373	002563	森马服饰	100	1,195.00	0.00
374	600867	通化东宝	100	1,194.00	0.00
375	601168	西部矿业	100	1,193.00	0.00
376	000807	云铝股份	100	1,190.00	0.00
377	601225	陕西煤业	100	1,185.00	0.00
378	601699	潞安环能	100	1,181.00	0.00
379	600655	豫园股份	100	1,159.00	0.00
380	600487	亨通光电	100	1,140.00	0.00
381	600004	白云机场	100	1,118.00	0.00
382	002939	长城证券	100	1,113.00	0.00
383	002436	兴森科技	100	1,100.00	0.00
384	600875	东方电气	100	1,097.00	0.00
385	002221	东华能源	100	1,095.00	0.00
386	601198	东兴证券	100	1,093.00	0.00
387	002075	沙钢股份	100	1,091.00	0.00
388	600606	绿地控股	200	1,090.00	0.00
389	601881	中国银河	100	1,078.00	0.00
390	002736	国信证券	100	1,075.00	0.00
391	600155	华创阳安	100	1,070.00	0.00
392	300024	机器人	100	1,067.00	0.00
393	002191	劲嘉股份	100	1,064.00	0.00
394	002203	海亮股份	100	1,064.00	0.00
395	601990	南京证券	100	1,052.00	0.00
396	601108	财通证券	100	1,049.00	0.00
397	002128	露天煤业	100	1,041.00	0.00
398	002233	塔牌集团	100	1,028.00	0.00
399	002092	中泰化学	100	1,027.00	0.00
400	000012	南玻 A	100	1,024.00	0.00

401	600967	内蒙一机	100	1,012.00	0.00
402	601985	中国核电	200	1,012.00	0.00
403	002013	中航机电	100	1,007.00	0.00
404	600233	圆通速递	100	1,001.00	0.00
405	600737	中粮糖业	100	1,001.00	0.00
406	600958	东方证券	100	999.00	0.00
407	600373	中文传媒	100	986.00	0.00
408	002124	天邦股份	140	981.40	0.00
409	002926	华西证券	100	963.00	0.00
410	600886	国投电力	100	961.00	0.00
411	002465	海格通信	100	946.00	0.00
412	601901	方正证券	100	936.00	0.00
413	002340	格林美	100	935.00	0.00
414	002600	领益智造	100	919.00	0.00
415	000027	深圳能源	100	917.00	0.00
416	600667	太极实业	100	910.00	0.00
417	000930	中粮科技	100	901.00	0.00
418	002456	欧菲光	100	888.00	0.00
419	600160	巨化股份	100	884.00	0.00
420	601117	中国化学	100	876.00	0.00
421	601519	大智慧	100	869.00	0.00
422	600489	中金黄金	100	862.00	0.00
423	601727	上海电气	200	848.00	0.00
424	000686	东北证券	100	845.00	0.00
425	601555	东吴证券	100	834.00	0.00
426	000983	山西焦煤	100	831.00	0.00
427	300088	长信科技	100	826.00	0.00
428	002673	西部证券	100	825.00	0.00
429	601989	中国重工	200	824.00	0.00
430	000488	晨鸣纸业	100	814.00	0.00
431	600153	建发股份	100	810.00	0.00
432	600528	中铁工业	100	810.00	0.00
433	002099	海翔药业	100	807.00	0.00
434	300376	易事特	100	804.00	0.00
435	000728	国元证券	100	797.00	0.00
436	002065	东华软件	100	793.00	0.00
437	002081	金螳螂	100	792.00	0.00
438	600704	物产中大	100	787.00	0.00
439	600500	中化国际	100	786.00	0.00
440	300296	利亚德	100	782.00	0.00
441	000089	深圳机场	100	777.00	0.00
442	002010	传化智联	100	771.00	0.00
443	000723	美锦能源	100	756.00	0.00
444	600879	航天电子	100	752.00	0.00

445	000825	太钢不锈	100	749.00	0.00
446	002252	上海莱士	100	749.00	0.00
447	600068	葛洲坝	100	749.00	0.00
448	600516	方大炭素	100	744.00	0.00
449	002966	苏州银行	100	735.00	0.00
450	000783	长江证券	100	732.00	0.00
451	600909	华安证券	130	724.10	0.00
452	000729	燕京啤酒	100	724.00	0.00
453	601997	贵阳银行	100	716.00	0.00
454	002797	第一创业	100	714.00	0.00
455	600711	盛屯矿业	100	713.00	0.00
456	600919	江苏银行	100	710.00	0.00
457	002385	大北农	100	680.00	0.00
458	600507	方大特钢	100	678.00	0.00
459	000402	金融街	100	675.00	0.00
460	002110	三钢闽光	100	674.00	0.00
461	002500	山西证券	100	671.00	0.00
462	000932	华菱钢铁	100	660.00	0.00
463	600177	雅戈尔	100	659.00	0.00
464	601800	中国交建	100	648.00	0.00
465	002602	世纪华通	100	642.00	0.00
466	600015	华夏银行	100	619.00	0.00
467	600026	中远海能	100	616.00	0.00
468	600642	申能股份	100	614.00	0.00
469	600100	同方股份	100	611.00	0.00
470	002429	兆驰股份	100	607.00	0.00
471	300058	蓝色光标	100	605.00	0.00
472	600390	五矿资本	100	598.00	0.00
473	601319	中国人保	100	593.00	0.00
474	000961	中南建设	100	592.00	0.00
475	300017	网宿科技	100	585.00	0.00
476	600376	首开股份	100	560.00	0.00
477	600873	梅花生物	100	560.00	0.00
478	002024	苏宁易购	100	559.00	0.00
479	600782	新钢股份	100	558.00	0.00
480	601872	招商轮船	120	554.40	0.00
481	000559	万向钱潮	100	531.00	0.00
482	601600	中国铝业	100	530.00	0.00
483	600820	隧道股份	100	529.00	0.00
484	601816	京沪高铁	100	529.00	0.00
485	600340	华夏幸福	100	524.00	0.00
486	601390	中国中铁	100	524.00	0.00
487	000598	兴蓉环境	100	521.00	0.00
488	000671	阳光城	100	520.00	0.00

489	603993	洛阳钼业	100	516.00	0.00
490	600415	小商品城	100	515.00	0.00
491	601118	海南橡胶	100	509.00	0.00
492	601216	君正集团	100	509.00	0.00
493	600115	中国东航	100	508.00	0.00
494	601598	中国外运	100	505.00	0.00
495	002266	浙富控股	100	499.00	0.00
496	600369	西南证券	100	487.00	0.00
497	601169	北京银行	100	487.00	0.00
498	601375	中原证券	100	487.00	0.00
499	600795	国电电力	200	486.00	0.00
500	601162	天风证券	100	486.00	0.00
501	600018	上港集团	100	477.00	0.00
502	000166	申万宏源	100	468.00	0.00
503	000883	湖北能源	100	459.00	0.00
504	000060	中金岭南	100	452.00	0.00
505	600583	海油工程	100	450.00	0.00
506	600673	东阳光	100	449.00	0.00
507	600497	驰宏锌锗	100	431.00	0.00
508	600808	马钢股份	100	429.00	0.00
509	002958	青农商行	100	428.00	0.00
510	000750	国海证券	100	424.00	0.00
511	002244	滨江集团	100	419.00	0.00
512	601179	中国西电	100	412.00	0.00
513	601077	渝农商行	100	399.00	0.00
514	601916	浙商银行	100	397.00	0.00
515	600705	中航产融	100	387.00	0.00
516	601669	中国电建	100	387.00	0.00
517	600688	上海石化	100	376.00	0.00
518	601866	中远海发	100	375.00	0.00
519	601608	中信重工	100	374.00	0.00
520	000778	新兴铸管	100	372.00	0.00
521	600023	浙能电力	100	367.00	0.00
522	601860	紫金银行	100	363.00	0.00
523	000627	天茂集团	100	362.00	0.00
524	600219	南山铝业	100	360.00	0.00
525	600282	南钢股份	100	356.00	0.00
526	002506	协鑫集成	100	348.00	0.00
527	600567	山鹰国际	100	345.00	0.00
528	600027	华电国际	100	344.00	0.00
529	600320	振华重工	100	339.00	0.00
530	601099	太平洋	100	339.00	0.00
531	601106	中国一重	100	339.00	0.00
532	600256	广汇能源	100	333.00	0.00

533	600208	新湖中宝	100	304.00	0.00
534	600008	首创环保	100	301.00	0.00
535	601618	中国中冶	100	298.00	0.00
536	600297	广汇汽车	100	288.00	0.00
537	600170	上海建工	100	276.00	0.00
538	000540	中天金融	100	273.00	0.00
539	000630	铜陵有色	100	272.00	0.00
540	601992	金隅集团	100	269.00	0.00
541	601005	重庆钢铁	100	267.00	0.00
542	600968	海油发展	100	259.00	0.00
543	000709	河钢股份	100	246.00	0.00
544	601000	唐山港	100	241.00	0.00
545	002131	利欧股份	100	234.00	0.00
546	600863	内蒙华电	100	233.00	0.00
547	000629	攀钢钒钛	100	229.00	0.00
548	601333	广深铁路	100	212.00	0.00
549	603077	和邦生物	100	208.00	0.00
550	600022	山东钢铁	100	172.00	0.00
551	600010	包钢股份	100	155.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601208	东材科技	2,657,100.00	43,363,872.00	2.01
2	300119	瑞普生物	916,600.00	30,999,412.00	1.44
3	300572	安车检测	936,281.00	30,372,955.64	1.41
4	300761	立华股份	743,104.00	24,619,035.52	1.14
5	300696	爱乐达	590,230.00	24,565,372.60	1.14
6	002876	三利谱	365,920.00	23,675,024.00	1.10
7	601677	明泰铝业	1,093,772.00	21,383,242.60	0.99
8	603520	司太立	320,400.00	19,752,660.00	0.91
9	300083	创世纪	1,694,800.00	18,558,060.00	0.86
10	002534	杭锅股份	1,198,660.00	17,800,101.00	0.82
11	000028	国药一致	425,322.00	16,094,184.48	0.75
12	603229	奥翔药业	477,898.00	15,957,014.22	0.74
13	688369	致远互联	213,718.00	13,656,580.20	0.63
14	600295	鄂尔多斯	723,600.00	12,945,204.00	0.60

15	002332	仙琚制药	972,041.00	12,189,394.14	0.56
16	002833	弘亚数控	302,780.00	11,732,725.00	0.54
17	600025	华能水电	1,884,100.00	10,908,939.00	0.50
18	002245	蔚蓝锂芯	433,600.00	8,541,920.00	0.40
19	300613	富瀚微	53,283.00	8,305,754.04	0.38
20	603337	杰克股份	305,900.00	8,176,707.00	0.38
21	002636	金安国纪	498,700.00	8,088,914.00	0.37
22	002484	江海股份	435,700.00	6,744,636.00	0.31
23	600905	三峡能源	907,763.00	5,147,016.21	0.24
24	601567	三星医疗	64,900.00	1,382,370.00	0.06
25	688686	奥普特	2,330.00	1,050,830.00	0.05
26	688626	翔宇医疗	3,652.00	441,307.68	0.02
27	688658	悦康药业	16,580.00	372,884.20	0.02
28	688660	电气风电	51,238.00	371,987.88	0.02
29	688183	生益电子	18,394.00	261,010.86	0.01
30	300957	贝泰妮	853.00	214,921.88	0.01
31	688613	奥精医疗	2,617.00	166,179.50	0.01
32	688059	华锐精密	1,023.00	163,945.98	0.01
33	688661	和林微纳	1,452.00	121,982.52	0.01
34	688201	信安世纪	2,129.00	111,240.25	0.01
35	688560	明冠新材	3,832.00	92,351.20	0.00
36	688669	聚石化学	2,681.00	87,909.99	0.00
37	300985	致远新能	2,945.00	83,877.45	0.00
38	300979	华利集团	925.00	80,937.50	0.00
39	301018	申菱环境	7,811.00	64,753.19	0.00
40	688676	金盘科技	3,750.00	62,812.50	0.00
41	688328	深科达	1,499.00	60,514.63	0.00
42	688195	腾景科技	2,693.00	58,626.61	0.00
43	688239	航宇科技	4,926.00	56,550.48	0.00
44	300992	泰福泵业	1,998.00	55,828.42	0.00
45	300981	中红医疗	601.00	54,324.39	0.00
46	688087	英科再生	2,469.00	54,219.24	0.00
47	300910	瑞丰新材	474.00	49,556.70	0.00
48	301017	漱玉平民	5,550.00	49,173.00	0.00
49	301020	密封科技	4,210.00	44,794.40	0.00
50	300894	火星人	628.00	42,704.00	0.00
51	300973	立高食品	360.00	41,655.60	0.00
52	688679	通源环境	3,139.00	41,372.02	0.00
53	605090	九丰能源	1,090.00	35,326.90	0.00
54	601528	瑞丰银行	2,230.00	34,721.10	0.00
55	301021	英诺激光	2,899.00	27,424.54	0.00
56	001207	联科科技	682.00	22,581.02	0.00
57	301009	可靠股份	801.00	22,339.89	0.00

58	001206	依依股份	321.00	20,389.92	0.00
59	301015	百洋医药	462.00	17,939.46	0.00
60	688226	威腾电气	2,693.00	17,289.06	0.00
61	300925	法本信息	600.00	15,774.00	0.00
62	300982	苏文电能	317.00	14,356.93	0.00
63	001208	华菱线缆	1,754.00	13,558.42	0.00
64	300940	南极光	307.00	13,317.66	0.00
65	300614	百川畅银	329.00	13,285.02	0.00
66	300937	药易购	244.00	13,105.24	0.00
67	300942	易瑞生物	443.00	12,634.36	0.00
68	603171	税友股份	637.00	12,230.40	0.00
69	300997	欢乐家	928.00	12,110.40	0.00
70	301002	崧盛股份	201.00	11,581.62	0.00
71	300918	南山智尚	1,063.00	11,065.83	0.00
72	605287	德才股份	349.00	11,014.44	0.00
73	300955	嘉亨家化	232.00	10,688.24	0.00
74	300996	普联软件	241.00	10,177.43	0.00
75	300922	天秦装备	287.00	9,996.21	0.00
76	300962	中金辐照	576.00	9,429.12	0.00
77	300952	恒辉安防	340.00	9,207.20	0.00
78	301016	雷尔伟	275.00	9,069.50	0.00
79	300966	共同药业	286.00	9,020.44	0.00
80	300945	曼卡龙	474.00	8,949.12	0.00
81	300948	冠中生态	324.00	8,884.08	0.00
82	300931	通用电梯	672.00	8,809.92	0.00
83	300961	深水海纳	394.00	8,695.58	0.00
84	300950	德固特	219.00	8,569.47	0.00
85	605162	新中港	1,377.00	8,358.39	0.00
86	300958	建工修复	300.00	8,166.00	0.00
87	300986	志特新材	264.00	8,070.48	0.00
88	300987	川网传媒	301.00	8,069.81	0.00
89	300978	东箭科技	593.00	8,064.80	0.00
90	300926	博俊科技	359.00	7,969.80	0.00
91	300993	玉马遮阳	410.00	7,908.90	0.00
92	301004	嘉益股份	312.00	6,845.28	0.00
93	300927	江天化学	217.00	6,531.70	0.00
94	300975	商络电子	492.00	6,410.76	0.00
95	300963	中洲特材	283.00	6,364.67	0.00
96	301011	华立科技	175.00	5,922.00	0.00
97	300943	春晖智控	255.00	5,867.55	0.00
98	300967	晓鸣股份	507.00	5,850.78	0.00
99	300972	万辰生物	430.00	5,439.50	0.00
100	300929	华骐环保	183.00	5,407.65	0.00
101	300960	通业科技	234.00	5,396.04	0.00

102	605011	杭州热电	525.00	4,662.00	0.00
103	300995	奇德新材	191.00	4,454.12	0.00
104	301007	德迈仕	303.00	4,375.32	0.00
105	300998	宁波方正	201.00	4,285.32	0.00
106	301012	扬电科技	170.00	4,124.20	0.00
107	301010	晶雪节能	218.00	3,838.98	0.00
108	002773	康弘药业	100.00	2,313.00	0.00
109	600776	东方通信	100.00	1,240.00	0.00
110	600167	联美控股	100.00	893.00	0.00
111	600398	海澜之家	100.00	724.00	0.00
112	600021	上海电力	100.00	691.00	0.00
113	601958	金铂股份	100.00	648.00	0.00
114	600928	西安银行	100.00	466.00	0.00
115	600823	世茂股份	100.00	404.00	0.00
116	600959	江苏有线	100.00	305.00	0.00
117	000415	渤海租赁	100.00	242.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300119	瑞普生物	79,025,473.96	2.88
2	601636	旗滨集团	78,009,576.65	2.85
3	002876	三利谱	73,774,805.36	2.69
4	002027	分众传媒	69,591,525.18	2.54
5	601689	拓普集团	57,495,898.00	2.10
6	600519	贵州茅台	53,857,442.00	1.96
7	688208	道通科技	52,908,458.99	1.93
8	002050	三花智控	52,278,506.99	1.91
9	000516	国际医学	48,947,540.07	1.79
10	000725	京东方 A	48,767,221.00	1.78
11	300775	三角防务	43,156,504.10	1.57
12	600988	赤峰黄金	43,099,924.05	1.57
13	603456	九洲药业	40,659,667.50	1.48
14	300083	创世纪	39,931,383.55	1.46
15	002739	万达电影	39,586,010.70	1.44
16	601888	中国中免	38,256,531.08	1.40
17	688005	容百科技	38,057,045.73	1.39
18	002727	一心堂	35,411,245.96	1.29
19	002049	紫光国微	34,346,797.95	1.25

20	688099	晶晨股份	33,754,278.67	1.23
----	--------	------	---------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601636	旗滨集团	93,984,341.06	3.43
2	601888	中国中免	75,278,321.09	2.75
3	002739	万达电影	70,974,974.72	2.59
4	600887	伊利股份	65,875,918.55	2.40
5	002027	分众传媒	65,395,929.34	2.39
6	300593	新雷能	63,148,789.54	2.30
7	002876	三利谱	62,680,117.87	2.29
8	300119	瑞普生物	60,639,466.97	2.21
9	688208	道通科技	59,268,717.63	2.16
10	002025	航天电器	58,311,929.78	2.13
11	601318	中国平安	54,555,416.84	1.99
12	000516	国际医学	51,186,243.75	1.87
13	000725	京东方 A	50,583,869.87	1.85
14	600009	上海机场	47,599,474.06	1.74
15	603456	九洲药业	47,510,167.93	1.73
16	600988	赤峰黄金	46,166,323.58	1.68
17	688005	容百科技	45,776,223.42	1.67
18	002043	兔宝宝	44,567,283.68	1.63
19	601689	拓普集团	43,975,662.83	1.60
20	603392	万泰生物	42,581,350.00	1.55

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,141,966,655.59
卖出股票的收入（成交）总额	3,869,585,997.14

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,048,000.00	3.71
	其中：政策性金融债	80,048,000.00	3.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,348,342.36	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	88,396,342.36	4.09

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	210201	21 国开 01	800,000	80,048,000.00	3.71
2	123111	东财转 3	22,319	3,266,608.84	0.15
3	113047	旗滨转债	11,830	1,886,766.70	0.09
4	127036	三花转债	12,336	1,615,892.64	0.07
5	110079	杭银转债	7,950	905,266.50	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 9 月 29 日，招商银行因违反外汇市场交易管理行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检[2020]76 号）责令改正、并处罚款人民币 120 万元的行政处罚，并对直接负责主管和其他直接责任人员给予处分。2020 年 11 月 27 日，招商银行因金融机构违反规定办理结汇、售汇的行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检（2020）92 号）责令改正、并处罚款人民币 55 万元、没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚。2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

2021 年 1 月 12 日，杭州银行因经收的海关税款存在延压情况等违法违规事项，被中国人民银行杭州中心支行（杭银处罚字[2021]6 号）给予警告，并处罚款 25 万元的行政处罚。2021 年 5 月 18 日，杭州银行因房地产项目融资业务不审慎等违法违规事项，被中国银保监会浙江监管局（浙银保监罚决字（2021）25 号）给予罚款 250 万元的行政处罚。

本基金投资招商银行、杭银转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	603,022.92
2	应收证券清算款	5,585,732.17
3	应收股利	-
4	应收利息	846,209.32
5	应收申购款	1,799,228.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,834,193.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
96,436	20,765.92	580,350,777.16	28.98%	1,422,231,742.11	71.02%

8.2 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	308,901.55	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	2,730,307,040.56
本报告期基金总申购份额	186,799,774.11
减：本报告期基金总赎回份额	914,524,295.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,002,582,519.27

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先生新任本基金管理人的督察长。

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：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	3,252,506,393.49	46.48%	3,029,059.64	47.01%	-
浙商证券	1	2,938,078,796.58	41.99%	2,677,478.86	41.56%	-
广发证券	2	542,701,951.42	7.76%	494,567.32	7.68%	-
招商证券	1	182,983,248.43	2.62%	166,753.55	2.59%	-
中信建投	1	80,911,816.02	1.16%	75,351.26	1.17%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	310,808.30	95.21%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	15,638.00	4.79%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.9 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基金投资关	中国证监会基金电子披	2021-01-12

	关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	露网站和公司网站等指定媒介	
2	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21
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(上银转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-27
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
5	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
7	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
8	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
9	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
10	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
11	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
12	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(2021 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
13	华安基金管理有限公司根据指数基金指引修改旗下部分基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-31
14	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(味知香)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
15	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21

16	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（华生科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
17	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（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
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（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
19	关于终止苏州财路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和公司网站等指定媒介	2021-06-07
20	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（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
21	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（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	566,601,686.71	0.00	0.00	566,601,686.71	28.29%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 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》及其更新
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日