

# 华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 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 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
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 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54

8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	93
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	95
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	95
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	95
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	95
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	95
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	95
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
8.12	投资组合报告附注	96
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>97</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	97
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	97
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>98</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>98</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	98
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	98
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	98
11.4	基金投资策略的改变	98
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	99
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	99
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	99
11.8	其他重大事件	100
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>102</b>
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	102
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>102</b>
13.1	备查文件目录	102
13.2	存放地点	102
13.3	查阅方式	102

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015148	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 12 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	97,099,389.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015148	015149
报告期末下属分级基金的份额总额	71,886,419.56 份	25,212,969.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要利用量化选股模型，在保持对中证 1000 指数紧密跟踪的前提下，力争实现超越目标指数的投资收益。具体策略包括：</p> <p>（1）指数化被动投资策略</p> <p>（2）量化增强投资策略</p> <p>（3）模型的应用与调整</p> <p>（4）港股通标的股票投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>6、参与融资业务相关策略</p> <p>7、参与转融通证券出借业务投资策略</p> <p>8、存托凭证投资策略</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本

	基金可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	张姗
	联系电话	021-38969999	400-61-95555
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	400-61-95555
传真		021-68863414	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		朱学华	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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

### 2.5 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	华安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年 7 月 12 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C

本期已实现收益	- 558,162.3 4	- 2,397,745 .62	- 5,276,125 .76	- 6,189,770 .15	- 8,193,630 .55	- 4,130,709 .08
本期利润	- 3,826,517 .02	- 2,454,686 .37	705,064.8 1	- 3,139,396 .39	- 14,146,48 8.95	- 6,700,413 .75
加权平均基金份额本期利润	-0.0458	-0.0685	0.0062	-0.0326	-0.0845	-0.0759
本期加权平均净值利润率	-5.87%	-8.82%	0.66%	-3.48%	-8.74%	-7.92%
本期基金份额净值增长率	-2.76%	-3.16%	-3.52%	-3.89%	-8.49%	-8.67%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	- 10,171,36 9.24	- 3,780,309 .04	- 11,716,09 4.85	- 8,564,622 .26	- 13,237,98 8.87	- 10,222,85 2.34
期末可供分配基金份额利润	-0.1415	-0.1499	-0.1273	-0.1323	-0.0849	-0.0867
期末基金资产净值	61,715,05 0.32	21,432,66 0.65	81,254,93 9.65	56,818,66 4.53	142,631,0 10.41	107,752,6 33.38
期末基金份额净值	0.8585	0.8501	0.8829	0.8778	0.9151	0.9133
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-14.15%	-14.99%	-11.71%	-12.22%	-8.49%	-8.67%

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

华安中证 1000 指数增强 A

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	4.05%	2.05%	4.23%	2.28%	-0.18%	-0.23%
过去六个月	20.15%	1.94%	20.68%	2.13%	-0.53%	-0.19%
过去一年	-2.76%	2.00%	1.41%	2.01%	-4.17%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	-14.15%	1.46%	-12.60%	1.50%	-1.55%	-0.04%

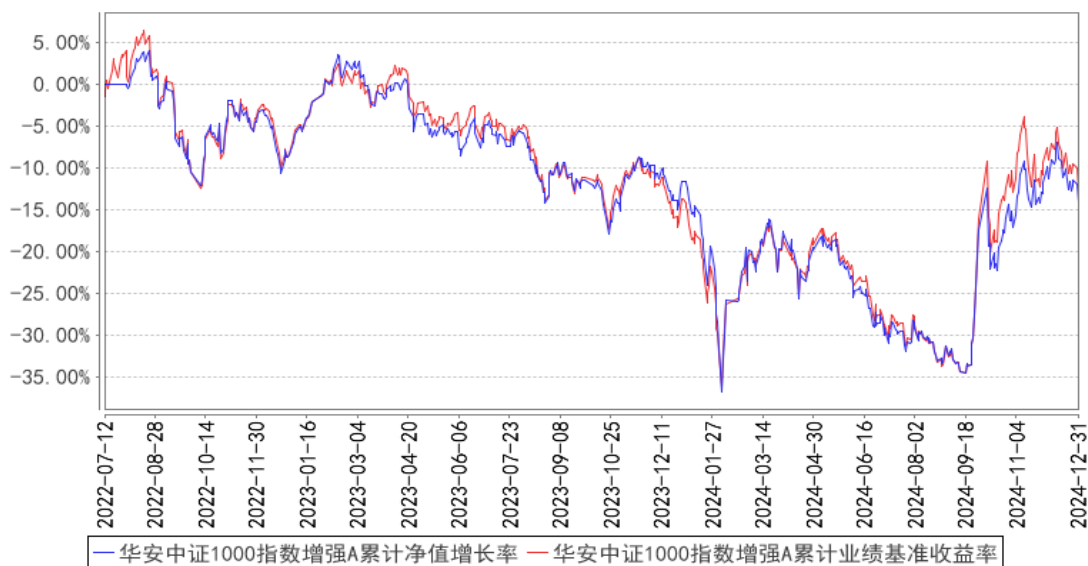
华安中证 1000 指数增强 C

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	3.95%	2.05%	4.23%	2.28%	-0.28%	-0.23%
过去六个月	19.92%	1.94%	20.68%	2.13%	-0.76%	-0.19%
过去一年	-3.16%	2.00%	1.41%	2.01%	-4.57%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	-14.99%	1.46%	-12.60%	1.50%	-2.39%	-0.04%

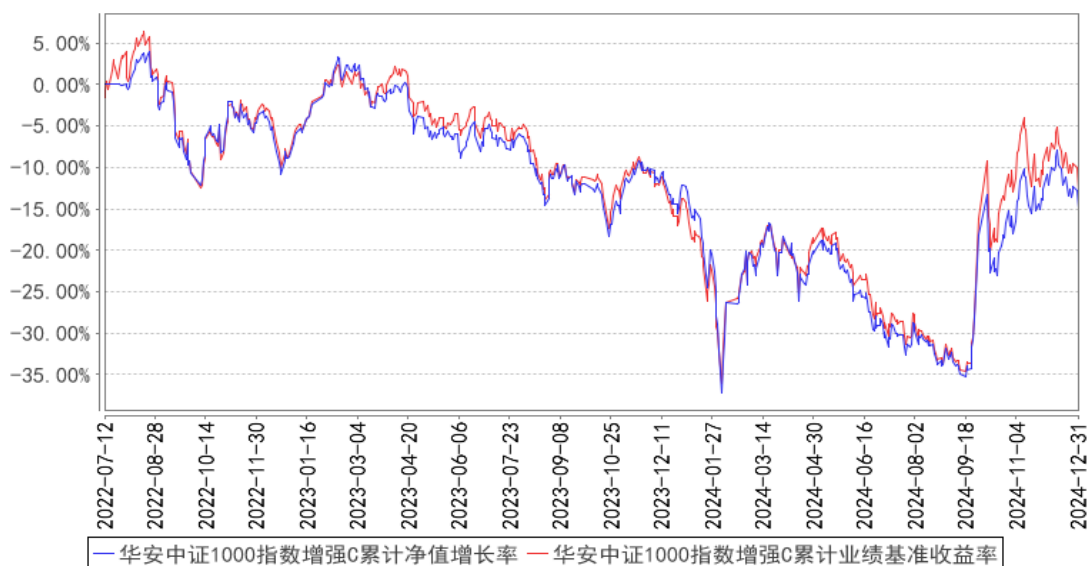


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

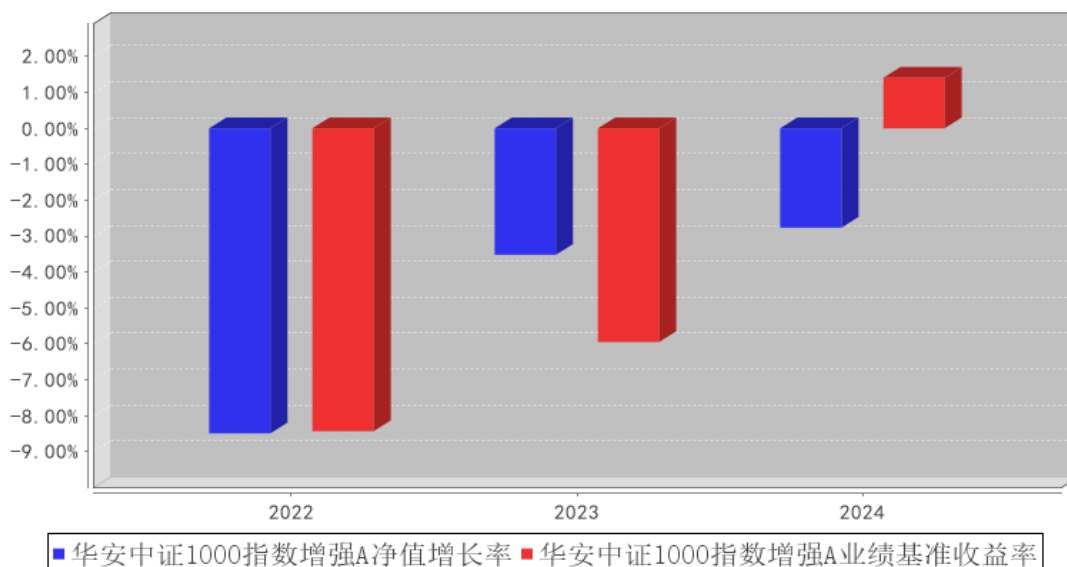


华安中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

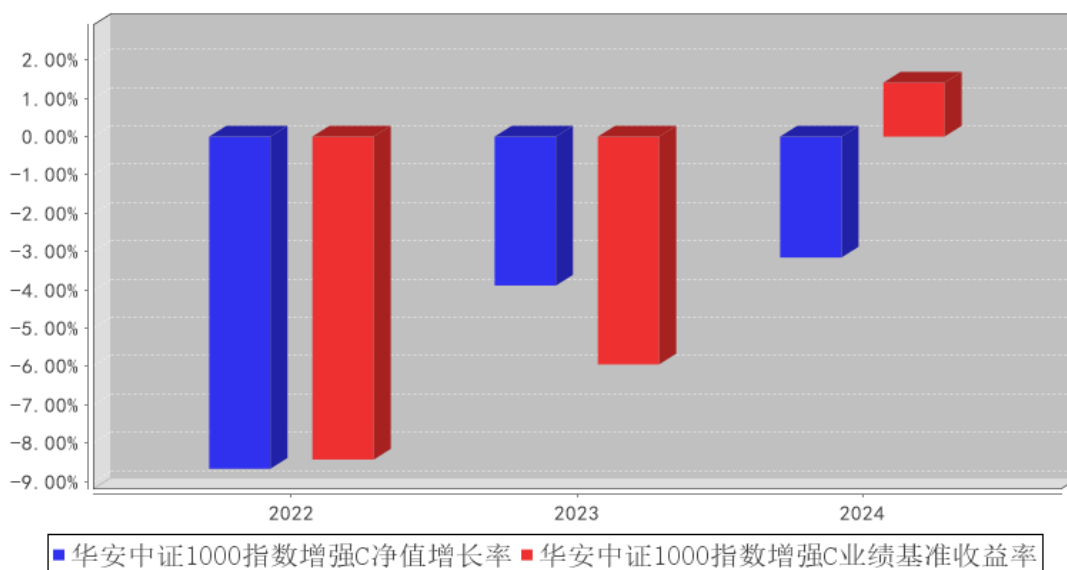


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华安中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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 2024 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 275 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,931.69 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		
马韬	本基金的基金经理	2022 年 7 月 12 日	-	10 年	硕士研究生，10 年证券、基金行业从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究员。2017 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部数量分析师。2018 年 1 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月至 2023 年 2 月，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起，同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

#### 4.2 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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.3 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 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

宏观方面，2024 年全年顺利实现 5.0% 的经济增长目标，多项经济指标显示宏观经济持续复苏，结构上呈现高质量发展。整体失业率平稳，居民收入稳定增长，制造业景气度提升。企业利润虽略降，但高技术制造业增长迅速。

权益市场在全年表现为先抑后扬，年初小微盘股迅速下跌，并在此之后呈现出一个低位震荡的格局，随后在“9.24”政策组合拳的推动下迎来了一轮“V”型反转，主要投资者的风险偏好迅速提升，开始呈现出行业轮动加速、主题投资活跃等特点。行业层面，科技领衔，相关主题层出不穷；风格层面，中小盘股票活跃度提升明显，相对表现也明显强于前三季度。从市场的成交情况也能看到，全 A 日均成交额稳定在万亿以上。

主流的量化策略在过去这一年面临了两次较大挑战，这在历史上也是较为罕见的。一次是在春节前后小微盘流动性危机导致，另一次是在 9.24 之后市场在短期极致的反弹期间，针对此问题我们加强了在组合构建及风险控制方面的深入研究，预期在未来能更好的面对危机时刻。

本基金坚持以量化基本面为核心的投资框架，并不断深耕量化交易策略，通过量化基本面策略建立未来基本面向好、景气度提升且估值性价比高的基础配置组合，再通过量化交易型策略在配置组合之上提升一定的交易频率，获取市场短期非理性定价带来的交易性收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.8585 元，C 类份额净值为 0.8501 元，本报告期 A 类份额净值增长率为-2.76%，同期业绩比较基准增长率为 1.41%，C 类份额净值增长率为-3.16%，同期业绩比较基准增长率为 1.41%。

## 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 2025 年，仍然设定了 5% 左右的稳定增长目标，维持经济的平稳过渡和持续发展，积极应对外部冲击，加大宏观调控，着眼长期规划，平衡供给需求等将成为政策的主要目标。在此背景下，权益市场仍然会有较强的稳定支撑力量，随时市场风险偏好的提升，市场交易活跃度的增强，我们对资本市场保持着长期乐观的态度。

作为中证 1000 指数增强基金的管理人，从量化基本面模型上看，景气度模型依旧是接下来一段时间操作的重点，但是会更加紧密的配合估值模型和交易模型；在交易类策略中，也会密切留意市场流动性的变动对交易模型的冲击，总体的来说，我们将在跟踪指数的前提下，继续坚持量化因子策略，勤勉尽责，力争为投资者获得长期稳定的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 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 2501478 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	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的华安中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 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

	<p>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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(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,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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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 2024 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决</p>



	<p>策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
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	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	6,669,310.20	8,937,286.91
结算备付金		163,001.41	47,470.79

存出保证金		138,153.60	-
交易性金融资产	7.4.7.2	76,467,066.12	129,428,730.01
其中：股票投资		76,418,328.63	129,428,730.01
基金投资		-	-
债券投资		48,737.49	-
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		-	-
应收申购款		11,030.45	166,104.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		83,448,561.78	138,579,592.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		210,533.00	217,962.40
应付管理人报酬		44,564.90	70,805.01
应付托管费		11,141.24	17,701.23
应付销售服务费		7,611.51	19,519.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.16	0.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	27,000.00	180,000.00
负债合计		300,850.81	505,988.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	97,099,389.25	156,760,223.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-13,951,678.28	-18,686,619.02

净资产合计		83,147,710.97	138,073,604.18
负债和净资产总计		83,448,561.78	138,579,592.30

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 97,099,389.25 份，其中 A 类基金份额净值 0.8585 元，基金份额总额 71,886,419.56 份；C 类基金份额净值 0.8501 元，基金份额总额 25,212,969.69 份。

（2）货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 7.2 利润表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,316,456.49	-398,872.30
1. 利息收入		53,725.89	69,352.16
其中：存款利息收入	7.4.7.9	53,725.89	69,352.16
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）		-2,110,517.41	-9,508,397.13
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,090,265.58	-11,444,341.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	15,865.08	211,590.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	775,763.09	-122,785.92
股利收益	7.4.7.13	1,188,120.00	1,847,139.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-3,325,295.43	9,031,564.33

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	65,630.46	8,608.34
<b>减：二、营业总支出</b>		964,746.90	2,035,459.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	560,027.71	1,189,778.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	140,006.99	297,444.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	112,355.76	363,152.87
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		2,798.91	729.56
8. 其他费用	7.4.7.17	149,557.53	184,353.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-6,281,203.39	-2,434,331.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-6,281,203.39	-2,434,331.58
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-6,281,203.39	-2,434,331.58

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	156,760,223.20	-	-18,686,619.02	138,073,604.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	156,760,223.20	-	-18,686,619.02	138,073,604.18
三、本期增减变动额(减少以“-”	-59,660,833.95	-	4,734,940.74	-54,925,893.21

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-6,281,203.39	-6,281,203.39
(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)	-59,660,833.95	-	11,016,144.13	-48,644,689.82
其中: 1. 基金申购款	30,352,006.22	-	-6,769,790.80	23,582,215.42
2. 基金赎回款	-90,012,840.17	-	17,785,934.93	-72,226,905.24
(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	97,099,389.25	-	-13,951,678.28	83,147,710.97
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	273,844,485.00	-	-23,460,841.21	250,383,643.79
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	273,844,485.00	-	-23,460,841.21	250,383,643.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	4,774,222.19	-112,310,039.61
117,084,261.80				
(一)、综合收益总额	-	-	-2,434,331.58	-2,434,331.58
(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)	-	-	7,208,553.77	-109,875,708.03
117,084,261.80				

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	34,564,606.52	-	-1,598,147.22	32,966,459.30
2. 基金赎回款	- 151,648,868.32	-	8,806,700.99	-142,842,167.33
(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	156,760,223.20	-	-18,686,619.02	138,073,604.18

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：

<u>朱学华</u>	<u>朱学华</u>	<u>陈松一</u>
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

华安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]196 号《关于准予华安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2022 年 7 月 12 日生效，首次设立募集规模为 236,358,692.81 份基金份额。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》，本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 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要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31

日的财务状况、2024 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

在符合有关基金分红条件的前提下，由公司根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，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分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

同一类别内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。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

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，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

#### 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2023〕39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对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。

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

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。



对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

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。

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,695,775.26	4,027,039.55
等于：本金	2,695,518.36	4,026,568.24
加：应计利息	256.90	471.31
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-

减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	3,973,534.94	4,910,247.36
等于：本金	3,973,088.68	4,909,760.20
加：应计利息	446.26	487.16
减：坏账准备	-	-
合计	6,669,310.20	8,937,286.91

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	79,141,301.60	-	76,418,328.63	-2,722,972.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	39,000.00	18.69	48,737.49	9,718.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	39,000.00	18.69	48,737.49	9,718.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	79,180,301.60	18.69	76,467,066.12	-2,713,254.17	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	128,919,728.75	-	129,428,730.01	509,001.26	
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	128,919,728.75	-	129,428,730.01	509,001.26

### 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 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	1,254,320.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	1,254,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,254,320.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

#### 7.4.7.3.2 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/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IM2506	IM2506	1.00	1,151,280.00	-103,040.00
合计				-103,040.00
减:可抵销期货 暂收款				-103,040.00
净额				-

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 2024年12月31日	上年度末 2023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	-	-
其中: 交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	27,000.00	60,000.00
预提信息披露费	-	120,000.00
合计	27,000.00	180,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位: 人民币元

##### 华安中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	92,028,836.99	92,028,836.99
本期申购	8,270,796.64	8,270,796.64
本期赎回(以“-”号填列)	-28,413,214.07	-28,413,214.07
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	71,886,419.56	71,886,419.56

华安中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	64,731,386.21	64,731,386.21
本期申购	22,081,209.58	22,081,209.58
本期赎回(以“-”号填列)	-61,599,626.10	-61,599,626.10
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	25,212,969.69	25,212,969.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,716,094.85	942,197.51	-10,773,897.34
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-11,716,094.85	942,197.51	-10,773,897.34
本期利润	-558,162.34	-3,268,354.68	-3,826,517.02
本期基金份额交易产生的变动数	4,283,300.68	145,744.44	4,429,045.12
其中：基金申购款	-1,703,505.18	47,940.76	-1,655,564.42
基金赎回款	5,986,805.86	97,803.68	6,084,609.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,990,956.51	-2,180,412.73	-10,171,369.24

华安中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,564,622.26	651,900.58	-7,912,721.68
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-8,564,622.26	651,900.58	-7,912,721.68
本期利润	-2,397,745.62	-56,940.75	-2,454,686.37
本期基金份额交易产生的变动数	7,942,499.43	-1,355,400.42	6,587,099.01

其中：基金申购款	-5,150,105.58	35,879.20	-5,114,226.38
基金赎回款	13,092,605.01	-1,391,279.62	11,701,325.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,019,868.45	-760,440.59	-3,780,309.04

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	12,941.11	26,822.20
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	23,146.75	20,918.96
结算备付金利息收入	17,638.03	21,611.00
其他	-	-
合计	53,725.89	69,352.16

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,090,265.58	-11,444,341.13
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	-4,090,265.58	-11,444,341.13

##### 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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	1,499,274,169.07	2,625,431,401.10

减：卖出股票成本总额	1,501,399,901.44	2,631,628,710.26
减：交易费用	1,964,533.21	5,247,031.97
买卖股票差价收入	-4,090,265.58	-11,444,341.13

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	46.64	244.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,818.44	211,345.74
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,865.08	211,590.58

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	180,155.01	961,336.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	164,300.00	749,700.00
减：应计利息总额	29.32	252.18
减：交易费用	7.25	38.51
买卖债券差价收入	15,818.44	211,345.74

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	775,763.09	-122,785.92

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,188,120.00	1,847,139.34
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	1,188,120.00	1,847,139.34

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,222,255.43	8,888,924.33
股票投资	-3,231,974.23	8,888,924.33
债券投资	9,718.80	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-103,040.00	142,640.00
权证投资	-	-
期货投资	-103,040.00	142,640.00
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	-3,325,295.43	9,031,564.33

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	51,567.74	8,342.81



基金转换费收入	14,062.72	265.53
合计	65,630.46	8,608.34

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	27,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,557.53	4,353.24
合计	149,557.53	184,353.24

#### 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

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
国泰君安投资管理股份有限公司	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
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 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

无。

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 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	560,027.71	1,189,778.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	261,282.62	561,494.57
应支付基金管理人的净管理费	298,745.09	628,284.32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	140,006.99	297,444.72

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

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 1000 指数 增强 A	华安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	122.11	122.11
华安基金管理有限公司	-	11,556.74	11,556.74
招商银行股份有限公司	-	2,357.25	2,357.25
合计	-	14,036.10	14,036.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安中证 1000 指数 增强 A	华安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	233.50	233.50
华安基金管理有限公司	-	12,031.51	12,031.51
招商银行股份有限公司	-	1,118.34	1,118.34
合计	-	13,383.35	13,383.35

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 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

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
招商银行	2,695,775.26	12,941.11	4,027,039.55	26,822.20

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	1,644	26,632.80
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	575	12,236.00
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券	688479	友车科技	网下申购	1,382	46,974.18

股份有限公司					
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	1,860	43,896.00
国泰君安证券股份有限公司	127086	恒邦转债	老股东配售	1,255	125,500.00
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	1,587	60,242.52
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	2,900	56,550.00
国泰君安证券股份有限公司	123216	科顺转债	老股东配售	185	18,500.00
国泰君安证券股份有限公司	123215	铭利转债	老股东配售	812	81,200.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	2,196	61,488.00
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	695	17,882.35
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,253	15,098.65

#### 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（2024 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

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002494	华斯股份	2024 年 12 月 30 日	重大事项停牌	3.99	2025 年 1 月 14 日	3.60	11,800	49,920.87	47,082.00	-
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	3,300	24,876.87	23,826.00	-

688139	海尔生物	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	454	15,817.60	15,980.80	-
--------	------	------------------	--------	-------	----------------	-------	-----	-----------	-----------	---

#### 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

本基金为股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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。本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	6,669,310.20	-	-	-	6,669,310.20
结算备付金	163,001.41	-	-	-	163,001.41
存出保证金	-	-	-	138,153.60	138,153.60
交易性金融资产	48,737.49	-	-	76,418,328.63	76,467,066.12
应收申购款	-	-	-	11,030.45	11,030.45
资产总计	6,881,049.10	-	-	76,567,512.68	83,448,561.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,533.00	210,533.00
应付管理人报酬	-	-	-	44,564.90	44,564.90
应付托管费	-	-	-	11,141.24	11,141.24
应付销售服务费	-	-	-	7,611.51	7,611.51
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
其他负债	-	-	-	27,000.00	27,000.00
负债总计	-	-	-	300,850.81	300,850.81
利率敏感度缺口	6,881,049.10	-	-	76,266,661.87	83,147,710.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,937,286.91	-	-	-	8,937,286.91
结算备付金	47,470.79	-	-	-	47,470.79
交易性金融资产	-	-	-	129,428,730.01	129,428,730.01
应收申购款	-	-	-	166,104.59	166,104.59
资产总计	8,984,757.70	-	-	129,594,834.60	138,579,592.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	217,962.40	217,962.40
应付管理人报酬	-	-	-	70,805.01	70,805.01
应付托管费	-	-	-	17,701.23	17,701.23
应付销售服务费	-	-	-	19,519.43	19,519.43
应交税费	-	-	-	0.05	0.05
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	505,988.12	505,988.12
利率敏感度缺口	8,984,757.70	-	-	129,088,846.48	138,073,604.18

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06% (2023 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为增强型指数产品，在标的指数成分股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。在多因子量化增强模型和风险监控模型分析的基础上，根据预期收益、风险预算和交易成本的水平，采用成熟的优化软件对股票投资组合进行优化。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。基金的投资组合比例为：股票资产的投资比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	76,418,328.63	91.91	129,428,730.01	93.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	48,737.49	0.06	-	-
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	76,467,066.12	91.97	129,428,730.01	93.74

#### 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,046,084.93	6,389,374.50
	业绩比较基准下降 5%	-4,046,084.93	-6,389,374.50

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	76,380,177.32	129,153,521.50
第二层次	86,888.80	-
第三层次	-	275,208.51
合计	76,467,066.12	129,428,730.01

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	275,208.51	275,208.51
当期购买	-	30,824.43	30,824.43
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	296,293.89	296,293.89
当期利得或损失总额	-	-9,739.05	-9,739.05
其中：计入损益的利得或损失	-	-9,739.05	-9,739.05
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	111,277.00	111,277.00
当期购买	-	508,322.34	508,322.34
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,367,871.43	1,367,871.43

当期利得或损失总额	-	1,023,480.60	1,023,480.60
其中：计入损益的利得或损失	-	1,023,480.60	1,023,480.60
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	275,208.51	275,208.51
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	38,218.89	38,218.89

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	275,208.51	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-217.52%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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 2025 年 3 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	76,418,328.63	91.58
	其中：股票	76,418,328.63	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	48,737.49	0.06
	其中：债券	48,737.49	0.06
	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	6,832,311.61	8.19
8	其他各项资产	149,184.05	0.18
9	合计	83,448,561.78	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	349,471.00	0.42
B	采矿业	1,657,501.00	1.99
C	制造业	37,830,873.48	45.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,467,145.00	2.97
E	建筑业	1,198,231.00	1.44
F	批发和零售业	2,040,216.00	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	3,268,938.00	3.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,454,561.51	6.56
J	金融业	2,772,284.00	3.33
K	房地产业	717,110.68	0.86

L	租赁和商务服务业	1,565,010.00	1.88
M	科学研究和技术服务业	438,070.38	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	807,210.33	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	90,574.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	952,130.00	1.15
S	综合	-	-
	合计	61,609,326.38	74.10

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	90,681.00	0.11
B	采矿业	349,567.00	0.42
C	制造业	9,672,542.45	11.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	544,751.00	0.66
E	建筑业	141,254.00	0.17
F	批发和零售业	413,590.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	562,743.00	0.68
H	住宿和餐饮业	69,887.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	896,025.65	1.08
J	金融业	505,200.00	0.61
K	房地产业	65,389.00	0.08
L	租赁和商务服务业	125,747.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	494,594.47	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	687,321.68	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,860.00	0.01
Q	卫生和社会工作	5,506.00	0.01

R	文化、体育和娱乐业	178,343.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	14,809,002.25	17.81

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002456	欧菲光	34,000	407,320.00	0.49
2	300757	罗博特科	1,400	315,448.00	0.38
3	002948	青岛银行	72,400	280,912.00	0.34
4	000089	深圳机场	40,100	276,289.00	0.33
5	002807	江阴银行	61,500	267,525.00	0.32
6	600138	中青旅	26,000	263,640.00	0.32
7	601528	瑞丰银行	46,500	261,795.00	0.31
8	688608	恒玄科技	790	257,042.30	0.31
9	603323	苏农银行	48,000	253,920.00	0.31
10	300185	通裕重工	98,200	252,374.00	0.30
11	002851	麦格米特	4,000	245,840.00	0.30
12	002839	张家港行	55,800	243,846.00	0.29
13	600821	金开新能	44,400	239,760.00	0.29
14	600572	康恩贝	51,100	238,126.00	0.29
15	002130	沃尔核材	9,400	237,350.00	0.29
16	002745	木林森	27,200	237,184.00	0.29
17	600033	福建高速	60,800	235,904.00	0.28
18	002421	达实智能	67,900	232,897.00	0.28
19	000581	威孚高科	12,300	232,224.00	0.28
20	300296	利亚德	35,700	229,908.00	0.28
21	000528	柳 工	19,000	229,140.00	0.28
22	002461	珠江啤酒	22,900	226,481.00	0.27
23	600728	佳都科技	47,400	221,832.00	0.27
24	600269	赣粤高速	39,500	221,595.00	0.27
25	601619	嘉泽新能	66,400	220,448.00	0.27
26	002498	汉缆股份	62,900	213,231.00	0.26
27	600020	中原高速	50,000	211,000.00	0.25
28	600320	振华重工	53,300	208,936.00	0.25
29	002003	伟星股份	14,671	207,888.07	0.25
30	002489	浙江永强	63,800	206,712.00	0.25



31	601333	广深铁路	60,100	206,143.00	0.25
32	601677	明泰铝业	17,100	205,713.00	0.25
33	601860	紫金银行	72,000	205,200.00	0.25
34	300346	南大光电	5,300	204,527.00	0.25
35	002405	四维图新	21,200	204,368.00	0.25
36	002091	江苏国泰	27,700	202,764.00	0.24
37	600171	上海贝岭	5,100	202,368.00	0.24
38	002126	银轮股份	10,800	202,176.00	0.24
39	601187	厦门银行	35,200	198,528.00	0.24
40	600323	瀚蓝环境	8,400	198,408.00	0.24
41	002249	大洋电机	33,420	196,175.40	0.24
42	002583	海能达	13,700	194,677.00	0.23
43	688235	百济神州	1,204	193,868.08	0.23
44	000690	宝新能源	42,600	190,848.00	0.23
45	600908	无锡银行	32,100	189,711.00	0.23
46	603609	禾丰股份	21,700	187,054.00	0.22
47	600409	三友化工	34,500	186,300.00	0.22
48	002063	远光软件	32,300	186,048.00	0.22
49	600595	中孚实业	65,600	185,648.00	0.22
50	000927	中国铁物	70,200	184,626.00	0.22
51	000685	中山公用	20,000	184,600.00	0.22
52	300068	南都电源	11,400	183,996.00	0.22
53	600315	上海家化	10,800	182,628.00	0.22
54	600273	嘉化能源	22,900	182,513.00	0.22
55	300079	数码视讯	33,500	181,235.00	0.22
56	002079	苏州固锝	17,400	178,698.00	0.21
57	300232	洲明科技	26,000	178,620.00	0.21
58	605599	菜百股份	15,700	178,195.00	0.21
59	600123	兰花科创	20,800	178,048.00	0.21
60	600662	外服控股	35,100	177,957.00	0.21
61	600596	新安股份	20,200	177,356.00	0.21
62	600017	日照港	54,600	174,720.00	0.21
63	300083	创世纪	26,400	171,864.00	0.21
64	600888	新疆众和	24,100	171,110.00	0.21
65	600100	同方股份	24,000	170,640.00	0.21
66	300315	掌趣科技	31,000	170,500.00	0.21
67	600330	天通股份	23,900	169,690.00	0.20
68	002212	天融信	26,300	169,635.00	0.20
69	300088	长信科技	25,900	169,386.00	0.20
70	000881	中广核技	23,100	169,323.00	0.20
71	601811	新华文轩	10,500	166,425.00	0.20
72	600388	龙净环保	13,000	164,450.00	0.20
73	600507	方大特钢	40,600	164,430.00	0.20

74	002004	华邦健康	36,300	164,076.00	0.20
75	600363	联创光电	3,400	162,792.00	0.20
76	600740	山西焦化	39,600	159,588.00	0.19
77	301217	铜冠铜箔	14,300	158,444.00	0.19
78	002446	盛路通信	24,100	157,855.00	0.19
79	000917	电广传媒	22,000	155,540.00	0.19
80	600366	宁波韵升	21,100	155,296.00	0.19
81	002108	沧州明珠	43,200	155,088.00	0.19
82	000990	诚志股份	20,000	155,000.00	0.19
83	601886	江河集团	28,600	154,440.00	0.19
84	600645	中源协和	8,000	154,400.00	0.19
85	600075	新疆天业	35,400	153,990.00	0.19
86	600252	中恒集团	62,500	153,750.00	0.18
87	600877	电科芯片	11,600	153,004.00	0.18
88	603565	中谷物流	15,600	152,880.00	0.18
89	601015	陕西黑猫	45,700	152,638.00	0.18
90	603013	亚普股份	10,100	151,298.00	0.18
91	002990	盛视科技	6,500	150,605.00	0.18
92	301339	通行宝	7,400	150,516.00	0.18
93	601827	三峰环境	17,500	150,150.00	0.18
94	601375	中原证券	34,700	149,904.00	0.18
95	000650	仁和药业	26,000	149,760.00	0.18
96	002088	鲁阳节能	11,700	149,643.00	0.18
97	600395	盘江股份	29,300	149,137.00	0.18
98	002402	和而泰	8,200	148,502.00	0.18
99	000727	冠捷科技	53,200	147,896.00	0.18
100	002859	洁美科技	7,100	147,325.00	0.18
101	600206	有研新材	9,400	147,298.00	0.18
102	603005	晶方科技	5,200	146,900.00	0.18
103	001213	中铁特货	35,100	146,367.00	0.18
104	601200	上海环境	17,900	146,243.00	0.18
105	002233	塔牌集团	19,000	145,730.00	0.18
106	002034	旺能环境	9,400	145,700.00	0.18
106	002550	千红制药	23,500	145,700.00	0.18
107	002139	拓邦股份	10,700	145,627.00	0.18
108	603566	普莱柯	11,400	145,464.00	0.17
109	600810	神马股份	17,800	144,002.00	0.17
110	605589	圣泉集团	6,100	143,838.00	0.17
111	601777	千里科技	18,800	143,820.00	0.17
112	002681	奋达科技	23,000	143,520.00	0.17
113	300115	长盈精密	8,800	142,912.00	0.17
114	002036	联创电子	15,200	142,880.00	0.17
115	600508	上海能源	10,700	141,561.00	0.17

116	002506	协鑫集成	53,000	141,510.00	0.17
117	001309	德明利	1,600	139,520.00	0.17
118	002389	航天彩虹	7,700	138,985.00	0.17
119	300085	银之杰	3,600	137,700.00	0.17
120	300180	华峰超纤	21,800	137,340.00	0.17
121	600874	创业环保	23,000	137,310.00	0.17
122	003040	楚天龙	10,500	137,235.00	0.17
123	688409	富创精密	2,660	137,176.20	0.16
124	300182	捷成股份	23,300	136,771.00	0.16
125	300458	全志科技	3,500	135,660.00	0.16
126	002911	佛燃能源	10,700	135,248.00	0.16
127	002191	劲嘉股份	32,100	134,820.00	0.16
128	300735	光弘科技	4,800	134,352.00	0.16
129	000902	新洋丰	10,300	134,312.00	0.16
130	603358	华达科技	4,000	133,600.00	0.16
131	300077	国民技术	5,600	133,504.00	0.16
132	002837	英维克	3,300	133,320.00	0.16
133	603505	金石资源	5,600	132,944.00	0.16
134	688027	国盾量子	445	132,770.20	0.16
135	000543	皖能电力	16,700	132,097.00	0.16
136	002936	郑州银行	62,800	131,880.00	0.16
137	000028	国药一致	4,500	131,625.00	0.16
138	688018	乐鑫科技	601	131,018.00	0.16
139	600459	贵研铂业	9,500	130,435.00	0.16
140	600338	西藏珠峰	12,200	130,174.00	0.16
141	600552	凯盛科技	11,400	130,074.00	0.16
142	300623	捷捷微电	3,800	129,808.00	0.16
143	300257	开山股份	14,200	129,504.00	0.16
144	001696	宗申动力	5,200	129,480.00	0.16
144	600267	海正药业	15,600	129,480.00	0.16
145	601952	苏垦农发	13,200	129,228.00	0.16
146	600420	国药现代	10,700	127,758.00	0.15
147	601208	东材科技	16,900	127,426.00	0.15
148	600461	洪城环境	12,800	127,360.00	0.15
149	600548	深高速	9,400	126,712.00	0.15
150	600477	杭萧钢构	49,300	126,701.00	0.15
151	603588	高能环境	24,000	125,760.00	0.15
152	002190	成飞集成	6,500	125,710.00	0.15
153	000415	渤海租赁	33,300	125,541.00	0.15
154	301216	万凯新材	12,300	125,460.00	0.15
155	300741	华宝股份	7,200	125,208.00	0.15
156	603299	苏盐井神	11,100	123,654.00	0.15
157	600120	浙江东方	26,200	122,092.00	0.15

158	002399	海普瑞	11,400	121,866.00	0.15
159	600664	哈药股份	29,500	121,835.00	0.15
160	600403	大有能源	41,200	121,128.00	0.15
161	301348	蓝箭电子	4,700	120,414.00	0.14
162	002312	川发龙蟒	8,300	120,101.00	0.14
163	300459	汤姆猫	20,900	119,966.00	0.14
164	000875	吉电股份	22,800	119,928.00	0.14
165	002215	诺普信	10,600	119,038.00	0.14
166	300027	华谊兄弟	45,400	118,948.00	0.14
167	601975	招商南油	38,000	118,940.00	0.14
168	600305	恒顺醋业	14,900	118,902.00	0.14
169	002913	奥士康	4,900	118,139.00	0.14
170	603229	奥翔药业	11,820	118,081.80	0.14
171	002400	省广集团	14,700	117,453.00	0.14
172	002701	奥瑞金	20,700	117,369.00	0.14
173	002163	海南发展	12,500	116,875.00	0.14
174	600550	保变电气	14,800	116,180.00	0.14
175	300123	亚光科技	19,900	115,420.00	0.14
176	600037	歌华有线	15,420	115,033.20	0.14
177	000766	通化金马	7,300	114,610.00	0.14
178	000503	国新健康	10,400	114,192.00	0.14
179	000420	吉林化纤	31,600	114,076.00	0.14
180	002832	比音勒芬	5,300	113,473.00	0.14
181	300679	电连技术	1,900	113,430.00	0.14
182	002428	云南锆业	6,000	113,400.00	0.14
183	601163	三角轮胎	7,500	113,025.00	0.14
184	600116	三峡水利	16,100	112,539.00	0.14
185	300527	中船应急	13,900	112,173.00	0.13
186	600587	新华医疗	6,700	111,555.00	0.13
187	301180	万祥科技	7,200	111,384.00	0.13
188	000567	海德股份	16,300	111,329.00	0.13
189	300666	江丰电子	1,600	111,120.00	0.13
190	002145	中核钛白	26,200	111,088.00	0.13
191	688347	华虹公司	2,377	110,459.19	0.13
192	601107	四川成渝	21,100	110,353.00	0.13
193	002275	桂林三金	7,300	110,157.00	0.13
194	002060	广东建工	30,000	109,800.00	0.13
195	300438	鹏辉能源	3,900	109,629.00	0.13
196	300910	瑞丰新材	2,300	109,457.00	0.13
197	600559	老白干酒	5,200	109,148.00	0.13
198	600812	华北制药	21,100	109,087.00	0.13
199	300294	博雅生物	3,600	109,008.00	0.13
200	600667	太极实业	15,700	108,644.00	0.13

201	000791	甘肃能源	18,000	108,540.00	0.13
202	600641	万业企业	7,400	108,188.00	0.13
203	605296	神农集团	3,900	108,030.00	0.13
204	000968	蓝焰控股	16,200	107,730.00	0.13
205	605116	奥锐特	5,100	107,712.00	0.13
206	000429	粤高速 A	7,300	107,310.00	0.13
207	300857	协创数据	1,000	106,890.00	0.13
208	600195	中牧股份	15,800	106,018.00	0.13
209	000049	德赛电池	4,500	105,795.00	0.13
210	600248	陕建股份	23,600	105,728.00	0.13
211	688001	华兴源创	3,886	105,310.60	0.13
212	600335	国机汽车	16,900	105,287.00	0.13
213	000860	顺鑫农业	5,400	105,138.00	0.13
214	002967	广电计量	6,400	104,960.00	0.13
215	000951	中国重汽	6,180	104,936.40	0.13
216	600827	百联股份	9,600	104,928.00	0.13
217	600717	天津港	21,500	104,705.00	0.13
218	000012	南玻 A	19,800	104,544.00	0.13
219	002497	雅化集团	8,900	104,130.00	0.13
220	301090	华润材料	15,000	104,100.00	0.13
221	605365	立达信	6,600	103,620.00	0.12
222	002537	海联金汇	18,000	103,500.00	0.12
223	600916	中国黄金	12,000	103,440.00	0.12
224	002539	云图控股	13,200	103,224.00	0.12
225	002815	崇达技术	10,100	103,020.00	0.12
226	600475	华光环能	11,433	103,011.33	0.12
227	300181	佐力药业	6,700	102,912.00	0.12
228	000686	东北证券	12,800	101,632.00	0.12
229	000088	盐田港	20,800	101,296.00	0.12
230	300253	卫宁健康	14,100	100,956.00	0.12
231	300627	华测导航	2,400	100,320.00	0.12
232	600623	华谊集团	14,300	100,100.00	0.12
233	001287	中电港	4,900	99,519.00	0.12
234	600151	航天机电	12,400	98,952.00	0.12
235	600929	雪天盐业	17,700	98,943.00	0.12
236	002761	浙江建投	11,200	98,336.00	0.12
237	688037	芯源微	1,168	97,679.84	0.12
238	000099	中信海直	3,700	97,532.00	0.12
239	600597	光明乳业	11,400	97,356.00	0.12
240	688343	云天励飞	1,961	97,265.60	0.12
241	300638	广和通	4,800	96,720.00	0.12
242	600057	厦门象屿	14,900	96,701.00	0.12
243	000930	中粮科技	17,300	96,015.00	0.12

244	688372	伟测科技	1,639	95,914.28	0.12
245	601326	秦港股份	28,500	95,475.00	0.11
246	601801	皖新传媒	12,900	94,686.00	0.11
247	002222	福晶科技	2,920	94,608.00	0.11
248	300725	药石科技	2,800	94,080.00	0.11
249	300663	科蓝软件	5,400	93,744.00	0.11
250	002314	南山控股	39,000	92,820.00	0.11
251	688206	概伦电子	4,896	92,583.36	0.11
252	600780	通宝能源	16,400	92,332.00	0.11
253	300451	创业慧康	20,600	92,288.00	0.11
254	600894	广日股份	6,300	91,980.00	0.11
255	000735	罗牛山	13,700	91,242.00	0.11
256	601718	际华集团	32,000	90,880.00	0.11
257	600058	五矿发展	12,700	90,424.00	0.11
258	600012	皖通高速	5,100	90,015.00	0.11
259	603283	赛腾股份	1,300	89,908.00	0.11
260	688116	天奈科技	2,309	89,612.29	0.11
261	300039	上海凯宝	14,500	89,610.00	0.11
262	688568	中科星图	1,756	89,608.68	0.11
263	600987	航民股份	12,900	89,526.00	0.11
264	600216	浙江医药	5,600	88,816.00	0.11
265	600064	南京高科	11,384	88,453.68	0.11
266	603920	世运电路	3,000	88,200.00	0.11
267	601702	华峰铝业	4,800	87,936.00	0.11
268	300674	宇信科技	4,500	87,840.00	0.11
269	300298	三诺生物	3,400	87,754.00	0.11
270	301565	中仑新材	4,100	87,740.00	0.11
271	300352	北信源	16,500	87,120.00	0.10
272	600158	中体产业	10,500	86,835.00	0.10
273	002698	博实股份	5,100	86,700.00	0.10
274	002053	云南能投	7,600	86,640.00	0.10
275	002726	龙大美食	10,900	86,328.00	0.10
276	300762	上海瀚讯	4,100	86,223.00	0.10
277	601279	英利汽车	22,400	85,792.00	0.10
278	600328	中盐化工	10,900	85,783.00	0.10
279	600562	国睿科技	4,300	85,699.00	0.10
280	000062	深圳华强	3,800	85,120.00	0.10
281	000582	北部湾港	10,800	85,104.00	0.10
282	301526	国际复材	22,900	84,730.00	0.10
283	601963	重庆银行	9,100	84,448.00	0.10
284	000848	承德露露	9,400	84,318.00	0.10
285	600072	中船科技	6,000	84,300.00	0.10
286	000828	东莞控股	7,800	83,382.00	0.10

287	000970	中科三环	8,000	82,960.00	0.10
288	000761	本钢板材	25,900	82,880.00	0.10
289	002041	登海种业	7,600	82,764.00	0.10
290	002258	利尔化学	10,000	82,700.00	0.10
291	600502	安徽建工	17,300	82,694.00	0.10
292	600169	太原重工	33,200	82,668.00	0.10
293	601096	宏盛华源	19,000	82,650.00	0.10
294	000682	东方电子	7,700	82,467.00	0.10
295	600967	内蒙一机	9,700	82,450.00	0.10
296	601369	陕鼓动力	9,400	81,780.00	0.10
297	688006	杭可科技	4,574	81,691.64	0.10
298	300428	立中集团	5,000	81,500.00	0.10
299	002239	奥特佳	26,700	81,435.00	0.10
300	000676	智度股份	9,600	81,216.00	0.10
301	601921	浙版传媒	10,300	81,164.00	0.10
302	002581	未名医药	7,600	80,864.00	0.10
303	002516	旷达科技	15,900	80,613.00	0.10
304	002176	江特电机	10,800	80,028.00	0.10
305	300568	星源材质	8,200	79,704.00	0.10
306	601068	中铝国际	18,000	79,380.00	0.10
307	300416	苏试试验	6,700	78,792.00	0.09
308	603368	柳药集团	4,400	78,584.00	0.09
309	002925	盈趣科技	5,000	78,300.00	0.09
310	300170	汉得信息	6,300	78,120.00	0.09
311	603027	千禾味业	6,448	78,085.28	0.09
312	002010	传化智联	17,100	77,463.00	0.09
313	600869	远东股份	16,200	76,950.00	0.09
314	601609	金田股份	13,000	76,700.00	0.09
315	603636	南威软件	7,300	76,650.00	0.09
316	600850	电科数字	3,200	76,480.00	0.09
317	002324	普利特	8,000	76,240.00	0.09
318	300773	拉卡拉	4,300	76,110.00	0.09
319	300229	拓尔思	3,600	75,384.00	0.09
320	600006	东风股份	10,200	75,174.00	0.09
321	002237	恒邦股份	7,400	74,740.00	0.09
322	603599	广信股份	6,200	74,710.00	0.09
323	688403	汇成股份	8,336	74,690.56	0.09
324	600110	诺德股份	18,600	74,400.00	0.09
325	002127	南极电商	16,900	74,360.00	0.09
325	600997	开滦股份	11,000	74,360.00	0.09
326	600971	恒源煤电	7,900	74,339.00	0.09
327	301087	可孚医疗	2,100	74,256.00	0.09
328	000019	深粮控股	11,300	74,241.00	0.09

329	002221	东华能源	7,800	74,022.00	0.09
330	002302	西部建设	11,200	73,696.00	0.09
331	002597	金禾实业	3,200	73,056.00	0.09
332	300821	东岳硅材	9,400	72,944.00	0.09
333	600577	精达股份	10,000	72,900.00	0.09
334	600602	云赛智联	4,600	72,772.00	0.09
335	002245	蔚蓝锂芯	6,800	72,692.00	0.09
336	000837	秦川机床	8,100	72,657.00	0.09
337	688200	华峰测控	691	72,209.50	0.09
338	603693	江苏新能	7,300	71,905.00	0.09
339	000030	富奥股份	14,000	71,820.00	0.09
340	000557	西部创业	13,800	71,622.00	0.09
341	002706	良信股份	9,300	71,424.00	0.09
342	000672	上峰水泥	9,300	71,145.00	0.09
343	002978	安宁股份	2,500	71,050.00	0.09
344	300075	数字政通	4,100	70,930.00	0.09
345	600757	长江传媒	7,400	70,818.00	0.09
346	300777	中简科技	2,500	70,725.00	0.09
347	002254	泰和新材	7,500	70,500.00	0.08
348	603327	福蓉科技	5,800	70,412.00	0.08
349	002617	露笑科技	9,200	70,380.00	0.08
350	605123	派克新材	1,300	69,888.00	0.08
351	600996	贵广网络	8,100	69,255.00	0.08
352	002654	万润科技	5,700	69,141.00	0.08
353	688019	安集科技	495	68,983.20	0.08
354	603100	川仪股份	3,200	68,960.00	0.08
355	603985	恒润股份	5,900	68,912.00	0.08
356	688586	江航装备	7,185	68,760.45	0.08
357	603236	移远通信	1,000	68,440.00	0.08
358	688327	云从科技	5,650	68,365.00	0.08
359	300779	惠城环保	700	68,320.00	0.08
360	002434	万里扬	11,000	68,200.00	0.08
361	002219	新里程	25,700	67,848.00	0.08
362	000869	张裕 A	2,900	67,251.00	0.08
363	003012	东鹏控股	10,100	66,761.00	0.08
364	300672	国科微	1,000	66,750.00	0.08
365	600211	西藏药业	1,800	66,492.00	0.08
366	300379	东方通	4,400	66,396.00	0.08
367	002151	北斗星通	2,500	66,350.00	0.08
368	600331	宏达股份	8,700	66,294.00	0.08
369	600201	生物股份	9,600	65,856.00	0.08
370	600750	江中药业	2,900	65,830.00	0.08
371	601778	晶科科技	23,200	65,424.00	0.08



372	600458	时代新材	5,100	65,331.00	0.08
373	002020	京新药业	5,100	65,280.00	0.08
374	600651	飞乐音响	15,700	64,998.00	0.08
375	300772	运达股份	4,900	64,876.00	0.08
376	603915	国茂股份	5,500	64,460.00	0.08
377	603638	艾迪精密	3,800	64,182.00	0.08
378	000736	中交地产	7,400	63,640.00	0.08
379	300682	朗新集团	5,200	63,440.00	0.08
380	600866	星湖科技	9,800	63,406.00	0.08
381	000029	深深房 A	4,200	63,252.00	0.08
382	603055	台华新材	5,700	63,156.00	0.08
383	600648	外高桥	5,300	63,123.00	0.08
384	002705	新宝股份	4,200	63,000.00	0.08
385	002396	星网锐捷	3,300	62,667.00	0.08
386	002727	一心堂	4,800	62,496.00	0.08
387	003009	中天火箭	1,600	62,400.00	0.08
388	600446	金证股份	3,600	62,064.00	0.07
389	002697	红旗连锁	10,500	62,055.00	0.07
390	002183	怡亚通	13,800	61,962.00	0.07
391	603997	继峰股份	5,400	61,830.00	0.07
392	688266	泽璟制药	989	61,624.59	0.07
393	000065	北方国际	6,300	61,614.00	0.07
394	002651	利君股份	8,400	61,572.00	0.07
395	601882	海天精工	2,800	61,404.00	0.07
396	600259	广晟有色	2,200	61,182.00	0.07
397	601126	四方股份	3,600	61,056.00	0.07
398	605111	新洁能	1,800	61,038.00	0.07
399	603033	三维股份	4,800	60,912.00	0.07
400	603083	剑桥科技	1,500	60,900.00	0.07
401	002097	山河智能	8,100	60,750.00	0.07
402	688050	爱博医疗	665	60,534.95	0.07
403	300366	创意信息	6,500	60,450.00	0.07
404	600073	光明肉业	8,700	60,378.00	0.07
405	688208	道通科技	1,541	60,345.56	0.07
406	688676	金盘科技	1,455	60,266.10	0.07
407	300624	万兴科技	952	60,118.80	0.07
408	600556	天下秀	11,500	59,800.00	0.07
409	600456	宝钛股份	2,100	59,745.00	0.07
410	301262	海看股份	2,400	59,688.00	0.07
411	300226	上海钢联	2,600	59,462.00	0.07
412	600601	方正科技	13,500	59,265.00	0.07
413	600640	国脉文化	4,900	58,506.00	0.07
414	002061	浙江交科	14,300	58,344.00	0.07

415	605507	国邦医药	2,800	58,324.00	0.07
416	300570	太辰光	800	58,160.00	0.07
417	600125	铁龙物流	9,700	57,521.00	0.07
418	300035	中科电气	3,800	56,810.00	0.07
419	600682	南京新百	8,300	56,772.00	0.07
420	600217	中再资环	10,700	56,710.00	0.07
421	600761	安徽合力	3,200	56,480.00	0.07
422	300045	华力创通	2,700	56,403.00	0.07
423	603619	中曼石油	2,900	56,144.00	0.07
424	300406	九强生物	4,200	56,112.00	0.07
425	002588	史丹利	7,600	56,088.00	0.07
426	000628	高新发展	900	56,061.00	0.07
427	688388	嘉元科技	3,792	55,856.16	0.07
428	002612	朗姿股份	3,400	55,624.00	0.07
429	000422	湖北宜化	4,400	55,528.00	0.07
430	300432	富临精工	3,600	55,368.00	0.07
431	002906	华阳集团	1,800	55,350.00	0.07
432	300026	红日药业	14,600	55,334.00	0.07
433	001389	广合科技	1,100	55,330.00	0.07
434	300738	奥飞数据	3,800	55,100.00	0.07
435	603123	翠微股份	6,800	54,740.00	0.07
436	000061	农产品	7,800	54,678.00	0.07
437	002416	爱施德	3,300	53,691.00	0.06
438	603281	江瀚新材	2,200	53,680.00	0.06
439	000969	安泰科技	4,800	53,520.00	0.06
440	603317	天味食品	4,000	53,360.00	0.06
441	000767	晋控电力	20,900	52,877.00	0.06
442	003006	百亚股份	2,200	52,778.00	0.06
443	002099	海翔药业	10,200	52,632.00	0.06
444	301177	迪阿股份	2,300	52,532.00	0.06
445	600787	中储股份	8,200	52,316.00	0.06
446	688146	中船特气	1,801	52,301.04	0.06
447	600861	北京人力	2,700	52,245.00	0.06
448	601311	骆驼股份	6,300	52,227.00	0.06
449	603355	莱克电气	2,300	52,095.00	0.06
450	688484	南芯科技	1,444	52,041.76	0.06
451	301031	中熔电气	500	52,010.00	0.06
452	603530	神马电力	2,100	51,891.00	0.06
453	600186	莲花控股	9,100	51,870.00	0.06
454	002747	埃斯顿	2,800	51,800.00	0.06
455	603043	广州酒家	3,100	51,553.00	0.06
456	600246	万通发展	6,900	51,405.00	0.06
457	002484	江海股份	2,900	50,982.00	0.06

458	600285	羚锐制药	2,300	50,968.00	0.06
459	300618	寒锐钴业	1,500	50,655.00	0.06
460	002214	大立科技	4,500	50,175.00	0.06
461	688631	莱斯信息	573	49,902.57	0.06
462	600452	涪陵电力	4,700	49,773.00	0.06
463	002274	华昌化工	6,400	49,728.00	0.06
464	688083	中望软件	577	49,373.89	0.06
465	002737	葵花药业	2,400	49,176.00	0.06
466	605368	蓝天燃气	4,300	49,149.00	0.06
467	300687	赛意信息	2,700	49,140.00	0.06
468	600422	昆药集团	3,100	49,135.00	0.06
469	688016	心脉医疗	447	49,102.95	0.06
470	600782	新钢股份	14,700	49,098.00	0.06
471	688166	博瑞医药	1,625	49,075.00	0.06
472	601500	通用股份	9,200	49,036.00	0.06
473	002267	陕天然气	5,800	49,010.00	0.06
474	603103	横店影视	3,400	48,926.00	0.06
475	603612	索通发展	3,600	48,636.00	0.06
476	300770	新媒股份	1,200	48,492.00	0.06
477	002320	海峡股份	7,400	48,470.00	0.06
478	603871	嘉友国际	2,500	48,375.00	0.06
479	002755	奥赛康	3,800	48,298.00	0.06
480	002154	报喜鸟	10,900	48,069.00	0.06
481	688183	生益电子	1,224	48,054.24	0.06
482	688383	新益昌	1,065	47,786.55	0.06
483	300393	中来股份	7,600	47,500.00	0.06
484	601949	中国出版	6,600	47,388.00	0.06
485	000059	华锦股份	9,700	46,463.00	0.06
486	300303	聚飞光电	6,800	46,376.00	0.06
487	603128	华贸物流	7,200	46,296.00	0.06
488	688432	有研硅	4,091	46,228.30	0.06
489	600986	浙文互联	7,700	46,046.00	0.06
490	000758	中色股份	9,300	45,942.00	0.06
491	603877	太平鸟	3,100	45,880.00	0.06
492	000923	河钢资源	3,300	45,870.00	0.06
493	600133	东湖高新	4,900	45,815.00	0.06
494	300596	利安隆	1,500	45,750.00	0.06
495	600210	紫江企业	6,900	45,609.00	0.05
496	300101	振芯科技	2,100	45,486.00	0.05
497	601222	林洋能源	6,400	45,248.00	0.05
498	603983	丸美生物	1,400	45,164.00	0.05
499	600478	科力远	10,900	45,017.00	0.05
500	301559	中集环科	2,900	44,515.00	0.05

501	300166	东方国信	4,700	44,180.00	0.05
502	688776	国光电气	931	44,064.23	0.05
503	600933	爱柯迪	2,700	44,010.00	0.05
504	002174	游族网络	4,700	43,945.00	0.05
505	002833	弘亚数控	2,600	43,758.00	0.05
506	688798	艾为电子	625	43,637.50	0.05
507	603118	共进股份	4,900	43,610.00	0.05
508	600449	宁夏建材	2,900	43,558.00	0.05
509	300133	华策影视	6,000	43,320.00	0.05
510	000048	京基智农	2,400	43,200.00	0.05
511	000035	中国天楹	8,800	42,856.00	0.05
512	600266	城建发展	8,400	42,840.00	0.05
513	605090	九丰能源	1,500	42,795.00	0.05
514	300036	超图软件	2,500	42,450.00	0.05
515	002327	富安娜	4,800	42,432.00	0.05
516	600114	东睦股份	2,600	42,042.00	0.05
517	601969	海南矿业	5,900	41,831.00	0.05
518	600771	广誉远	2,200	41,492.00	0.05
519	600649	城投控股	9,300	41,385.00	0.05
520	002171	楚江新材	5,000	41,000.00	0.05
521	300357	我武生物	2,000	40,640.00	0.05
522	000627	天茂集团	8,700	40,629.00	0.05
523	000737	北方铜业	5,200	40,560.00	0.05
524	603162	海通发展	4,400	40,480.00	0.05
525	600604	市北高新	8,500	40,460.00	0.05
525	603300	海南华铁	7,000	40,460.00	0.05
526	603730	岱美股份	4,500	40,455.00	0.05
527	603328	依顿电子	4,100	40,426.00	0.05
528	300415	伊之密	2,000	40,120.00	0.05
529	300348	长亮科技	2,800	40,040.00	0.05
530	600063	皖维高新	10,000	40,000.00	0.05
531	300443	金雷股份	2,000	39,840.00	0.05
532	300827	上能电气	900	39,510.00	0.05
533	600882	妙可蓝多	2,200	39,380.00	0.05
534	002354	天娱数科	7,300	39,201.00	0.05
535	600301	华锡有色	2,300	39,123.00	0.05
536	300525	博思软件	2,500	38,950.00	0.05
537	001311	多利科技	1,500	38,685.00	0.05
538	605222	起帆电缆	2,500	38,500.00	0.05
539	002585	双星新材	7,200	38,448.00	0.05
540	688105	诺唯赞	1,730	38,354.10	0.05
541	301487	盟固利	1,800	38,286.00	0.05
542	688658	悦康药业	2,656	38,272.96	0.05

543	688029	南微医学	563	38,053.17	0.05
544	300049	福瑞股份	1,200	37,848.00	0.05
545	300811	铂科新材	700	37,737.00	0.05
546	600399	抚顺特钢	6,500	37,700.00	0.05
547	300869	康泰医学	2,700	37,638.00	0.05
548	600864	哈投股份	5,100	37,485.00	0.05
549	300655	晶瑞电材	4,000	37,440.00	0.05
550	301155	海力风电	700	37,317.00	0.04
551	000901	航天科技	3,400	37,298.00	0.04
552	301029	怡合达	1,500	37,080.00	0.04
553	601101	昊华能源	4,500	37,035.00	0.04
554	301246	宏源药业	2,700	36,531.00	0.04
555	301095	广立微	700	36,449.00	0.04
556	300456	赛微电子	2,100	36,078.00	0.04
557	688088	虹软科技	927	35,745.12	0.04
558	603699	纽威股份	1,600	35,472.00	0.04
559	688526	科前生物	2,480	35,439.20	0.04
560	300768	迪普科技	2,000	35,000.00	0.04
561	000680	山推股份	3,600	34,920.00	0.04
562	000555	神州信息	3,100	34,720.00	0.04
563	002335	科华数据	1,200	34,704.00	0.04
564	601137	博威合金	1,700	34,510.00	0.04
565	688318	财富趋势	200	34,200.00	0.04
566	002511	中顺洁柔	5,000	34,050.00	0.04
567	001323	慕思股份	900	34,029.00	0.04
568	688392	骄成超声	833	33,986.40	0.04
569	002270	华明装备	2,000	33,780.00	0.04
570	300319	麦捷科技	2,700	33,696.00	0.04
571	002011	盾安环境	3,100	33,511.00	0.04
572	600976	健民集团	800	33,344.00	0.04
573	688408	中信博	463	33,336.00	0.04
574	000090	天健集团	8,100	33,291.00	0.04
575	688779	五矿新能	6,211	33,042.52	0.04
576	000829	天音控股	2,500	32,950.00	0.04
577	605333	沪光股份	1,000	32,630.00	0.04
578	300130	新国都	1,500	32,490.00	0.04
579	300593	新雷能	2,900	32,480.00	0.04
580	300775	三角防务	1,300	32,409.00	0.04
581	002941	新疆交建	2,900	32,393.00	0.04
582	600751	海航科技	12,300	32,349.00	0.04
583	002101	广东鸿图	2,700	32,346.00	0.04
584	603662	柯力传感	500	32,300.00	0.04
585	002125	湘潭电化	3,200	32,256.00	0.04

586	002544	普天科技	1,500	32,145.00	0.04
587	002081	金螳螂	9,000	32,130.00	0.04
588	000517	荣安地产	14,400	32,112.00	0.04
589	603063	禾望电气	1,600	31,936.00	0.04
590	300171	东富龙	2,400	31,872.00	0.04
591	688167	炬光科技	500	31,850.00	0.04
592	688503	聚和材料	718	31,800.22	0.04
593	603989	艾华集团	2,100	31,668.00	0.04
594	300363	博腾股份	2,000	31,540.00	0.04
595	600643	爱建集团	6,100	31,537.00	0.04
596	002840	华统股份	2,500	31,525.00	0.04
597	000801	四川九洲	2,200	31,482.00	0.04
598	003039	顺控发展	2,400	31,392.00	0.04
599	688066	航天宏图	1,538	31,375.20	0.04
600	300409	道氏技术	2,300	31,303.00	0.04
601	000681	视觉中国	1,500	31,230.00	0.04
602	600059	古越龙山	3,500	31,080.00	0.04
603	301050	雷电微力	600	30,948.00	0.04
604	603301	振德医疗	1,400	30,786.00	0.04
605	002960	青鸟消防	2,600	30,342.00	0.04
606	002291	遥望科技	4,800	30,288.00	0.04
607	688789	宏华数科	456	30,269.28	0.04
608	603305	旭升集团	2,300	30,245.00	0.04
609	603197	保隆科技	800	30,200.00	0.04
610	688190	云路股份	327	30,084.00	0.04
611	688270	臻镭科技	856	29,960.00	0.04
612	300737	科顺股份	5,900	29,913.00	0.04
613	603466	风语筑	3,200	29,824.00	0.04
614	300455	航天智装	2,300	29,808.00	0.04
615	601028	玉龙股份	2,600	29,796.00	0.04
616	688352	硕中科技	2,449	29,706.37	0.04
617	000597	东北制药	5,600	29,512.00	0.04
618	300783	三只松鼠	800	29,496.00	0.04
619	300657	弘信电子	1,300	29,458.00	0.04
620	300327	中颖电子	1,200	29,364.00	0.04
621	300598	诚迈科技	600	29,040.00	0.03
622	300188	国投智能	2,100	28,959.00	0.03
623	600531	豫光金铅	4,500	28,890.00	0.03
624	688322	奥比中光	612	28,458.00	0.03
625	000058	深赛格	3,500	28,105.00	0.03
626	002194	武汉凡谷	2,500	28,050.00	0.03
627	600621	华鑫股份	1,700	28,016.00	0.03
628	000762	西藏矿业	1,300	27,950.00	0.03

629	002390	信邦制药	6,100	27,755.00	0.03
630	001301	尚太科技	400	27,420.00	0.03
631	600759	洲际油气	12,000	27,240.00	0.03
632	600179	安通控股	9,600	27,168.00	0.03
633	002123	梦网科技	2,500	27,025.00	0.03
634	603733	仙鹤股份	1,300	26,819.00	0.03
635	002716	湖南白银	7,900	26,781.00	0.03
636	688333	铂力特	673	26,536.39	0.03
637	603766	隆鑫通用	2,900	26,390.00	0.03
638	603057	紫燕食品	1,300	26,117.00	0.03
639	600993	马应龙	1,000	26,110.00	0.03
640	605376	博迁新材	900	26,055.00	0.03
641	601083	锦江航运	2,700	25,704.00	0.03
642	600428	中远海特	3,500	25,550.00	0.03
643	300776	帝尔激光	400	25,432.00	0.03
644	002023	海特高新	2,500	25,375.00	0.03
645	301039	中集车辆	2,800	25,340.00	0.03
646	301078	孩子王	2,200	25,036.00	0.03
647	600313	农发种业	3,700	24,975.00	0.03
648	601890	亚星锚链	3,200	24,928.00	0.03
649	688261	东微半导	590	24,774.10	0.03
650	688123	聚辰股份	423	24,753.96	0.03
651	002946	新乳业	1,700	24,667.00	0.03
652	000935	四川双马	1,700	24,616.00	0.03
653	002895	川恒股份	1,000	24,600.00	0.03
654	601033	永兴股份	1,700	24,582.00	0.03
655	301558	三态股份	2,800	24,528.00	0.03
656	601022	宁波远洋	3,000	24,090.00	0.03
657	002928	华夏航空	3,100	24,056.00	0.03
658	300080	易成新能	5,500	24,035.00	0.03
659	600635	大众公用	5,400	24,030.00	0.03
660	002488	金固股份	2,300	24,012.00	0.03
661	002048	宁波华翔	1,900	23,978.00	0.03
662	600163	中闽能源	3,900	23,751.00	0.03
663	000899	赣能股份	2,700	23,517.00	0.03
664	002985	北摩高科	1,000	23,500.00	0.03
665	688141	杰华特	759	23,232.99	0.03
666	688389	普门科技	1,550	23,079.50	0.03
667	300747	锐科激光	1,200	22,992.00	0.03
668	300457	赢合科技	1,200	22,968.00	0.03
669	002204	大连重工	4,600	22,908.00	0.03
670	300576	容大感光	500	22,590.00	0.03
671	300236	上海新阳	600	22,422.00	0.03

672	603888	新华网	1,000	22,340.00	0.03
673	603583	捷昌驱动	900	22,239.00	0.03
674	603306	华懋科技	700	22,127.00	0.03
675	300820	英杰电气	400	22,100.00	0.03
676	600657	信达地产	5,300	22,048.00	0.03
677	300926	博俊科技	1,000	22,010.00	0.03
678	688209	英集芯	1,245	21,999.15	0.03
679	000966	长源电力	4,600	21,850.00	0.03
680	000603	盛达资源	1,800	21,582.00	0.03
681	688147	微导纳米	801	21,538.89	0.03
682	688596	正帆科技	605	21,507.75	0.03
683	601020	华钰矿业	1,700	21,454.00	0.03
684	002351	漫步者	1,300	21,450.00	0.03
685	002182	宝武镁业	1,900	21,432.00	0.03
686	300755	华致酒行	1,200	21,408.00	0.03
687	603678	火炬电子	700	21,350.00	0.03
688	002987	京北方	1,500	21,345.00	0.03
689	688336	三生国健	996	21,334.32	0.03
690	000550	江铃汽车	900	21,105.00	0.03
691	000488	ST 晨鸣	6,900	21,045.00	0.03
692	600557	康缘药业	1,500	20,430.00	0.02
693	603876	鼎胜新材	2,300	20,355.00	0.02
694	600185	格力地产	2,800	20,132.00	0.02
695	601595	上海电影	800	19,760.00	0.02
696	300855	图南股份	900	19,728.00	0.02
697	600055	万东医疗	1,300	19,630.00	0.02
698	000811	冰轮环境	1,600	19,616.00	0.02
699	301035	润丰股份	400	19,488.00	0.02
700	688433	华曙高科	832	19,418.88	0.02
701	002635	安洁科技	1,200	19,104.00	0.02
702	603297	永新光学	200	18,764.00	0.02
703	603439	贵州三力	1,400	18,200.00	0.02
704	301219	腾远钴业	400	18,084.00	0.02
705	603279	景津装备	1,000	17,880.00	0.02
706	002773	康弘药业	900	17,640.00	0.02
707	002567	唐人神	3,300	16,830.00	0.02
708	300113	顺网科技	1,000	16,810.00	0.02
709	600094	大名城	4,600	16,744.00	0.02
710	000657	中钨高新	1,800	16,578.00	0.02
711	688582	芯动联科	329	16,551.99	0.02
712	300119	瑞普生物	900	16,533.00	0.02
713	600783	鲁信创投	1,300	16,471.00	0.02
714	300261	雅本化学	2,400	16,440.00	0.02



715	601038	一拖股份	1,100	16,258.00	0.02
716	603567	珍宝岛	1,400	16,240.00	0.02
717	300129	泰胜风能	2,300	16,215.00	0.02
718	002468	申通快递	1,600	16,208.00	0.02
719	301175	中科环保	3,000	16,200.00	0.02
720	688139	海尔生物	454	15,980.80	0.02
721	603477	巨星农牧	900	15,975.00	0.02
722	603108	润达医疗	1,000	15,930.00	0.02
723	601678	滨化股份	4,200	15,792.00	0.02
724	600618	氯碱化工	1,600	15,776.00	0.02
725	600961	株冶集团	2,000	15,740.00	0.02
726	300579	数字认证	500	15,710.00	0.02
727	300482	万孚生物	700	15,687.00	0.02
728	301238	瑞泰新材	1,000	15,660.00	0.02
729	300034	钢研高纳	1,000	15,600.00	0.02
730	002534	西子洁能	1,400	15,554.00	0.02
731	001236	弘业期货	1,600	15,424.00	0.02
732	603713	密尔克卫	300	15,360.00	0.02
733	603025	大豪科技	1,000	15,250.00	0.02
734	002158	汉钟精机	800	14,816.00	0.02
735	300031	宝通科技	800	14,656.00	0.02
736	300678	中科信息	400	14,548.00	0.02
737	600776	东方通信	1,300	14,547.00	0.02
738	002216	三全食品	1,210	14,520.00	0.02
739	600639	浦东金桥	1,300	14,430.00	0.02
740	688048	长光华芯	368	14,348.32	0.02
741	002541	鸿路钢构	800	14,344.00	0.02
742	300475	香农芯创	500	14,245.00	0.02
743	301239	普瑞眼科	300	14,070.00	0.02
744	600710	苏美达	1,500	13,950.00	0.02
745	301508	中机认检	400	13,600.00	0.02
746	002006	精工科技	800	13,200.00	0.02
746	300463	迈克生物	1,000	13,200.00	0.02
747	688298	东方生物	447	13,110.51	0.02
748	688300	联瑞新材	200	12,880.00	0.02
749	301047	义翘神州	200	12,370.00	0.01
750	603337	杰克股份	400	12,184.00	0.01
751	002668	TCL 智家	900	11,808.00	0.01
752	600675	中华企业	4,200	11,802.00	0.01
753	688700	东威科技	400	11,784.00	0.01
754	603008	喜临门	700	11,732.00	0.01
755	688232	新点软件	401	11,624.99	0.01
756	301268	铭利达	700	11,606.00	0.01

757	002100	天康生物	1,700	11,135.00	0.01
758	688177	百奥泰	536	10,387.68	0.01
759	600389	江山股份	700	10,115.00	0.01
760	688400	凌云光	438	9,600.96	0.01
761	002991	甘源食品	100	9,352.00	0.01
762	300726	宏达电子	300	9,330.00	0.01
763	301293	三博脑科	200	8,656.00	0.01
764	002015	协鑫能科	1,100	8,536.00	0.01
765	001337	四川黄金	400	8,352.00	0.01
766	002043	兔宝宝	700	8,316.00	0.01
766	002096	易普力	700	8,316.00	0.01
767	300087	荃银高科	700	8,260.00	0.01
768	600966	博汇纸业	1,600	8,256.00	0.01
769	688707	振华新材	750	8,212.50	0.01
770	002993	奥海科技	200	8,200.00	0.01
771	002326	永太科技	900	8,046.00	0.01
772	002605	姚记科技	300	7,998.00	0.01
773	605009	豪悦护理	200	7,992.00	0.01
774	000810	创维数字	500	7,960.00	0.01
775	688351	微电生理	415	7,901.60	0.01
776	603132	金徽股份	700	7,861.00	0.01
777	002545	东方铁塔	1,100	7,733.00	0.01
778	300856	科思股份	300	7,686.00	0.01
779	301327	华宝新能	100	7,671.00	0.01
780	002349	精华制药	1,000	7,650.00	0.01
781	300850	新强联	400	7,644.00	0.01
782	300641	正丹股份	300	7,452.00	0.01
783	001914	招商积余	700	7,399.00	0.01
784	002675	东诚药业	600	7,332.00	0.01
785	603995	甬金股份	400	7,316.00	0.01
786	002649	博彦科技	600	7,272.00	0.01
787	605577	龙版传媒	500	7,265.00	0.01
788	600835	上海机电	400	7,168.00	0.01
789	603489	八方股份	300	7,146.00	0.01
790	002891	中宠股份	200	7,140.00	0.01
791	301207	华兰疫苗	400	7,004.00	0.01
792	600197	伊力特	400	6,900.00	0.01
793	002777	久远银海	400	6,888.00	0.01
794	688559	海目星	200	6,880.00	0.01
795	300685	艾德生物	300	6,840.00	0.01
796	603881	数据港	299	6,772.35	0.01
797	688007	光峰科技	456	6,744.24	0.01
798	600586	金晶科技	1,200	6,744.00	0.01

799	688629	华丰科技	200	6,698.00	0.01
800	605011	杭州热电	300	6,426.00	0.01
801	603171	税友股份	200	6,100.00	0.01
802	002626	金达威	400	6,040.00	0.01
803	600729	重庆百货	200	5,850.00	0.01
804	688192	迪哲医药	135	5,598.45	0.01
805	301153	中科江南	200	5,588.00	0.01
806	300841	康华生物	100	5,452.00	0.01
807	688097	博众精工	200	5,250.00	0.01
808	688106	金宏气体	305	5,188.05	0.01
809	688739	成大生物	201	5,181.78	0.01
810	688289	圣湘生物	227	5,152.90	0.01
811	688128	中国电研	243	5,105.43	0.01
812	688110	东芯股份	203	5,054.70	0.01
813	688598	金博股份	239	5,033.34	0.01
814	301511	德福科技	400	5,024.00	0.01
815	603039	泛微网络	100	4,900.00	0.01
816	002292	奥飞娱乐	500	4,325.00	0.01
817	002243	力合科创	500	4,030.00	0.00
818	300602	飞荣达	200	3,844.00	0.00
819	002242	九阳股份	200	2,072.00	0.00
820	601515	东峰集团	500	1,990.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301263	泰恩康	4,800	71,952.00	0.09
2	000725	京东方 A	15,600	68,484.00	0.08
3	600551	时代出版	7,500	64,575.00	0.08
4	301212	联盛化学	3,000	62,010.00	0.07
5	300515	三德科技	5,100	60,741.00	0.07
6	002014	永新股份	5,500	60,280.00	0.07
7	603968	醋化股份	6,500	60,255.00	0.07
8	001202	炬申股份	4,200	58,338.00	0.07
9	601228	广州港	17,200	58,308.00	0.07
10	600008	首创环保	17,600	57,728.00	0.07
11	601398	工商银行	8,300	57,436.00	0.07
12	600897	厦门空港	3,700	56,351.00	0.07
13	000055	方大集团	14,300	56,342.00	0.07
14	300774	倍杰特	6,400	56,192.00	0.07
15	601956	东贝集团	11,600	56,028.00	0.07
16	601288	农业银行	10,300	55,002.00	0.07
17	002732	燕塘乳业	3,500	54,985.00	0.07

18	002636	金安国纪	7,100	54,954.00	0.07
19	002671	龙泉股份	12,000	54,360.00	0.07
20	301439	泓淋电力	3,900	53,625.00	0.06
21	601816	京沪高铁	8,700	53,592.00	0.06
22	300371	汇中股份	5,500	52,745.00	0.06
23	600798	宁波海运	17,200	52,116.00	0.06
24	300021	大禹节水	12,700	51,689.00	0.06
25	002286	保龄宝	6,900	50,922.00	0.06
26	603909	建发合诚	5,500	50,380.00	0.06
27	688611	杭州柯林	1,503	50,260.32	0.06
28	600299	安迪苏	4,000	50,200.00	0.06
29	600439	瑞贝卡	14,800	49,876.00	0.06
30	000050	深天马 A	5,500	49,665.00	0.06
31	300911	亿田智能	1,900	49,552.00	0.06
32	000937	冀中能源	7,800	49,296.00	0.06
33	300707	威唐工业	3,200	49,184.00	0.06
34	002033	丽江股份	5,500	48,785.00	0.06
35	000026	飞亚达	4,700	48,739.00	0.06
36	002454	松芝股份	7,300	48,545.00	0.06
37	300190	维尔利	13,800	48,438.00	0.06
38	002526	山东矿机	13,700	48,361.00	0.06
39	603757	大元泵业	2,400	48,120.00	0.06
40	000529	广弘控股	8,100	47,790.00	0.06
41	603676	卫信康	4,800	47,760.00	0.06
42	300513	恒实科技	5,200	47,476.00	0.06
43	002494	华斯股份	11,800	47,082.00	0.06
44	000895	双汇发展	1,800	46,728.00	0.06
45	002391	长青股份	9,300	46,593.00	0.06
46	301026	浩通科技	1,700	46,580.00	0.06
47	301100	风光股份	2,800	46,480.00	0.06
48	002149	西部材料	2,600	46,020.00	0.06
49	300800	力合科技	4,400	45,892.00	0.06
50	600688	上海石化	14,900	44,998.00	0.05
51	002345	潮宏基	7,700	44,737.00	0.05
52	001299	美能能源	3,500	43,540.00	0.05
53	002228	合兴包装	14,500	43,500.00	0.05
54	301302	华如科技	1,800	43,290.00	0.05
55	688132	邦彦技术	2,547	43,248.06	0.05
56	603138	海量数据	3,000	43,110.00	0.05
57	000726	鲁泰 A	6,600	43,032.00	0.05
58	603681	永冠新材	3,300	42,537.00	0.05
59	605259	绿田机械	2,800	42,420.00	0.05
60	301006	迈拓股份	3,200	42,176.00	0.05

61	688156	路德环境	3,117	42,173.01	0.05
62	002687	乔治白	9,600	42,048.00	0.05
63	000538	云南白药	700	41,965.00	0.05
64	601766	中国中车	5,000	41,900.00	0.05
65	688137	近岸蛋白	1,262	41,898.40	0.05
66	600071	凤凰光学	2,000	41,700.00	0.05
67	002546	新联电子	9,500	41,135.00	0.05
68	605288	凯迪股份	1,200	40,764.00	0.05
69	603199	九华旅游	1,200	40,500.00	0.05
70	002669	康达新材	4,200	40,446.00	0.05
71	601939	建设银行	4,600	40,434.00	0.05
72	600004	白云机场	4,200	40,320.00	0.05
73	600346	恒力石化	2,600	39,910.00	0.05
74	300510	金冠股份	9,400	39,856.00	0.05
75	301117	佳缘科技	1,300	39,819.00	0.05
76	300745	欣锐科技	2,500	39,800.00	0.05
77	601808	中海油服	2,600	39,650.00	0.05
78	002574	明牌珠宝	8,600	39,646.00	0.05
79	600054	黄山旅游	3,500	39,550.00	0.05
80	603233	大参林	2,600	39,156.00	0.05
81	300420	五洋自控	12,500	38,875.00	0.05
82	002753	永东股份	6,200	38,874.00	0.05
83	300977	深圳瑞捷	2,100	38,703.00	0.05
84	603379	三美股份	1,000	38,380.00	0.05
85	300423	昇辉科技	5,500	38,060.00	0.05
86	002986	宇新股份	3,200	38,016.00	0.05
87	603065	宿迁联盛	5,200	37,804.00	0.05
88	301115	建科股份	2,700	37,773.00	0.05
89	301387	光大同创	1,100	37,730.00	0.05
90	300305	裕兴股份	6,900	37,605.00	0.05
91	603177	德创环保	5,100	37,536.00	0.05
92	603059	倍加洁	1,600	37,328.00	0.04
93	000729	燕京啤酒	3,100	37,324.00	0.04
94	003043	华亚智能	900	37,260.00	0.04
95	601818	光大银行	9,600	37,152.00	0.04
96	002554	惠博普	14,800	37,148.00	0.04
97	002007	华兰生物	2,200	37,070.00	0.04
98	600282	南钢股份	7,900	37,051.00	0.04
99	000715	中兴商业	5,300	36,835.00	0.04
100	301273	瑞晨环保	2,000	36,580.00	0.04
101	601658	邮储银行	6,400	36,352.00	0.04
102	000778	新兴铸管	9,400	36,096.00	0.04
103	600642	申能股份	3,800	36,062.00	0.04

104	002903	宇环数控	2,200	35,750.00	0.04
105	301270	汉仪股份	1,000	35,740.00	0.04
106	603192	汇得科技	2,400	35,616.00	0.04
107	002852	道道全	4,300	35,518.00	0.04
108	301389	隆扬电子	2,100	35,112.00	0.04
109	301092	争光股份	1,500	34,995.00	0.04
110	601330	绿色动力	5,300	34,768.00	0.04
111	600655	豫园股份	5,400	34,722.00	0.04
112	601728	中国电信	4,800	34,656.00	0.04
113	688566	吉贝尔	1,546	34,630.40	0.04
114	600236	桂冠电力	5,000	34,000.00	0.04
115	301335	天元宠物	1,500	33,750.00	0.04
116	600968	海油发展	7,900	33,733.00	0.04
117	605138	盛泰集团	6,100	33,672.00	0.04
118	000831	中国稀土	1,200	33,660.00	0.04
119	300828	锐新科技	2,000	33,640.00	0.04
120	000598	兴蓉环境	4,400	33,396.00	0.04
121	605377	华旺科技	2,500	33,375.00	0.04
122	600000	浦发银行	3,200	32,928.00	0.04
122	603601	再升科技	9,800	32,928.00	0.04
123	002631	德尔未来	7,400	32,782.00	0.04
124	600237	铜峰电子	5,000	32,750.00	0.04
125	688148	芳源股份	6,614	32,739.30	0.04
126	301256	华融化学	4,300	32,723.00	0.04
127	600706	曲江文旅	3,400	32,640.00	0.04
128	300095	华伍股份	4,800	32,592.00	0.04
128	300818	耐普矿机	1,200	32,592.00	0.04
129	300848	美瑞新材	2,000	32,500.00	0.04
130	300868	杰美特	1,200	32,496.00	0.04
131	000723	美锦能源	7,200	32,472.00	0.04
132	002559	亚威股份	3,600	32,292.00	0.04
133	601868	中国能建	14,100	32,289.00	0.04
134	603239	浙江仙通	2,400	32,280.00	0.04
135	600528	中铁工业	4,000	32,240.00	0.04
136	301303	真兰仪表	2,100	32,172.00	0.04
137	000920	沃顿科技	3,600	32,112.00	0.04
138	603086	先达股份	7,500	32,100.00	0.04
139	603209	兴通股份	2,000	31,960.00	0.04
140	300140	节能环保	5,300	31,747.00	0.04
141	301198	喜悦智行	2,900	31,668.00	0.04
142	001222	源飞宠物	2,000	31,660.00	0.04
142	301055	张小泉	2,000	31,660.00	0.04
143	688292	浩瀚深度	1,592	31,521.60	0.04

144	300583	赛托生物	1,600	31,280.00	0.04
145	300819	聚杰微纤	2,400	31,200.00	0.04
146	688053	思科瑞	1,100	31,130.00	0.04
147	300958	建工修复	2,700	31,104.00	0.04
148	300636	同和药业	3,900	31,083.00	0.04
149	301313	凡拓数创	1,200	31,056.00	0.04
150	300389	艾比森	2,600	30,966.00	0.04
151	600529	山东药玻	1,200	30,924.00	0.04
152	300877	金春股份	2,200	30,910.00	0.04
153	600258	首旅酒店	2,100	30,807.00	0.04
154	002912	中新赛克	1,200	30,708.00	0.04
155	605133	嵘泰股份	1,300	30,589.00	0.04
156	300404	博济医药	3,500	30,555.00	0.04
157	300556	丝路视觉	1,600	30,480.00	0.04
158	003011	海象新材	2,000	30,400.00	0.04
159	300865	大宏立	1,300	30,342.00	0.04
160	300614	百川畅银	3,200	30,336.00	0.04
161	002949	华阳国际	1,700	30,294.00	0.04
162	688179	阿拉丁	2,193	30,263.40	0.04
163	301017	漱玉平民	2,500	29,875.00	0.04
164	600200	江苏吴中	3,200	29,824.00	0.04
165	001206	依依股份	1,800	29,754.00	0.04
166	300144	宋城演艺	3,200	29,728.00	0.04
167	003025	思进智能	2,100	29,589.00	0.04
168	601918	新集能源	4,100	29,438.00	0.04
169	300676	华大基因	700	29,379.00	0.04
170	688020	方邦股份	825	29,163.75	0.04
171	000541	佛山照明	4,700	29,140.00	0.04
172	600425	青松建化	7,400	29,008.00	0.03
173	603186	华正新材	1,200	28,908.00	0.03
174	600183	生益科技	1,200	28,860.00	0.03
175	002772	众兴菌业	3,900	28,743.00	0.03
176	688306	均普智能	3,621	28,062.75	0.03
177	301388	欣灵电气	1,200	27,588.00	0.03
178	603585	苏利股份	2,300	27,531.00	0.03
179	600009	上海机场	800	27,320.00	0.03
180	601328	交通银行	3,500	27,195.00	0.03
181	600790	轻纺城	7,200	27,000.00	0.03
182	002398	垒知集团	6,100	26,779.00	0.03
183	600371	万向德农	3,100	26,753.00	0.03
184	688168	安博通	682	26,666.20	0.03
185	000100	TCL 科技	5,300	26,659.00	0.03
186	601018	宁波港	6,800	26,180.00	0.03

187	003030	祖名股份	1,700	26,146.00	0.03
188	688398	赛特新材	1,932	26,043.36	0.03
189	688009	中国通号	4,112	25,741.12	0.03
190	002206	海利得	6,000	25,740.00	0.03
191	600352	浙江龙盛	2,500	25,725.00	0.03
192	000553	安道麦 A	3,800	25,384.00	0.03
193	688677	海泰新光	674	25,382.84	0.03
194	603898	好莱客	2,700	25,380.00	0.03
195	601169	北京银行	4,100	25,215.00	0.03
196	603987	康德莱	3,500	25,130.00	0.03
197	600018	上港集团	4,100	25,092.00	0.03
198	601857	中国石油	2,800	25,032.00	0.03
199	601991	大唐发电	8,700	24,795.00	0.03
200	601231	环旭电子	1,500	24,750.00	0.03
201	603966	法兰泰克	3,200	24,704.00	0.03
202	002189	中光学	1,200	24,696.00	0.03
202	300664	鹏鹞环保	4,200	24,696.00	0.03
203	688176	亚虹医药	3,634	24,674.86	0.03
204	600019	宝钢股份	3,500	24,500.00	0.03
205	600050	中国联通	4,600	24,426.00	0.03
206	002831	裕同科技	900	24,390.00	0.03
206	603755	日辰股份	900	24,390.00	0.03
207	002457	青龙管业	2,100	24,360.00	0.03
208	605007	五洲特纸	1,900	24,301.00	0.03
209	600578	京能电力	6,900	24,288.00	0.03
210	300092	科新机电	2,100	24,234.00	0.03
211	600027	华电国际	4,300	24,123.00	0.03
212	600160	巨化股份	1,000	24,120.00	0.03
212	600500	中化国际	6,000	24,120.00	0.03
213	002672	东江环保	5,700	24,111.00	0.03
213	300355	蒙草生态	4,700	24,111.00	0.03
214	300193	佳士科技	2,700	24,003.00	0.03
215	000599	青岛双星	5,400	23,976.00	0.03
216	300228	富瑞特装	3,400	23,970.00	0.03
217	603258	电魂网络	1,200	23,868.00	0.03
218	002252	上海莱士	3,300	23,826.00	0.03
219	002943	宇晶股份	1,200	23,808.00	0.03
220	300994	久祺股份	2,100	23,688.00	0.03
221	300887	谱尼测试	3,100	23,684.00	0.03
222	600380	健康元	2,100	23,667.00	0.03
223	002026	山东威达	2,400	23,616.00	0.03
224	301062	上海艾录	1,800	23,580.00	0.03
225	301292	海科新源	1,800	23,544.00	0.03



226	601996	丰林集团	11,000	23,540.00	0.03
227	688033	天宜上佳	4,087	23,500.25	0.03
228	002440	闰土股份	3,500	23,485.00	0.03
229	002301	齐心集团	3,300	23,463.00	0.03
230	002556	辉隆股份	4,200	23,394.00	0.03
231	301319	唯特偶	800	23,328.00	0.03
232	300514	友讯达	1,600	23,104.00	0.03
233	603151	邦基科技	2,300	23,023.00	0.03
234	003019	宸展光电	900	23,022.00	0.03
235	301073	君亭酒店	1,100	22,957.00	0.03
236	002039	黔源电力	1,500	22,890.00	0.03
237	002858	力盛体育	2,000	22,880.00	0.03
238	301373	凌玮科技	900	22,842.00	0.03
239	600271	航天信息	2,500	22,775.00	0.03
240	605003	众望布艺	1,200	22,680.00	0.03
241	301028	东亚机械	2,100	22,659.00	0.03
242	300388	节能国祯	3,000	22,650.00	0.03
243	002793	罗欣药业	5,900	22,538.00	0.03
244	002136	安纳达	2,300	22,425.00	0.03
245	600353	旭光电子	3,100	22,382.00	0.03
246	603066	音飞储存	2,100	22,323.00	0.03
247	001256	炜冈科技	1,400	22,260.00	0.03
248	300481	濮阳惠成	1,500	22,230.00	0.03
249	002478	常宝股份	4,200	22,218.00	0.03
250	688283	坤恒顺维	893	21,985.66	0.03
251	002196	方正电机	4,100	21,976.00	0.03
252	002001	新和成	1,000	21,970.00	0.03
253	002279	久其软件	3,500	21,945.00	0.03
254	688371	菲沃泰	1,412	21,914.24	0.03
255	603429	集友股份	3,500	21,910.00	0.03
256	603626	科森科技	2,800	21,840.00	0.03
257	300452	山河药辅	1,800	21,798.00	0.03
258	600410	华胜天成	3,000	21,720.00	0.03
259	301200	大族数控	600	21,708.00	0.03
260	688133	泰坦科技	1,187	21,650.88	0.03
261	300329	海伦钢琴	4,200	21,588.00	0.03
262	601988	中国银行	3,900	21,489.00	0.03
263	688600	皖仪科技	1,574	21,170.30	0.03
264	000032	深桑达 A	1,200	21,168.00	0.03
265	301314	科瑞思	600	21,150.00	0.03
266	002305	南国置业	10,600	21,094.00	0.03
267	300659	中孚信息	1,300	21,047.00	0.03
268	301112	信邦智能	900	21,033.00	0.03

269	001965	招商公路	1,500	20,925.00	0.03
270	300326	凯利泰	3,200	20,800.00	0.03
271	300912	凯龙高科	1,800	20,700.00	0.02
272	300552	万集科技	600	20,610.00	0.02
273	688073	毕得医药	419	20,598.04	0.02
274	002187	广百股份	2,900	20,532.00	0.02
275	000417	合百集团	3,200	20,416.00	0.02
276	688625	呈和科技	534	20,388.12	0.02
277	002229	鸿博股份	1,700	20,383.00	0.02
278	300920	润阳科技	1,200	20,304.00	0.02
279	001326	联域股份	600	20,268.00	0.02
280	300639	凯普生物	3,400	20,162.00	0.02
281	300132	青松股份	4,000	19,720.00	0.02
282	603825	华扬联众	1,300	19,617.00	0.02
283	301227	森鹰窗业	1,200	19,440.00	0.02
284	600737	中粮糖业	1,900	19,399.00	0.02
285	603068	博通集成	700	19,355.00	0.02
286	301161	唯万密封	900	19,233.00	0.02
287	688030	山石网科	1,237	19,173.50	0.02
288	688466	金科环境	1,408	19,078.40	0.02
289	601611	中国核建	2,100	18,984.00	0.02
290	300767	震安科技	2,100	18,942.00	0.02
291	605099	共创草坪	900	18,882.00	0.02
292	688011	新光光电	1,225	18,767.00	0.02
293	600350	山东高速	1,800	18,504.00	0.02
294	601665	齐鲁银行	3,300	18,447.00	0.02
295	300718	长盛轴承	600	18,414.00	0.02
296	002203	海亮股份	1,700	18,275.00	0.02
297	301419	阿莱德	600	18,114.00	0.02
298	600887	伊利股份	600	18,108.00	0.02
299	603863	松炆资源	900	18,099.00	0.02
300	603136	天目湖	1,600	18,080.00	0.02
301	605166	聚合顺	1,500	17,955.00	0.02
302	300332	天壕能源	3,100	17,949.00	0.02
303	000404	长虹华意	2,400	17,760.00	0.02
304	002084	海鸥住工	6,100	17,568.00	0.02
305	603102	百合股份	500	17,550.00	0.02
306	605289	罗曼股份	700	17,542.00	0.02
307	000883	湖北能源	3,500	17,430.00	0.02
308	688158	优刻得	1,241	17,349.18	0.02
309	688101	三达膜	1,321	17,291.89	0.02
310	002373	千方科技	1,700	17,238.00	0.02
311	601916	浙商银行	5,900	17,169.00	0.02

312	001360	南矿集团	1,300	17,160.00	0.02
313	600332	白云山	600	17,052.00	0.02
314	300164	通源石油	4,000	17,040.00	0.02
315	601666	平煤股份	1,700	17,034.00	0.02
316	601825	沪农商行	2,000	17,020.00	0.02
317	300610	晨化股份	1,700	17,000.00	0.02
318	000703	恒逸石化	2,700	16,956.00	0.02
319	601139	深圳燃气	2,400	16,944.00	0.02
320	000713	丰乐种业	2,400	16,920.00	0.02
321	688114	华大智造	361	16,891.19	0.02
322	600863	内蒙华电	3,900	16,887.00	0.02
323	600377	宁沪高速	1,100	16,841.00	0.02
324	600153	建发股份	1,600	16,832.00	0.02
325	300559	佳发教育	1,400	16,744.00	0.02
325	600039	四川路桥	2,300	16,744.00	0.02
326	600510	黑牡丹	3,500	16,695.00	0.02
327	301093	华兰股份	700	16,660.00	0.02
327	601158	重庆水务	3,400	16,660.00	0.02
328	601128	常熟银行	2,200	16,654.00	0.02
329	002540	亚太科技	2,700	16,632.00	0.02
330	688293	奥浦迈	455	16,598.40	0.02
331	601598	中国外运	3,100	16,585.00	0.02
332	600546	山煤国际	1,400	16,562.00	0.02
333	603816	顾家家居	600	16,548.00	0.02
334	600021	上海电力	1,800	16,506.00	0.02
335	688560	明冠新材	1,286	16,447.94	0.02
336	688369	致远互联	819	16,437.33	0.02
337	301152	天力锂能	500	16,425.00	0.02
338	000629	钒钛股份	5,700	16,416.00	0.02
339	002225	濮耐股份	3,300	16,401.00	0.02
340	600161	天坛生物	800	16,400.00	0.02
341	601828	美凯龙	5,100	16,371.00	0.02
342	002106	莱宝高科	1,500	16,365.00	0.02
343	603536	惠发食品	1,400	16,352.00	0.02
344	688022	瀚川智能	1,490	16,330.40	0.02
345	002981	朝阳科技	700	16,324.00	0.02
346	601106	中国一重	5,600	16,296.00	0.02
347	603088	宁波精达	1,800	16,290.00	0.02
347	603216	梦天家居	1,500	16,290.00	0.02
348	600429	三元股份	3,700	16,280.00	0.02
349	601377	兴业证券	2,600	16,276.00	0.02
350	601006	大秦铁路	2,400	16,272.00	0.02
351	000739	普洛药业	1,000	16,260.00	0.02

352	603158	腾龙股份	2,000	16,160.00	0.02
353	002768	国恩股份	700	16,149.00	0.02
354	601007	金陵饭店	2,300	16,123.00	0.02
355	688496	清越科技	1,880	16,111.60	0.02
356	603160	汇顶科技	200	16,108.00	0.02
357	301168	通灵股份	600	16,098.00	0.02
358	300945	曼卡龙	1,400	16,086.00	0.02
359	600229	城市传媒	2,300	16,031.00	0.02
360	002236	大华股份	1,000	16,000.00	0.02
360	002658	雪迪龙	2,500	16,000.00	0.02
361	000559	万向钱潮	2,600	15,990.00	0.02
362	688626	翔宇医疗	542	15,929.38	0.02
363	300491	通合科技	1,000	15,920.00	0.02
364	600535	天士力	1,100	15,906.00	0.02
365	002615	哈尔斯	2,000	15,900.00	0.02
366	688551	科威尔	568	15,898.32	0.02
367	300369	绿盟科技	2,200	15,818.00	0.02
368	601058	赛轮轮胎	1,100	15,763.00	0.02
369	605060	联德股份	900	15,723.00	0.02
370	688659	元琛科技	2,329	15,720.75	0.02
371	600109	国金证券	1,800	15,714.00	0.02
372	002983	芯瑞达	800	15,712.00	0.02
373	002029	七匹狼	2,400	15,696.00	0.02
374	002957	科瑞技术	1,000	15,690.00	0.02
375	002645	华宏科技	2,300	15,686.00	0.02
376	300545	联得装备	500	15,665.00	0.02
377	002128	电投能源	800	15,664.00	0.02
378	300207	欣旺达	700	15,617.00	0.02
379	002599	盛通股份	2,100	15,603.00	0.02
380	603018	华设集团	1,900	15,599.00	0.02
381	601717	郑煤机	1,200	15,576.00	0.02
382	603309	维力医疗	1,300	15,574.00	0.02
383	600637	东方明珠	2,000	15,520.00	0.02
384	603908	牧高笛	700	15,470.00	0.02
385	603232	格尔软件	1,200	15,456.00	0.02
386	301108	洁雅股份	600	15,450.00	0.02
387	300594	朗进科技	900	15,426.00	0.02
388	301322	绿通科技	700	15,386.00	0.02
389	603595	东尼电子	900	15,381.00	0.02
390	002917	金奥博	1,600	15,296.00	0.02
391	603201	常润股份	900	15,219.00	0.02
392	301066	万事利	1,100	15,191.00	0.02
393	600803	新奥股份	700	15,176.00	0.02

394	603096	新经典	800	15,160.00	0.02
395	603982	泉峰汽车	1,900	15,124.00	0.02
396	002103	广博股份	1,600	15,120.00	0.02
397	300360	炬华科技	900	15,093.00	0.02
398	002595	豪迈科技	300	15,057.00	0.02
399	002255	海陆重工	2,700	15,012.00	0.02
400	601098	中南传媒	1,000	15,010.00	0.02
401	600230	沧州大化	1,400	15,008.00	0.02
402	603738	泰晶科技	1,000	14,980.00	0.02
403	600196	复星医药	600	14,910.00	0.02
404	688323	瑞华泰	1,213	14,907.77	0.02
405	600111	北方稀土	700	14,854.00	0.02
406	601968	宝钢包装	3,000	14,850.00	0.02
407	600129	太极集团	600	14,832.00	0.02
408	301220	亚香股份	400	14,808.00	0.02
409	603883	老百姓	900	14,733.00	0.02
410	603808	歌力思	2,100	14,679.00	0.02
411	688278	特宝生物	200	14,674.00	0.02
412	605136	丽人丽妆	1,700	14,671.00	0.02
413	603799	华友钴业	500	14,630.00	0.02
414	002268	电科网安	900	14,625.00	0.02
415	301221	光庭信息	300	14,574.00	0.02
416	603200	上海洗霸	600	14,562.00	0.02
417	688125	安达智能	371	14,494.97	0.02
418	301486	致尚科技	300	14,355.00	0.02
419	300643	万通智控	1,200	14,352.00	0.02
420	301063	海锅股份	900	14,292.00	0.02
421	002153	石基信息	2,000	14,280.00	0.02
422	688046	药康生物	1,111	14,276.35	0.02
423	603508	思维列控	600	14,268.00	0.02
424	301276	嘉曼服饰	700	14,245.00	0.02
425	301102	兆讯传媒	1,300	14,209.00	0.02
426	688767	博拓生物	430	14,202.90	0.02
427	605305	中际联合	500	14,165.00	0.02
428	688478	晶升股份	499	14,076.79	0.02
429	603538	美诺华	1,100	13,981.00	0.02
430	002167	东方锆业	1,900	13,946.00	0.02
431	688056	莱伯泰科	478	13,938.48	0.02
432	002548	金新农	3,500	13,895.00	0.02
433	002790	瑞尔特	1,900	13,870.00	0.02
434	688489	三未信安	400	13,800.00	0.02
435	603156	养元饮品	600	13,704.00	0.02
436	001366	播恩集团	1,300	13,611.00	0.02

437	301456	盘古智能	600	13,554.00	0.02
438	300365	恒华科技	2,200	13,508.00	0.02
439	603916	苏博特	1,800	13,428.00	0.02
440	688663	新风光	604	13,112.84	0.02
441	300512	中亚股份	1,900	12,939.00	0.02
442	688382	益方生物	965	12,834.50	0.02
443	002657	中科金财	700	12,824.00	0.02
444	301386	未来电器	600	12,654.00	0.02
445	000423	东阿阿胶	200	12,544.00	0.02
446	603280	南方路机	600	12,528.00	0.02
447	002916	深南电路	100	12,500.00	0.02
448	300952	恒辉安防	600	12,498.00	0.02
449	688395	正弦电气	735	12,487.65	0.02
450	301061	匠心家居	200	12,360.00	0.01
451	300837	浙矿股份	600	12,096.00	0.01
452	688244	永信至诚	467	11,955.20	0.01
453	600941	中国移动	100	11,816.00	0.01
454	600938	中国海油	400	11,804.00	0.01
455	688480	赛恩斯	433	11,751.62	0.01
456	001234	泰慕士	700	11,739.00	0.01
457	688373	盟科药业	2,366	11,688.04	0.01
458	600378	昊华科技	400	11,564.00	0.01
459	688117	圣诺生物	446	11,448.82	0.01
460	002641	公元股份	2,600	11,440.00	0.01
461	000967	盈峰环境	2,300	11,431.00	0.01
462	300587	天铁科技	2,600	11,414.00	0.01
463	688356	键凯科技	200	11,388.00	0.01
464	600573	惠泉啤酒	1,000	11,260.00	0.01
465	603639	海利尔	900	11,160.00	0.01
466	600517	国网英大	2,000	11,020.00	0.01
467	002297	博云新材	1,600	11,008.00	0.01
468	002110	三钢闽光	3,300	10,956.00	0.01
469	600612	老凤祥	200	10,854.00	0.01
470	603105	芯能科技	1,200	10,812.00	0.01
471	603518	锦泓集团	1,100	10,780.00	0.01
472	002382	蓝帆医疗	2,100	10,773.00	0.01
473	600177	雅戈尔	1,200	10,680.00	0.01
474	688093	世华科技	528	10,660.32	0.01
475	002334	英威腾	1,400	10,528.00	0.01
476	688737	中自科技	587	10,454.47	0.01
477	688580	伟思医疗	374	10,438.34	0.01
478	002483	润邦股份	2,000	10,420.00	0.01
479	603182	嘉华股份	900	10,359.00	0.01

480	688435	英方软件	343	10,351.74	0.01
481	300816	艾可蓝	400	10,260.00	0.01
482	600308	华泰股份	2,800	10,192.00	0.01
483	002825	纳尔股份	1,300	10,166.00	0.01
484	301333	诺思格	200	9,998.00	0.01
485	688651	盛邦安全	281	9,938.97	0.01
486	301193	家联科技	600	9,918.00	0.01
487	688558	国盛智科	458	9,778.30	0.01
488	688157	松井股份	247	9,709.57	0.01
489	603558	健盛集团	900	9,684.00	0.01
490	688228	开普云	217	9,669.52	0.01
491	688136	科兴制药	441	9,640.26	0.01
492	600098	广州发展	1,500	9,630.00	0.01
493	300138	晨光生物	1,100	9,592.00	0.01
494	002573	清新环境	2,400	9,552.00	0.01
495	600284	浦东建设	1,500	9,405.00	0.01
496	605208	永茂泰	1,200	9,252.00	0.01
497	000959	首钢股份	3,000	9,150.00	0.01
498	603708	家家悦	800	9,112.00	0.01
499	688259	创耀科技	258	9,058.38	0.01
500	000589	贵州轮胎	1,800	9,054.00	0.01
501	600280	中央商场	2,200	9,042.00	0.01
502	300993	玉马科技	800	9,032.00	0.01
503	603700	宁水集团	900	9,009.00	0.01
504	600398	海澜之家	1,200	9,000.00	0.01
505	600684	珠江股份	2,700	8,910.00	0.01
506	002752	昇兴股份	1,400	8,890.00	0.01
507	002533	金杯电工	900	8,856.00	0.01
508	688223	晶科能源	1,241	8,823.51	0.01
509	002170	芭田股份	1,000	8,730.00	0.01
510	002867	周大生	600	8,718.00	0.01
511	603029	天鹅股份	500	8,645.00	0.01
512	000539	粤电力 A	1,900	8,607.00	0.01
513	600219	南山铝业	2,200	8,602.00	0.01
514	002508	老板电器	400	8,572.00	0.01
515	600970	中材国际	900	8,532.00	0.01
516	601898	中煤能源	700	8,526.00	0.01
517	600023	浙能电力	1,500	8,490.00	0.01
518	605117	德业股份	100	8,480.00	0.01
519	002608	江苏国信	1,100	8,437.00	0.01
520	600489	中金黄金	700	8,421.00	0.01
521	000960	锡业股份	600	8,418.00	0.01
522	601121	宝地矿业	1,200	8,400.00	0.01

522	601668	中国建筑	1,400	8,400.00	0.01
522	601997	贵阳银行	1,400	8,400.00	0.01
523	001210	金房能源	600	8,382.00	0.01
524	000501	武商集团	800	8,368.00	0.01
525	605008	长鸿高科	700	8,358.00	0.01
526	001286	陕西能源	900	8,352.00	0.01
527	601179	中国西电	1,100	8,349.00	0.01
528	002799	环球印务	1,100	8,338.00	0.01
529	002886	沃特股份	500	8,310.00	0.01
530	600905	三峡能源	1,900	8,303.00	0.01
531	688355	明志科技	495	8,291.25	0.01
532	301261	恒工精密	200	8,276.00	0.01
533	002838	道恩股份	700	8,267.00	0.01
534	688469	芯联集成	1,611	8,264.43	0.01
535	002202	金风科技	800	8,264.00	0.01
536	003816	中国广核	2,000	8,260.00	0.01
537	300918	南山智尚	800	8,248.00	0.01
538	600795	国电电力	1,800	8,244.00	0.01
539	002303	美盈森	2,300	8,234.00	0.01
540	002919	名臣健康	500	8,225.00	0.01
541	000962	东方钨业	600	8,220.00	0.01
542	600516	方大炭素	1,700	8,211.00	0.01
543	600583	海油工程	1,500	8,205.00	0.01
544	002939	长城证券	1,000	8,200.00	0.01
545	601298	青岛港	900	8,199.00	0.01
546	601669	中国电建	1,500	8,190.00	0.01
547	300445	康斯特	500	8,135.00	0.01
548	600011	华能国际	1,200	8,124.00	0.01
549	002966	苏州银行	1,000	8,110.00	0.01
550	002880	卫光生物	300	8,103.00	0.01
551	603313	梦百合	1,200	8,100.00	0.01
551	603365	水星家纺	500	8,100.00	0.01
552	688667	菱电电控	201	8,078.19	0.01
553	605068	明新旭腾	600	8,070.00	0.01
554	300413	芒果超媒	300	8,067.00	0.01
555	000531	穗恒运 A	1,400	8,064.00	0.01
555	600879	航天电子	900	8,064.00	0.01
556	688108	赛诺医疗	824	8,042.24	0.01
557	688195	腾景科技	200	8,036.00	0.01
558	002131	利欧股份	2,600	8,034.00	0.01
558	600582	天地科技	1,300	8,034.00	0.01
559	000166	申万宏源	1,500	8,025.00	0.01
560	300258	精锻科技	900	8,019.00	0.01



561	002632	道明光学	900	8,010.00	0.01
562	300795	米奥会展	400	8,004.00	0.01
563	300304	云意电气	1,000	8,000.00	0.01
563	601089	福元医药	500	8,000.00	0.01
564	002283	天润工业	1,500	7,980.00	0.01
565	600483	福能股份	800	7,976.00	0.01
566	301323	新莱福	200	7,974.00	0.01
567	000060	中金岭南	1,700	7,973.00	0.01
568	600755	厦门国贸	1,200	7,968.00	0.01
569	300094	国联水产	2,100	7,959.00	0.01
570	301260	格力博	600	7,950.00	0.01
570	600925	苏能股份	1,500	7,950.00	0.01
571	600875	东方电气	500	7,945.00	0.01
572	000932	华菱钢铁	1,900	7,942.00	0.01
573	002401	中远海科	500	7,940.00	0.01
573	300168	万达信息	1,000	7,940.00	0.01
574	000888	峨眉山 A	600	7,938.00	0.01
575	002463	沪电股份	200	7,930.00	0.01
576	688201	信安世纪	897	7,920.51	0.01
577	000911	广农糖业	1,100	7,920.00	0.01
578	600066	宇通客车	300	7,914.00	0.01
579	001201	东瑞股份	500	7,910.00	0.01
579	603081	大丰实业	700	7,910.00	0.01
580	600416	湘电股份	700	7,903.00	0.01
581	002527	新时达	900	7,902.00	0.01
582	300426	唐德影视	800	7,896.00	0.01
583	300575	中旗股份	1,300	7,891.00	0.01
584	600918	中泰证券	1,200	7,884.00	0.01
585	601599	浙文影业	2,200	7,876.00	0.01
585	601865	福莱特	400	7,876.00	0.01
586	002532	天山铝业	1,000	7,870.00	0.01
587	300494	盛天网络	700	7,868.00	0.01
588	002155	湖南黄金	500	7,865.00	0.01
589	002824	和胜股份	500	7,850.00	0.01
590	300421	力星股份	700	7,833.00	0.01
591	301498	乖宝宠物	100	7,832.00	0.01
592	002121	科陆电子	1,800	7,830.00	0.01
593	002208	合肥城建	1,100	7,821.00	0.01
594	600348	华阳股份	1,100	7,799.00	0.01
595	600745	闻泰科技	200	7,756.00	0.01
596	688697	纽威数控	466	7,754.24	0.01
597	601919	中远海控	500	7,750.00	0.01
598	601579	会稽山	700	7,742.00	0.01

599	002284	亚太股份	1,000	7,740.00	0.01
599	600390	五矿资本	1,200	7,740.00	0.01
600	301397	溯联股份	300	7,725.00	0.01
601	300628	亿联网络	200	7,720.00	0.01
602	002810	山东赫达	600	7,710.00	0.01
602	300759	康龙化成	300	7,710.00	0.01
603	301011	华立科技	300	7,707.00	0.01
604	000612	焦作万方	1,200	7,704.00	0.01
605	300408	三环集团	200	7,702.00	0.01
606	301520	万邦医药	200	7,700.00	0.01
607	002876	三利谱	300	7,698.00	0.01
608	300397	天和防务	700	7,693.00	0.01
609	002714	牧原股份	200	7,688.00	0.01
610	002853	皮阿诺	700	7,679.00	0.01
611	601998	中信银行	1,100	7,678.00	0.01
612	002695	煌上煌	900	7,677.00	0.01
613	002915	中欣氟材	600	7,668.00	0.01
614	300299	富春股份	1,400	7,658.00	0.01
615	600567	山鹰国际	3,900	7,644.00	0.01
616	603170	宝立食品	500	7,610.00	0.01
617	600025	华能水电	800	7,608.00	0.01
618	000513	丽珠集团	200	7,600.00	0.01
619	300677	英科医疗	300	7,584.00	0.01
620	002372	伟星新材	600	7,578.00	0.01
621	603587	地素时尚	600	7,560.00	0.01
622	001368	通达创智	400	7,544.00	0.01
623	300571	平治信息	300	7,524.00	0.01
623	605088	冠盛股份	300	7,524.00	0.01
624	300382	斯莱克	700	7,518.00	0.01
625	688656	浩欧博	78	7,449.00	0.01
626	600105	永鼎股份	1,500	7,440.00	0.01
627	601226	华电科工	1,100	7,436.00	0.01
628	002414	高德红外	1,000	7,430.00	0.01
629	301391	卡莱特	200	7,402.00	0.01
630	002353	杰瑞股份	200	7,398.00	0.01
631	300065	海兰信	900	7,380.00	0.01
632	002606	大连电瓷	800	7,376.00	0.01
633	605180	华生科技	600	7,362.00	0.01
634	300041	回天新材	800	7,360.00	0.01
634	603237	五芳斋	400	7,360.00	0.01
635	300645	正元智慧	500	7,345.00	0.01
636	603867	新化股份	300	7,314.00	0.01
637	603282	亚光股份	500	7,310.00	0.01

638	600703	三安光电	600	7,302.00	0.01
639	002223	鱼跃医疗	200	7,298.00	0.01
640	300063	天龙集团	800	7,296.00	0.01
641	300986	志特新材	600	7,284.00	0.01
642	688716	中研股份	200	7,270.00	0.01
643	300121	阳谷华泰	600	7,254.00	0.01
644	603939	益丰药房	300	7,239.00	0.01
645	603051	鹿山新材	300	7,233.00	0.01
646	300572	安车检测	400	7,228.00	0.01
646	601212	白银有色	2,600	7,228.00	0.01
647	000519	中兵红箭	500	7,225.00	0.01
648	003020	立方制药	400	7,216.00	0.01
649	600298	安琪酵母	200	7,210.00	0.01
650	300118	东方日升	600	7,188.00	0.01
651	600756	浪潮软件	500	7,165.00	0.01
652	300719	安达维尔	400	7,164.00	0.01
653	300287	飞利信	1,700	7,140.00	0.01
654	002749	国光股份	500	7,110.00	0.01
655	002368	太极股份	300	7,104.00	0.01
656	600168	武汉控股	1,600	7,088.00	0.01
657	300654	世纪天鸿	700	7,063.00	0.01
658	601965	中国汽研	400	7,048.00	0.01
659	600741	华域汽车	400	7,044.00	0.01
660	688021	奥福环保	674	7,036.56	0.01
661	600686	金龙汽车	500	7,030.00	0.01
662	601877	正泰电器	300	7,023.00	0.01
663	600433	冠豪高新	2,200	6,974.00	0.01
664	000825	太钢不锈	2,000	6,960.00	0.01
665	001387	雪祺电气	500	6,935.00	0.01
666	603788	宁波高发	500	6,915.00	0.01
667	301272	英华特	200	6,902.00	0.01
668	603040	新坐标	300	6,876.00	0.01
669	300601	康泰生物	400	6,860.00	0.01
670	605337	李子园	600	6,774.00	0.01
671	002937	兴瑞科技	400	6,760.00	0.01
671	605016	百龙创园	400	6,760.00	0.01
672	000738	航发控制	300	6,672.00	0.01
672	301109	军信股份	400	6,672.00	0.01
673	603127	昭衍新药	400	6,652.00	0.01
674	603289	泰瑞机器	800	6,600.00	0.01
675	002469	三维化学	900	6,570.00	0.01
676	301003	江苏博云	300	6,549.00	0.01
677	300468	四方精创	400	6,520.00	0.01

678	600419	天润乳业	700	6,517.00	0.01
679	600141	兴发集团	300	6,510.00	0.01
680	605555	德昌股份	300	6,492.00	0.01
681	000560	我爱我家	2,100	6,405.00	0.01
682	300653	正海生物	300	6,390.00	0.01
683	688330	宏力达	242	6,350.08	0.01
684	688529	豪森智能	402	6,307.38	0.01
685	600132	重庆啤酒	100	6,302.00	0.01
686	600731	湖南海利	1,100	6,270.00	0.01
687	600660	福耀玻璃	100	6,240.00	0.01
688	688277	天智航	624	6,233.76	0.01
689	603786	科博达	100	6,180.00	0.01
690	002864	盘龙药业	200	6,082.00	0.01
691	301332	德尔玛	600	6,012.00	0.01
692	300652	雷迪克	200	5,944.00	0.01
693	600661	昂立教育	500	5,860.00	0.01
694	300893	松原股份	200	5,836.00	0.01
695	601003	柳钢股份	2,100	5,796.00	0.01
696	600486	扬农化工	100	5,787.00	0.01
697	601021	春秋航空	100	5,767.00	0.01
698	688314	康拓医疗	200	5,760.00	0.01
699	000301	东方盛虹	700	5,747.00	0.01
700	603688	石英股份	200	5,746.00	0.01
701	688699	明微电子	158	5,678.52	0.01
702	600131	国网信通	300	5,673.00	0.01
703	000877	天山股份	1,000	5,660.00	0.01
704	002180	纳思达	200	5,634.00	0.01
705	603260	合盛硅业	100	5,556.00	0.01
706	000789	万年青	1,100	5,511.00	0.01
707	603882	金域医学	200	5,506.00	0.01
708	688180	君实生物	200	5,466.00	0.01
709	300347	泰格医药	100	5,462.00	0.01
710	600118	中国卫星	200	5,460.00	0.01
711	301257	普蕊斯	200	5,392.00	0.01
712	688519	南亚新材	253	5,378.78	0.01
713	301360	荣旗科技	100	5,366.00	0.01
713	688561	奇安信	200	5,366.00	0.01
714	688339	亿华通	219	5,277.90	0.01
715	688085	三友医疗	249	5,276.31	0.01
716	688345	博力威	286	5,196.62	0.01
717	688499	利元亨	224	5,010.88	0.01
718	688269	凯立新材	200	4,996.00	0.01
719	603341	龙旗科技	100	4,675.00	0.01

720	301398	星源卓镁	100	4,640.00	0.01
721	603288	海天味业	100	4,590.00	0.01
722	600708	光明地产	1,200	4,464.00	0.01
723	301080	百普赛斯	100	4,414.00	0.01
724	603658	安图生物	100	4,364.00	0.01
725	300476	胜宏科技	100	4,209.00	0.01
726	300709	精研科技	100	4,017.00	0.00
727	600126	杭钢股份	800	3,824.00	0.00
728	601229	上海银行	400	3,660.00	0.00
729	688178	万德斯	285	3,559.65	0.00
730	002448	中原内配	500	3,130.00	0.00
731	002885	京泉华	200	2,850.00	0.00
732	688299	长阳科技	186	2,734.20	0.00
733	002234	民和股份	300	2,667.00	0.00
734	603380	易德龙	100	2,499.00	0.00
735	688203	海正生材	245	2,386.30	0.00
736	300230	永利股份	500	2,225.00	0.00
737	000882	华联股份	200	416.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002145	中核钛白	3,693,770.55	2.68
2	000426	兴业银锡	3,565,359.00	2.58
3	002807	江阴银行	3,450,807.00	2.50
4	000690	宝新能源	3,412,768.00	2.47
5	601918	新集能源	3,196,661.00	2.32
6	603323	苏农银行	3,149,870.00	2.28
7	002948	青岛银行	3,124,080.00	2.26
8	688322	奥比中光	2,997,707.89	2.17
9	000848	承德露露	2,912,699.48	2.11
10	600151	航天机电	2,903,163.99	2.10
11	002585	双星新材	2,900,019.00	2.10
12	688707	振华新材	2,851,753.76	2.07
13	002233	塔牌集团	2,785,349.00	2.02
14	002489	浙江永强	2,776,164.00	2.01
15	688372	伟测科技	2,763,816.33	2.00
16	300188	国投智能	2,758,019.00	2.00
17	301239	普瑞眼科	2,750,416.00	1.99
18	600496	精工钢构	2,742,170.98	1.99
19	601011	宝泰隆	2,730,151.00	1.98
20	688315	诺禾致源	2,728,591.12	1.98

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601918	新集能源	4,391,071.00	3.18
2	300079	数码视讯	3,698,293.57	2.68
3	000426	兴业银锡	3,602,481.00	2.61
4	600780	通宝能源	3,504,083.97	2.54
5	600266	城建发展	3,503,283.00	2.54
6	002145	中核钛白	3,466,425.20	2.51
7	600225	*ST 卓朗	3,397,607.00	2.46
8	000761	本钢板材	3,326,083.00	2.41
9	600662	外服控股	3,270,215.00	2.37
10	000528	柳工	3,227,094.80	2.34
11	000690	宝新能源	3,212,171.00	2.33
12	002807	江阴银行	3,183,439.00	2.31
13	688322	奥比中光	3,028,638.14	2.19
14	688031	星环科技	2,993,567.15	2.17
15	000813	德展健康	2,968,952.00	2.15
16	002948	青岛银行	2,895,269.00	2.10
17	000600	建投能源	2,892,079.00	2.09
18	603323	苏农银行	2,855,213.00	2.07
19	000791	甘肃能源	2,848,953.00	2.06
20	688711	宏微科技	2,843,019.16	2.06
21	300188	国投智能	2,838,388.00	2.06
22	002585	双星新材	2,830,803.00	2.05
23	603113	金能科技	2,824,827.00	2.05
24	000543	皖能电力	2,810,551.00	2.04
25	688066	航天宏图	2,796,364.83	2.03
26	603098	森特股份	2,791,853.00	2.02
27	000848	承德露露	2,782,271.00	2.02
28	002250	联化科技	2,772,442.00	2.01
29	002003	伟星股份	2,767,507.00	2.00
30	688707	振华新材	2,766,707.66	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,451,621,474.29
卖出股票收入（成交）总额	1,499,274,169.07

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	48,737.49	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,737.49	0.06

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	118049	汇成转债	260	33,109.55	0.04
2	118051	皓元转债	130	15,627.94	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟

投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例;其次,本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择,以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	138,153.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,030.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,184.05

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
华安中证 1000 指数 增强 A	1,504	47,796.82	413,102.38	0.57	71,473,317.18	99.43
华安中证 1000 指数 增强 C	768	32,829.39	4,353,072.27	17.27	20,859,897.42	82.73
合计	2,272	42,737.41	4,766,174.65	4.91	92,333,214.60	95.09

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华安中证 1000 指数增强 A	7,081.58	0.01
	华安中证 1000 指数增强 C	-	-
	合计	7,081.58	0.01

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安中证 1000 指数增强 A	华安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 7 月 12 日) 基金份额总额	174,819,963.48	61,538,729.33
本报告期期初基金份额总额	92,028,836.99	64,731,386.21
本报告期基金总申购份额	8,270,796.64	22,081,209.58
减：本报告期基金总赎回份额	28,413,214.07	61,599,626.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	71,886,419.56	25,212,969.69

## § 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：

2024 年 3 月 12 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任职的公告》，范伊然女士新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：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 11 月 9 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。此次变更已经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 27,000.00 元。

目前该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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	2,950,708,631.86	100.00	1,025,596.70	100.00	-

注：本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

#### 1、选择证券公司参与证券交易的标准：

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

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

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

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

(1) 候选证券公司的尽职调查

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

(2) 候选证券公司的准入评估

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

(3) 候选证券公司的审批程序

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：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	
	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 (%)
兴业证券	383,455.01	100.00	-	-	-	-

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基金投资关联方承销证券的公告（永兴股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 12 日
2	华安中证 1000 指数增强型证券投资	中国证监会基金电子披	2024 年 1 月 19 日

	基金 2023 年第 4 季度报告	露网站及基金管理人网站	
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（北自科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 1 月 24 日
4	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 12 日
5	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
6	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
8	华安中证 1000 指数增强 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
9	华安中证 1000 指数增强更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
10	华安中证 1000 指数增强 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
11	华安中证 1000 指数增强 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
13	华安中证 1000 指数增强 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
14	关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 24 日
15	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
16	华安中证 1000 指数增强 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日

17	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
18	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 9 日
20	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日
21	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安中证 1000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日