

华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	54
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	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	73
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	73
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	73
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	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 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	60,357,026.55 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	30,399,871.34 份	29,957,155.21 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		徐勇	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	2025 年		2024 年		2023 年	
	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	9,227,693.36	2,956,515.84	-558,162.3	-2,397,745	-5,276,125	-6,189,770

			4	.62	.76	.15
本期利润	13,693,655.36	5,146,670.18	3,826,517.02	2,454,686.37	705,064.81	3,139,396.39
加权平均基金份额本期利润	0.2491	0.2338	-0.0458	-0.0685	0.0062	-0.0326
本期加权平均净值利润率	26.17%	24.46%	-5.87%	-8.82%	0.66%	-3.48%
本期基金份额净值增长率	28.77%	28.26%	-2.76%	-3.16%	-3.52%	-3.89%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	1,738,742.50	1,279,420.90	10,171,369.24	3,780,309.04	11,716,094.85	8,564,622.26
期末可供分配基金份额利润	0.0572	0.0427	-0.1415	-0.1499	-0.1273	-0.1323
期末基金资产净值	33,608,485.62	32,662,465.03	61,715,050.32	21,432,660.65	81,254,939.65	56,818,664.53
期末基金份额净值	1.1055	1.0903	0.8585	0.8501	0.8829	0.8778
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	10.55%	9.03%	-14.15%	-14.99%	-11.71%	-12.22%

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

第 7 页 共 82 页

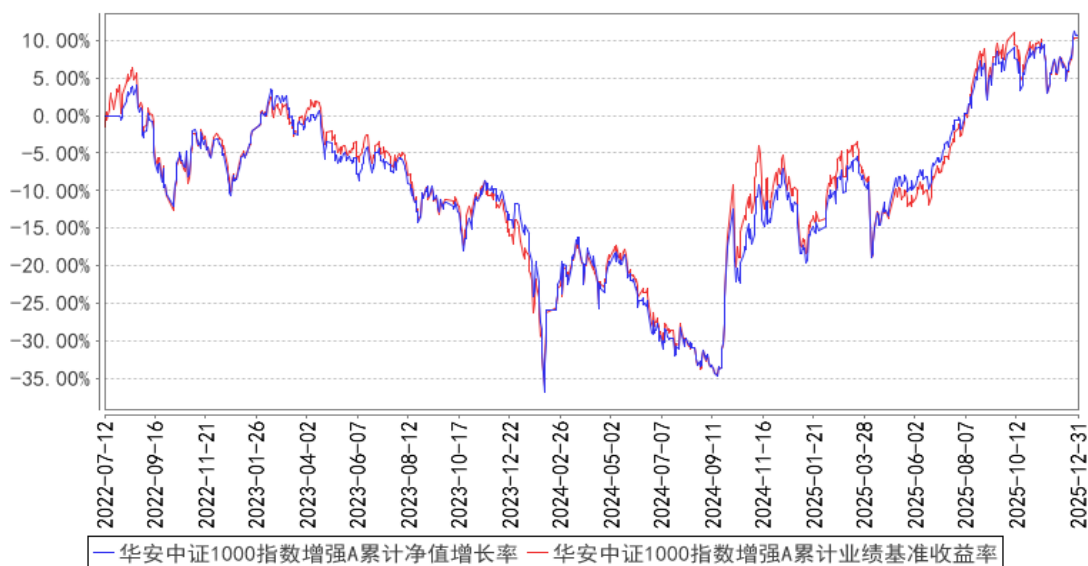
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.25%	1.02%	0.28%	1.07%	1.97%	-0.05%
过去六个月	17.29%	0.97%	18.49%	1.06%	-1.20%	-0.09%
过去一年	28.77%	1.25%	26.12%	1.32%	2.65%	-0.07%
过去三年	20.81%	1.45%	20.34%	1.48%	0.47%	-0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	10.55%	1.41%	10.23%	1.45%	0.32%	-0.04%

华安中证 1000 指数增强 C

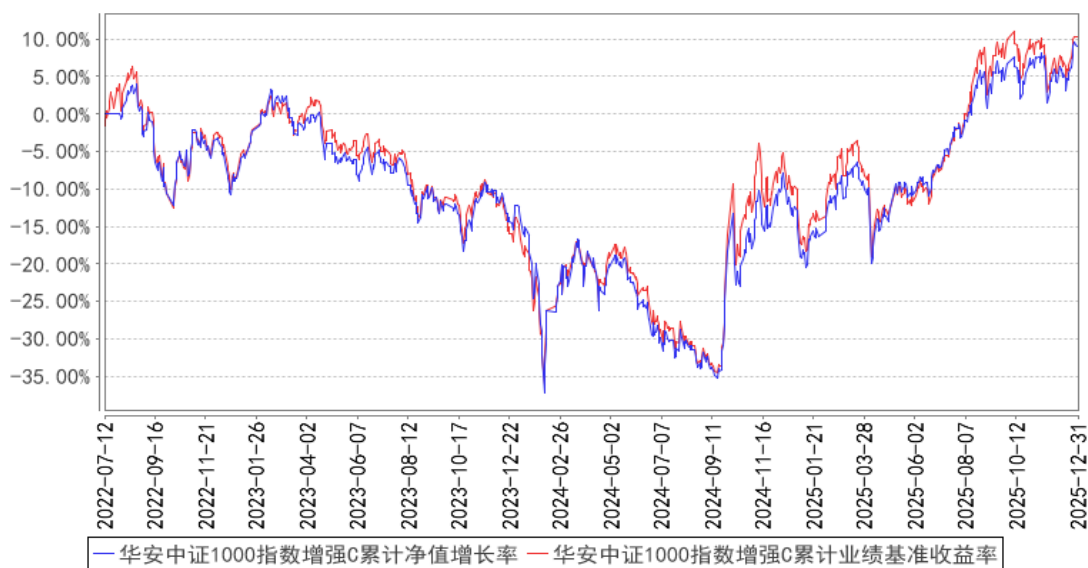
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	2.15%	1.02%	0.28%	1.07%	1.87%	-0.05%
过去六个月	17.06%	0.97%	18.49%	1.06%	-1.43%	-0.09%
过去一年	28.26%	1.25%	26.12%	1.32%	2.14%	-0.07%
过去三年	19.38%	1.45%	20.34%	1.48%	-0.96%	-0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	9.03%	1.41%	10.23%	1.45%	-1.20%	-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

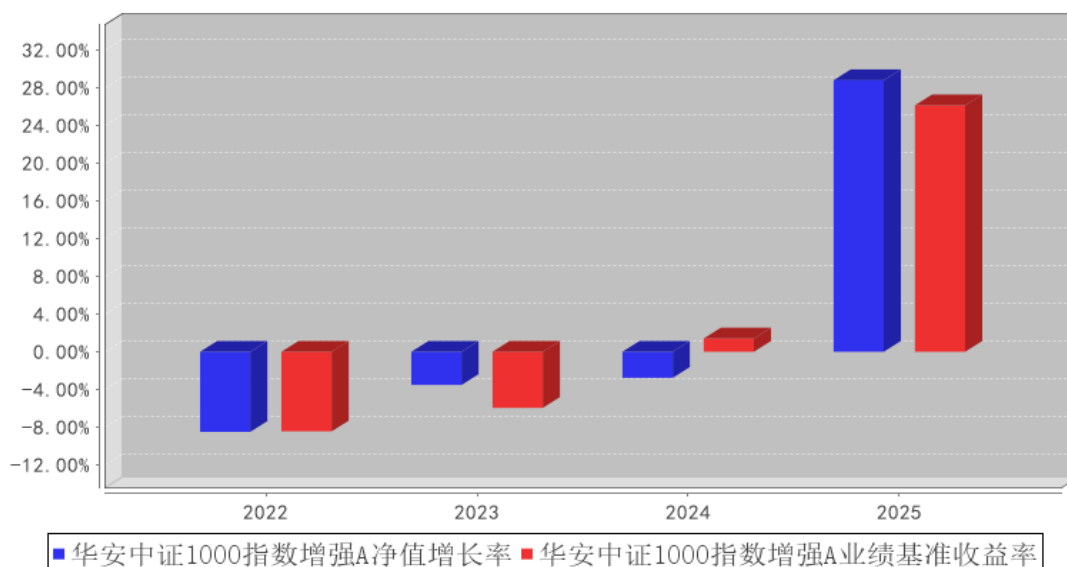


华安中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

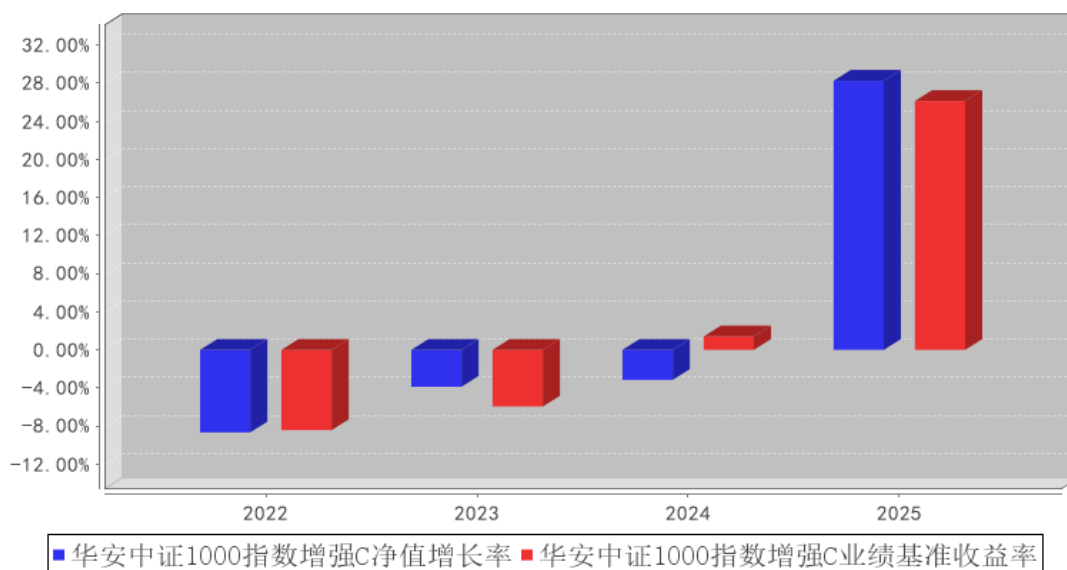


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2025 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金 ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等 293 只证券投资基金，管理资产规模达到 8,141.24 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张序	量化投资部助理总监、本基金的基金经理	2025 年 10 月 13 日	-	9 年	硕士研究生，9 年金融、基金行业从业经验。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司量化分析师。2017 年 2 月加入华安基金，历任指数与量化投资部量化分析师、基金经理助理。2020 年 5 月起，担任华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月至 2025 年 3 月，同时担任华安创新医药锐选量化股票型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月至 2025 年 8 月，同时担任华安中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月起，同时担任华安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理（由华安中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金转型而来）。2025 年 6 月起，同时担任华安沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起，同时担任华安中证 500 指数增强型证券投资基金、华安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

马韬	本基金的基金经理	2022 年 7 月 12 日	2025 年 10 月 13 日	11 年	硕士研究生，11 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 月至 2025 年 7 月，担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。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 月至 2025 年 10 月，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 月至 2025 年 10 月，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交易的品种、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 2 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

2025 年 A 股市场整体呈现先抑后扬、震荡上行的运行格局，全年行情在波动中逐步修复、重心稳步上移，既是国内经济企稳回升的重要体现，也恰逢经济结构新旧动能转换的关键窗口期。市场资金与投资者共识高度聚焦于高景气新兴成长领域，新消费、创新药、AI 算力、军工、机器人等板块表现活跃，成为 A 股与港股市场交易热度与结构性机会的核心来源，有效带动市场情绪与活跃度持续提升。

从宏观经济层面看，2025 年全球贸易格局扰动加剧，外部环境复杂多变，对传统出口导向型产业形成阶段性压力。但我国外贸结构持续优化，对“一带一路”沿线国家及新兴市场贸易实现逆势稳健增长，有效对冲了外部波动。在内需与产业政策协同发力下，制造业投资保持韧性，

尤其是高技术制造业投资增速领跑，成为拉动经济增长、推动产业升级的核心动力，为经济高质量发展筑牢坚实支撑。

从市场环境及资金格局来看，2025 年长线资金对市场的稳定托底作用进一步凸显，以长期配置为目标的“耐心资本”持续入场，显著提升市场韧性、支撑整体风险偏好。与此同时，人民币汇率保持平稳运行，汇率预期稳定强化了全球资本对人民币资产的信心，推动外资持续增配 A 股高确定性核心资产，内外资形成良性共振，共同助力市场在震荡中走出修复上行行情。

在投资上，我们以多因子投资框架为投资载体，结合机器学习模型等方法，优化选股策略，并通过风险控制模型，跟踪组合与基准指数的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.1055 元，C 类份额净值为 1.0903 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 28.77%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%，C 类份额净值增长率为 28.26%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，宏观环境迎来积极转折：国内经济企稳回升、增长动能持续优化，全球地缘与政策不确定性逐步落地，市场风险偏好稳步修复。在此背景下，A 股市场盈利修复与估值重构同步推进，整体投资价值愈发突出。

从投资主线来看，高景气赛道投资将延续全年主导地位。一方面，经济复苏带动上游需求回暖，叠加全球供给格局偏紧，大宗商品及资源类行业迎来量价齐升窗口，具备稳健的配置价值；另一方面，人工智能产业进入商业化落地关键期，算力基础设施、行业应用、核心零部件等供需错配的细分环节，有望持续释放高增长弹性。

与此同时，以商业航天、智能机器人为代表的前沿科技赛道，正处于技术突破与产业化加速的双重拐点，在国家战略支持与产业资本加持下，成长空间广阔，是全年不容忽视的战略性配置方向。

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、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 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

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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的真实、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 2603992 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	<p>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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报

	<p>表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>—</p>
<p>其他事项</p>	<p>—</p>
<p>其他信息</p>	<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 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(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</p>

	<p>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	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	8,299,718.32	6,669,310.20
结算备付金		2,224,433.85	163,001.41
存出保证金		715,747.20	138,153.60
交易性金融资产	7.4.7.2	55,390,448.51	76,467,066.12
其中：股票投资		55,384,725.63	76,418,328.63
基金投资		-	-
债券投资		5,722.88	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		5,636.06	11,030.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		66,635,983.94	83,448,561.78
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		205,308.34	210,533.00
应付管理人报酬		33,488.02	44,564.90
应付托管费		8,372.00	11,141.24
应付销售服务费		10,864.92	7,611.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	0.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	107,000.00	27,000.00
负债合计		365,033.29	300,850.81
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	60,357,026.55	97,099,389.25
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	5,913,924.10	-13,951,678.28
净资产合计		66,270,950.65	83,147,710.97
负债和净资产总计		66,635,983.94	83,448,561.78

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 60,357,026.55 份，其中 A 类基金份额净值 1.1055 元，基金份额总额 30,399,871.34 份；C 类基金份额净值 1.0903 元，基金份额总额 29,957,155.21 份。

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		19,587,000.58	-5,316,456.49
1. 利息收入		34,423.16	53,725.89
其中：存款利息收入	7.4.7.9	34,423.16	53,725.89
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）		12,879,824.28	-2,110,517.41
其中：股票投资收益	7.4.7.10	11,041,418.45	-4,090,265.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	32,006.08	15,865.08
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	1,006,079.73	775,763.09
股利收益	7.4.7.13	800,320.02	1,188,120.00
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	6,656,116.34	-3,325,295.43
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	16,636.80	65,630.46
减：二、营业总支出		746,675.04	964,746.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	439,492.97	560,027.71
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	109,873.23	140,006.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	83,187.48	112,355.76
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		4,073.93	2,798.91
8. 其他费用	7.4.7.17	110,047.43	149,557.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,840,325.54	-6,281,203.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,840,325.54	-6,281,203.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,840,325.54	-6,281,203.39

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	97,099,389.25	-	-13,951,678.28	83,147,710.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	97,099,389.25	-	-13,951,678.28	83,147,710.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,742,362.70	-	19,865,602.38	-16,876,760.32
（一）、综合收益总额	-	-	18,840,325.54	18,840,325.54
（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）	-36,742,362.70	-	1,025,276.84	-35,717,085.86
其中：1. 基金申购款	35,087,584.89	-	980,966.41	36,068,551.30
2. 基金赎回	-71,829,947.59	-	44,310.43	-71,785,637.16

回款				
(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	60,357,026.55	-	5,913,924.10	66,270,950.65
项目	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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“-”号填列)	-59,660,833.95	-	4,734,940.74	-54,925,893.21
(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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

徐勇

任志浩

童欣

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安中证 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、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[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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如

下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	32,704.18	2,695,775.26
等于：本金	32,685.89	2,695,518.36
加：应计利息	18.29	256.90
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	8,267,014.14	3,973,534.94
等于：本金	8,266,889.56	3,973,088.68
加：应计利息	124.58	446.26
合计	8,299,718.32	6,669,310.20

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 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		51,929,185.66	-	55,384,725.63	3,455,539.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,000.00	0.68	5,722.88	2,722.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,000.00	0.68	5,722.88	2,722.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,932,185.66	0.68	55,390,448.51	3,458,262.17
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍	-	-	-	-

生工具				
权益衍生工具	5,583,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,583,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,583,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	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	-	-	-

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股指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/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2602	IM2602	1.00	1,501,160.00	42,560.00
IM2603	IM2603	3.00	4,463,400.00	339,000.00
合计				381,560.00
减：可抵销期货暂收款				381,560.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	27,000.00	27,000.00
预提信息披露费	80,000.00	-
合计	107,000.00	27,000.00

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,886,419.56	71,886,419.56
本期申购	7,309,763.30	7,309,763.30
本期赎回（以“-”号填列）	-48,796,311.52	-48,796,311.52
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	30,399,871.34	30,399,871.34

华安中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,212,969.69	25,212,969.69

本期申购	27,777,821.59	27,777,821.59
本期赎回(以“-”号填列)	-23,033,636.07	-23,033,636.07
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	29,957,155.21	29,957,155.21

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	-7,990,956.51	-2,180,412.73	-10,171,369.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-7,990,956.51	-2,180,412.73	-10,171,369.24
本期利润	9,227,693.36	4,465,962.00	13,693,655.36
本期基金份额交易产生的变动数	502,005.65	-815,677.49	-313,671.84
其中：基金申购款	-221,048.05	198,888.01	-22,160.04
基金赎回款	723,053.70	-1,014,565.50	-291,511.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,738,742.50	1,469,871.78	3,208,614.28

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	-3,019,868.45	-760,440.59	-3,780,309.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,019,868.45	-760,440.59	-3,780,309.04
本期利润	2,956,515.84	2,190,154.34	5,146,670.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,342,773.51	-3,824.83	1,338,948.68
其中：基金申购款	393,920.92	609,205.53	1,003,126.45
基金赎回款	948,852.59	-613,030.36	335,822.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,279,420.90	1,425,888.92	2,705,309.82

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

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

	日	年 12 月 31 日
活期存款利息收入	8,425.64	12,941.11
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	11,600.43	23,146.75
结算备付金利息收入	14,397.09	17,638.03
其他	-	-
合计	34,423.16	53,725.89

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	11,041,418.45	-4,090,265.58
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	11,041,418.45	-4,090,265.58

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	1,092,204,282.38	1,499,274,169.07
减：卖出股票成本 总额	1,080,058,948.30	1,501,399,901.44
减：交易费用	1,103,915.63	1,964,533.21
买卖股票差价收 入	11,041,418.45	-4,090,265.58

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
债券投资收益——利息收入	16.27	46.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	31,989.81	15,818.44
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	32,006.08	15,865.08

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,028.62	180,155.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,000.00	164,300.00
减：应计利息总额	34.77	29.32
减：交易费用	4.04	7.25
买卖债券差价收入	31,989.81	15,818.44

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
股指期货投资收益	1,006,079.73	775,763.09

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	800,320.02	1,188,120.00
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	800,320.02	1,188,120.00

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	6,171,516.34	-3,222,255.43
股票投资	6,178,512.94	-3,231,974.23
债券投资	-6,996.60	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	484,600.00	-103,040.00
权证投资	-	-
期货投资	484,600.00	-103,040.00
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	6,656,116.34	-3,325,295.43

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,884.79	51,567.74
基金转换费收入	5,752.01	14,062.72
合计	16,636.80	65,630.46

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	27,000.00	27,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,047.21	2,557.53
其他	0.22	-
合计	110,047.43	149,557.53

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

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

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

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	439,492.97	560,027.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	190,495.06	261,282.62
应支付基金管理人的净管理费	248,997.91	298,745.09

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	109,873.23	140,006.99

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：

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
国泰海通证券股份有限公司	-	113.94	113.94
国泰君安证券股份有限公司	-	26.65	26.65
华安基金管理有限公司	-	26,878.47	26,878.47
招商银行股份有限公司	-	2,524.98	2,524.98
合计	-	29,544.04	29,544.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期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

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	32,704.18	8,425.64	2,695,775.26	12,941.11

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 2025年1月1日至2025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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
603508	思维列控	2025 年 12 月 29 日	重大事项停牌	27.82	2026 年 1 月 7 日	27.83	1,800	58,223.58	50,076.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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、审计委员会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,299,718.32	-	-	-	8,299,718.32
结算备付金	2,224,433.85	-	-	-	2,224,433.85
存出保证金	-	-	-	715,747.20	715,747.20
交易性金融资产	5,722.88	-	-	55,384,725.63	55,390,448.51
应收申购款	-	-	-	5,636.06	5,636.06
资产总计	10,529,875.05	-	-	56,106,108.89	66,635,983.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	205,308.34	205,308.34
应付管理人报酬	-	-	-	33,488.02	33,488.02
应付托管费	-	-	-	8,372.00	8,372.00
应付销售服务费	-	-	-	10,864.92	10,864.92
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	107,000.00	107,000.00
负债总计	-	-	-	365,033.29	365,033.29
利率敏感度缺口	10,529,875.05	-	-	55,741,075.60	66,270,950.65
上年度末 2024 年 12 月 31 日					
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

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金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 0.01%(2024 年 12 月 31 日：0.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	55,384,725.63	83.57	76,418,328.63	91.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,722.88	0.01	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	55,390,448.51	83.58	76,467,066.12	91.97

注：（1）本表中交易性金融资产—债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		3,087,074.24
业绩比较基准下降		-3,087,074.24	-4,046,084.93

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	55,340,372.51	76,380,177.32
第二层次	50,076.00	86,888.80
第三层次	-	-
合计	55,390,448.51	76,467,066.12

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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 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	-	-	-

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 03 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,384,725.63	83.12
	其中：股票	55,384,725.63	83.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,722.88	0.01
	其中：债券	5,722.88	0.01
	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	10,524,152.17	15.79
8	其他各项资产	721,383.26	1.08
9	合计	66,635,983.94	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	141,894.00	0.21

B	采矿业	1,270,473.00	1.92
C	制造业	32,257,892.94	48.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	399,455.00	0.60
E	建筑业	719,753.00	1.09
F	批发和零售业	979,601.00	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	1,620,165.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,897,496.60	8.90
J	金融业	1,040,527.50	1.57
K	房地产业	915,073.12	1.38
L	租赁和商务服务业	1,106,607.00	1.67
M	科学研究和技术服务业	371,073.64	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	664,660.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,870.00	0.10
Q	卫生和社会工作	94,968.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	557,323.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	48,103,832.80	72.59

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	-	-
B	采矿业	76,219.00	0.12
C	制造业	6,368,304.21	9.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	71,484.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	421,600.62	0.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	142,352.00	0.21
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	133,173.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	67,760.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,280,892.83	10.99

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	688270	臻镭科技	6,874	839,109.18	1.27
2	002317	众生药业	27,800	527,644.00	0.80
3	600475	华光环能	28,500	517,845.00	0.78
4	002544	普天科技	14,000	482,860.00	0.73
5	300548	长芯博创	3,300	468,600.00	0.71
6	688658	悦康药业	20,344	459,977.84	0.69
7	300045	华力创通	15,600	450,996.00	0.68
8	002212	天融信	47,800	433,546.00	0.65
9	600850	电科数字	14,600	432,744.00	0.65
10	002456	欧菲光	38,900	413,118.00	0.62
11	688007	光峰科技	21,383	397,082.31	0.60
12	600094	大名城	94,900	394,784.00	0.60
13	600125	铁龙物流	60,200	387,688.00	0.59
14	001203	大中矿业	12,500	383,125.00	0.58
15	603516	淳中科技	1,700	379,950.00	0.57

16	688110	东芯股份	2,797	367,385.95	0.55
17	002174	游族网络	30,000	367,200.00	0.55
18	601606	长城军工	7,600	365,712.00	0.55
19	688091	上海谊众	7,562	355,414.00	0.54
20	300455	航天智装	11,700	351,468.00	0.53
21	603360	百傲化学	10,900	351,198.00	0.53
22	300475	香农芯创	2,400	346,416.00	0.52
23	300593	新雷能	11,400	339,264.00	0.51
24	601326	秦港股份	96,800	337,832.00	0.51
25	002043	兔宝宝	23,000	331,430.00	0.50
26	600100	同方股份	36,900	329,148.00	0.50
27	300415	伊之密	12,400	323,144.00	0.49
28	603083	剑桥科技	2,400	322,512.00	0.49
29	300049	福瑞医科	4,500	316,845.00	0.48
30	688326	经纬恒润	2,694	316,545.00	0.48
31	603730	岱美股份	36,100	316,236.00	0.48
32	002145	钛能化学	64,300	315,070.00	0.48
33	002036	联创电子	28,200	310,764.00	0.47
34	600929	雪天盐业	54,400	307,360.00	0.46
35	600388	龙净环保	18,800	306,628.00	0.46
36	600331	宏达股份	23,900	305,681.00	0.46
37	688321	微芯生物	10,438	304,998.36	0.46
38	002895	川恒股份	8,300	304,278.00	0.46
39	603456	九洲药业	16,700	298,930.00	0.45
40	000058	深赛格	31,700	297,980.00	0.45
41	301363	美好医疗	12,200	293,410.00	0.44
42	300027	华谊兄弟	128,800	279,496.00	0.42
43	688001	华兴源创	9,222	278,319.96	0.42
44	301377	鼎泰高科	2,000	278,200.00	0.42
45	600395	盘江股份	56,700	264,222.00	0.40
46	300820	英杰电气	5,500	263,725.00	0.40
47	002651	利君股份	22,100	258,349.00	0.39
48	603613	国联股份	9,000	252,000.00	0.38
49	688088	虹软科技	5,001	247,549.50	0.37
50	601089	福元医药	10,300	247,200.00	0.37
51	600064	南京高科	28,384	246,373.12	0.37
52	002097	山河智能	19,800	245,718.00	0.37
53	300682	朗新集团	16,100	244,881.00	0.37
54	600428	中远海特	34,400	244,240.00	0.37
55	688559	海目星	5,024	241,453.44	0.36
56	002506	协鑫集成	86,200	241,360.00	0.36
57	600595	中孚实业	30,600	240,210.00	0.36
58	002099	海翔药业	37,000	230,880.00	0.35

59	301078	孩子王	22,200	230,214.00	0.35
60	300232	洲明科技	32,200	228,298.00	0.34
61	300624	万兴科技	3,152	222,688.80	0.34
62	600057	厦门象屿	26,100	222,372.00	0.34
63	603358	华达科技	4,400	222,200.00	0.34
64	600662	外服控股	43,900	220,378.00	0.33
65	000766	通化金马	8,000	219,920.00	0.33
66	002061	浙江交科	53,400	212,532.00	0.32
67	600507	方大特钢	35,300	207,917.00	0.31
68	600908	无锡银行	34,900	206,957.00	0.31
69	002698	博实股份	12,200	205,082.00	0.31
70	002484	江海股份	6,900	204,930.00	0.31
71	688343	云天励飞	2,631	200,166.48	0.30
72	603197	保隆科技	5,400	199,746.00	0.30
73	601678	滨化股份	46,900	198,856.00	0.30
74	600151	航天机电	11,300	198,315.00	0.30
75	301268	铭利达	10,700	195,061.00	0.29
76	300459	汤姆猫	42,300	194,157.00	0.29
77	603227	雪峰科技	23,200	193,024.00	0.29
78	300182	捷成股份	31,700	174,984.00	0.26
79	688567	孚能科技	11,079	173,386.35	0.26
80	300085	银之杰	4,300	172,387.00	0.26
81	300779	惠城环保	1,300	169,143.00	0.26
82	002163	海南发展	7,000	166,880.00	0.25
83	000567	海德股份	25,800	165,636.00	0.25
84	000555	神州信息	9,100	150,605.00	0.23
85	300723	一品红	4,400	147,620.00	0.22
86	688123	聚辰股份	1,175	147,556.50	0.22
87	688523	航天环宇	2,408	134,751.68	0.20
88	002222	福晶科技	2,220	125,074.80	0.19
89	688037	芯源微	818	121,481.18	0.18
90	603355	莱克电气	3,800	120,574.00	0.18
91	300102	乾照光电	4,300	118,508.00	0.18
92	600338	西藏珠峰	7,500	112,800.00	0.17
93	002151	北斗星通	2,400	109,032.00	0.16
94	002539	云图控股	8,800	104,016.00	0.16
95	601677	明泰铝业	7,000	103,530.00	0.16
96	600446	金证股份	6,400	101,888.00	0.15
97	300083	创世纪	10,900	100,389.00	0.15
98	002497	雅化集团	4,000	99,000.00	0.15
99	601208	东材科技	3,600	97,524.00	0.15
100	688200	华峰测控	512	97,382.40	0.15
101	300352	北信源	15,800	96,854.00	0.15

102	600618	氯碱化工	8,100	96,228.00	0.15
103	000030	富奥股份	16,600	95,284.00	0.14
104	688498	源杰科技	148	95,014.52	0.14
105	002378	章源钨业	6,700	95,006.00	0.14
106	603219	富佳股份	5,600	94,304.00	0.14
107	002543	万和电气	9,200	93,932.00	0.14
108	301004	嘉益股份	1,800	93,690.00	0.14
109	603057	紫燕食品	4,600	93,564.00	0.14
110	000917	电广传媒	9,100	93,548.00	0.14
111	002125	湘潭电化	6,600	93,456.00	0.14
112	002405	四维图新	10,300	92,803.00	0.14
113	002245	蔚蓝锂芯	5,200	92,560.00	0.14
114	603119	浙江荣泰	800	92,536.00	0.14
115	600301	华锡有色	2,400	92,064.00	0.14
116	688409	富创精密	1,365	92,001.00	0.14
117	300666	江丰电子	1,000	92,000.00	0.14
118	688208	道通科技	2,482	91,337.60	0.14
119	002389	航天彩虹	3,800	91,124.00	0.14
120	300303	聚飞光电	13,300	90,972.00	0.14
121	300088	长信科技	15,000	90,900.00	0.14
122	300438	鹏辉能源	1,700	90,474.00	0.14
123	300296	利亚德	14,300	90,376.00	0.14
124	601126	四方股份	3,000	90,240.00	0.14
125	300568	星源材质	5,900	89,975.00	0.14
126	600211	西藏药业	2,100	89,355.00	0.13
127	600163	中闽能源	16,400	88,888.00	0.13
128	601718	际华集团	26,400	88,440.00	0.13
129	300870	欧陆通	400	88,400.00	0.13
130	001308	康冠科技	4,200	87,612.00	0.13
131	688206	概伦电子	2,493	86,831.19	0.13
132	300672	国科微	800	86,096.00	0.13
133	603236	移远通信	900	85,869.00	0.13
134	002807	江阴银行	18,600	85,002.00	0.13
135	600012	皖通高速	5,700	84,474.00	0.13
136	688789	宏华数科	1,032	84,180.24	0.13
137	002541	鸿路钢构	5,100	83,844.00	0.13
138	605009	豪悦护理	2,700	83,430.00	0.13
139	300768	迪普科技	4,500	83,385.00	0.13
140	600206	有研新材	4,100	83,353.00	0.13
141	688333	铂力特	747	83,297.97	0.13
142	002324	普利特	5,200	83,148.00	0.13
143	688209	英集芯	4,167	83,089.98	0.13
144	601777	千里科技	7,800	82,914.00	0.13

145	688380	中微半导	2,571	82,657.65	0.12
146	688006	杭可科技	2,814	82,422.06	0.12
147	000829	天音控股	7,500	81,825.00	0.12
148	300443	金雷股份	2,900	81,577.00	0.12
149	603698	航天工程	2,100	81,375.00	0.12
150	688400	凌云光	1,919	81,327.22	0.12
151	300725	药石科技	2,100	80,976.00	0.12
152	002421	达实智能	28,200	80,370.00	0.12
153	002946	新乳业	4,300	79,679.00	0.12
154	002258	利尔化学	6,100	79,605.00	0.12
155	002428	云南锗业	2,500	79,375.00	0.12
156	603043	广州酒家	4,500	79,335.00	0.12
157	300762	上海瀚讯	1,900	79,192.00	0.12
158	600315	上海家化	3,500	78,820.00	0.12
159	688005	容百科技	2,226	78,800.40	0.12
160	000761	本钢板材	23,500	78,725.00	0.12
161	002249	大洋电机	7,220	78,698.00	0.12
162	605376	博迁新材	1,200	78,480.00	0.12
163	600667	太极实业	9,800	78,106.00	0.12
164	000676	智度股份	9,000	77,670.00	0.12
165	002928	华夏航空	7,000	77,350.00	0.12
166	300579	数字认证	2,300	77,303.00	0.12
167	600323	瀚蓝环境	2,700	77,220.00	0.12
168	603127	昭衍新药	2,200	77,022.00	0.12
169	600017	日照港	25,500	76,500.00	0.12
170	600114	东睦股份	2,500	76,375.00	0.12
171	002139	拓邦股份	5,500	75,790.00	0.11
172	000758	中色股份	11,400	75,696.00	0.11
173	002048	宁波华翔	2,400	75,504.00	0.11
174	600997	开滦股份	13,100	75,325.00	0.11
175	301177	迪阿股份	2,600	75,062.00	0.11
176	301039	中集车辆	8,200	75,030.00	0.11
176	603128	华贸物流	12,300	75,030.00	0.11
177	002176	江特电机	7,700	74,998.00	0.11
178	603005	晶方科技	2,700	74,682.00	0.11
179	603033	三维股份	6,900	74,589.00	0.11
180	600577	精达股份	6,000	74,580.00	0.11
181	002498	汉缆股份	19,200	73,536.00	0.11
182	300620	光库科技	500	73,525.00	0.11
183	300080	易成新能	15,100	73,386.00	0.11
184	688063	派能科技	1,289	73,240.98	0.11
185	300348	长亮科技	4,700	72,756.00	0.11
186	300456	赛微电子	1,300	72,748.00	0.11

187	688690	纳微科技	2,809	72,500.29	0.11
188	600961	株冶集团	4,500	72,450.00	0.11
189	002815	崇达技术	5,300	72,398.00	0.11
190	603162	海通发展	6,000	72,240.00	0.11
191	300363	博腾股份	3,100	72,044.00	0.11
192	600552	凯盛科技	5,800	71,920.00	0.11
193	688348	昱能科技	1,425	71,805.75	0.11
194	300244	迪安诊断	4,500	71,325.00	0.11
195	688116	天奈科技	1,508	71,102.20	0.11
196	688484	南芯科技	1,739	70,707.74	0.11
197	300323	华灿光电	8,800	70,224.00	0.11
198	300087	荃银高科	6,000	70,080.00	0.11
199	300170	汉得信息	3,700	70,004.00	0.11
200	300409	道氏技术	3,100	69,719.00	0.11
201	001309	德明利	300	69,567.00	0.10
202	601375	中原证券	16,100	69,230.00	0.10
203	002171	楚江新材	5,200	68,952.00	0.10
204	603317	天味食品	5,500	68,860.00	0.10
205	601860	紫金银行	24,700	68,172.00	0.10
206	000603	盛达资源	2,200	68,112.00	0.10
207	300770	新媒股份	1,600	67,856.00	0.10
208	002487	大金重工	1,300	67,509.00	0.10
209	301205	联特科技	400	67,404.00	0.10
210	601020	华钰矿业	2,500	67,150.00	0.10
211	300755	华致酒行	3,800	66,956.00	0.10
212	300492	华图山鼎	900	66,870.00	0.10
213	002396	星网锐捷	2,200	66,660.00	0.10
214	688150	莱特光电	2,464	66,601.92	0.10
215	002531	天顺风能	9,700	66,542.00	0.10
216	600186	莲花控股	11,100	66,378.00	0.10
217	600888	新疆众和	8,100	66,339.00	0.10
218	300468	四方精创	1,700	66,011.00	0.10
219	300035	中科电气	3,100	65,999.00	0.10
220	688177	百奥泰	2,850	65,949.00	0.10
221	000923	河钢资源	3,100	65,627.00	0.10
222	300036	超图软件	3,600	65,376.00	0.10
223	002716	湖南白银	9,400	65,048.00	0.10
224	600556	天下秀	10,700	64,949.00	0.10
225	002079	苏州固锝	6,800	64,940.00	0.10
226	688516	奥特维	1,430	64,721.80	0.10
227	002906	华阳集团	2,100	64,218.00	0.10
228	002302	西部建设	10,400	63,648.00	0.10
229	603299	苏盐井神	6,100	63,562.00	0.10

230	600810	神马股份	7,000	62,930.00	0.09
231	002705	新宝股份	4,400	62,744.00	0.09
232	688700	东威科技	1,776	62,657.28	0.09
233	002276	万马股份	3,700	62,567.00	0.09
234	603888	新华网	3,200	62,176.00	0.09
235	600259	中稀有色	1,100	61,886.00	0.09
236	002839	张家港行	13,500	61,695.00	0.09
237	600740	山西焦化	16,400	61,664.00	0.09
238	600478	科力远	8,900	61,321.00	0.09
239	002588	史丹利	6,000	59,880.00	0.09
240	600490	鹏欣资源	7,700	59,521.00	0.09
241	600649	城投控股	13,300	59,185.00	0.09
242	600502	安徽建工	12,600	59,094.00	0.09
243	603308	应流股份	1,400	58,450.00	0.09
244	301087	可孚医疗	1,300	58,071.00	0.09
245	688586	江航装备	4,426	57,715.04	0.09
246	600248	陕建股份	16,200	57,186.00	0.09
247	000737	北方铜业	3,700	56,943.00	0.09
248	000901	航天科技	2,000	56,940.00	0.09
249	300910	瑞丰新材	1,000	56,550.00	0.09
250	603337	杰克科技	1,300	56,329.00	0.08
251	002489	浙江永强	14,700	56,301.00	0.08
252	001236	弘业期货	5,300	56,180.00	0.08
253	002617	露笑科技	6,900	55,890.00	0.08
254	301565	中仑新材	2,300	55,522.00	0.08
255	688433	华曙高科	839	55,516.63	0.08
256	002226	江南化工	9,500	55,195.00	0.08
257	002254	泰和新材	5,500	55,110.00	0.08
258	688083	中望软件	807	54,964.77	0.08
259	002747	埃斯顿	2,300	54,510.00	0.08
260	301035	润丰股份	800	54,408.00	0.08
261	300253	卫宁健康	6,100	53,802.00	0.08
262	000420	吉林化纤	11,800	53,454.00	0.08
263	603733	仙鹤股份	2,200	53,174.00	0.08
264	002791	坚朗五金	2,500	53,025.00	0.08
265	300068	南都电源	3,400	52,836.00	0.08
266	600882	妙可蓝多	2,100	52,794.00	0.08
267	300180	华峰超纤	7,600	52,668.00	0.08
268	000969	安泰科技	2,500	52,525.00	0.08
269	002611	东方精工	2,700	51,894.00	0.08
270	300738	奥飞数据	2,800	51,772.00	0.08
271	300229	拓尔思	2,600	51,740.00	0.08
272	688331	荣昌生物	663	51,574.77	0.08

273	600657	信达地产	14,800	51,060.00	0.08
274	601778	晶科科技	13,700	50,964.00	0.08
275	300674	宇信科技	2,100	50,946.00	0.08
276	688536	思瑞浦	318	50,841.84	0.08
277	603100	川仪股份	2,200	50,600.00	0.08
278	000061	农产品	4,900	50,421.00	0.08
279	603306	华懋科技	800	50,408.00	0.08
280	300953	震裕科技	300	50,406.00	0.08
281	002315	焦点科技	1,100	50,336.00	0.08
282	603508	思维列控	1,800	50,076.00	0.08
283	300811	铂科新材	700	49,917.00	0.08
284	002123	梦网科技	4,100	49,856.00	0.08
285	000099	中信海直	2,400	49,800.00	0.08
286	002400	省广集团	5,600	49,672.00	0.07
287	688779	五矿新能	6,629	49,651.21	0.07
288	300850	新强联	1,200	49,644.00	0.07
289	605555	德昌股份	2,700	49,410.00	0.07
290	688131	皓元医药	683	49,230.64	0.07
291	688252	天德钰	2,321	49,135.57	0.07
292	600416	湘电股份	3,100	48,918.00	0.07
293	301510	固高科技	1,300	48,685.00	0.07
294	688543	国科军工	774	48,042.18	0.07
295	601975	招商南油	15,900	48,018.00	0.07
296	000727	冠捷科技	18,800	47,752.00	0.07
297	301061	匠心家居	500	47,400.00	0.07
298	000762	西藏矿业	1,800	47,286.00	0.07
299	600330	天通股份	3,600	47,268.00	0.07
300	600596	新安股份	4,100	47,027.00	0.07
301	600903	贵州燃气	7,100	46,931.00	0.07
302	600366	宁波韵升	3,400	46,886.00	0.07
303	301071	力量钻石	1,300	46,592.00	0.07
304	300315	掌趣科技	9,400	46,436.00	0.07
305	600185	珠兔集团	6,800	46,308.00	0.07
306	603063	禾望电气	1,400	46,298.00	0.07
307	000970	中科三环	3,400	46,104.00	0.07
308	301215	中汽股份	6,700	45,895.00	0.07
309	002755	奥赛康	2,800	45,724.00	0.07
310	002779	中坚科技	400	45,424.00	0.07
311	688262	国芯科技	1,495	45,373.25	0.07
312	688190	云路股份	465	45,291.00	0.07
313	600201	生物股份	3,000	45,210.00	0.07
314	603026	石大胜华	600	44,886.00	0.07
315	603300	海南华铁	5,700	44,745.00	0.07

316	603871	嘉友国际	3,200	44,640.00	0.07
317	600252	中恒集团	16,200	44,388.00	0.07
318	300130	新国都	1,600	44,368.00	0.07
319	300079	数码视讯	8,200	44,198.00	0.07
320	600641	先导基电	2,500	44,100.00	0.07
321	600728	佳都科技	6,600	44,088.00	0.07
322	600761	安徽合力	2,100	43,869.00	0.07
323	601519	大智慧	3,400	43,758.00	0.07
324	688337	普源精电	1,168	43,087.52	0.07
325	001301	尚太科技	500	42,905.00	0.06
326	002127	南极电商	12,700	42,799.00	0.06
327	603881	数据港	1,400	42,602.00	0.06
328	002063	远光软件	7,000	42,490.00	0.06
329	301029	怡合达	1,600	42,432.00	0.06
330	000048	京基智农	2,400	42,240.00	0.06
331	300855	图南股份	1,300	41,990.00	0.06
332	605123	派克新材	400	41,560.00	0.06
333	301219	腾远钴业	600	40,968.00	0.06
334	000035	中国天楹	7,400	40,848.00	0.06
335	000059	华锦股份	7,600	40,660.00	0.06
336	301327	华宝新能	700	40,369.00	0.06
337	688127	蓝特光学	1,046	40,260.54	0.06
338	300226	上海钢联	1,600	40,192.00	0.06
339	300773	拉卡拉	1,400	39,872.00	0.06
340	600621	华鑫股份	2,600	39,624.00	0.06
341	600783	鲁信创投	1,600	39,568.00	0.06
342	605111	新洁能	1,100	39,303.00	0.06
343	301207	华兰疫苗	2,100	39,123.00	0.06
344	600459	贵研铂业	2,100	39,081.00	0.06
345	000902	新洋丰	2,500	39,050.00	0.06
346	300638	广和通	1,300	38,532.00	0.06
347	603220	中贝通信	1,800	38,340.00	0.06
348	600246	万通发展	3,100	38,130.00	0.06
349	600675	中华企业	13,900	37,669.00	0.06
350	000767	晋控电力	13,400	37,520.00	0.06
351	002326	永太科技	1,500	37,380.00	0.06
352	002488	金固股份	4,200	36,918.00	0.06
353	300077	国民技术	1,800	36,396.00	0.05
354	002511	中顺洁柔	4,200	35,952.00	0.05
355	601528	瑞丰银行	6,300	35,910.00	0.05
356	603567	珍宝岛	4,000	35,720.00	0.05
357	000681	视觉中国	1,500	35,715.00	0.05
358	000628	高新发展	800	35,672.00	0.05

359	601096	宏盛华源	8,500	35,275.00	0.05
360	300134	大富科技	2,800	35,000.00	0.05
361	603667	五洲新春	500	34,990.00	0.05
362	601869	长飞光纤	300	34,908.00	0.05
363	002237	恒邦股份	2,600	34,892.00	0.05
364	600409	三友化工	5,600	34,664.00	0.05
365	000612	焦作万方	3,100	34,162.00	0.05
366	688390	固德威	549	34,109.37	0.05
367	300031	宝通科技	1,500	34,095.00	0.05
368	301047	义翘神州	500	33,800.00	0.05
369	688630	芯碁微装	251	33,767.03	0.05
370	600682	南京新百	3,800	33,212.00	0.05
371	601949	中国出版	5,100	32,895.00	0.05
372	603530	神马电力	800	32,864.00	0.05
373	601702	华峰铝业	1,600	32,752.00	0.05
374	300777	中简科技	800	32,640.00	0.05
375	300337	银邦股份	2,100	32,571.00	0.05
376	688766	普冉股份	256	32,565.76	0.05
377	600123	兰花科创	5,500	32,505.00	0.05
378	300133	华策影视	3,900	32,448.00	0.05
379	688068	热景生物	200	32,400.00	0.05
380	600120	浙江东方	5,200	32,084.00	0.05
381	300236	上海新阳	500	31,880.00	0.05
382	002073	软控股份	3,900	31,785.00	0.05
383	603297	永新光学	300	31,590.00	0.05
384	300913	兆龙互连	600	31,578.00	0.05
385	002434	万里扬	3,300	31,449.00	0.05
386	003012	东鹏控股	4,800	31,440.00	0.05
387	688327	云从科技	2,182	31,355.34	0.05
388	688717	艾罗能源	507	31,231.20	0.05
389	002081	金螳螂	9,100	31,122.00	0.05
390	300451	创业慧康	6,400	30,976.00	0.05
391	300655	晶瑞电材	1,900	30,647.00	0.05
392	688686	奥普特	246	30,535.98	0.05
393	002233	塔牌集团	3,379	30,444.79	0.05
394	002020	京新药业	1,600	30,368.00	0.05
395	002110	三钢闽光	6,900	30,291.00	0.05
396	300401	花园生物	2,000	30,240.00	0.05
397	002534	西子洁能	1,800	30,186.00	0.05
398	000589	贵州轮胎	5,800	30,044.00	0.05
399	300184	力源信息	3,000	29,970.00	0.05
400	000680	山推股份	2,500	29,925.00	0.05
401	600575	淮河能源	8,800	29,920.00	0.05

402	000875	吉电股份	5,300	29,892.00	0.05
403	603169	兰石重装	2,800	29,848.00	0.05
403	603599	广信股份	2,600	29,848.00	0.05
404	688141	杰华特	684	29,706.12	0.04
405	002041	登海种业	3,100	29,574.00	0.04
406	000756	新华制药	1,900	29,279.00	0.04
407	002243	力合科创	2,900	28,855.00	0.04
408	603118	共进股份	2,500	28,750.00	0.04
409	601033	永兴股份	1,900	28,747.00	0.04
409	688439	振华风光	445	28,747.00	0.04
410	002100	天康生物	3,900	28,743.00	0.04
411	688128	中国电研	987	28,701.96	0.04
412	600550	保变电气	2,700	28,485.00	0.04
413	603638	艾迪精密	1,500	28,395.00	0.04
414	002221	东华能源	3,500	28,350.00	0.04
414	301171	易点天下	700	28,350.00	0.04
415	600986	浙文互联	3,600	28,152.00	0.04
416	600055	万东医疗	1,800	28,044.00	0.04
417	603713	密尔克卫	500	27,885.00	0.04
418	300457	赢合科技	1,000	27,850.00	0.04
419	300657	弘信电子	1,000	27,660.00	0.04
420	605116	奥锐特	1,100	27,555.00	0.04
421	002270	华明装备	1,100	27,544.00	0.04
422	300181	佐力药业	1,700	27,472.00	0.04
423	688432	有研硅	2,203	27,339.23	0.04
424	603093	南华期货	1,400	27,286.00	0.04
425	000686	东北证券	2,900	27,028.00	0.04
426	300856	科思股份	2,000	26,960.00	0.04
427	603323	苏农银行	5,310	26,815.50	0.04
428	301316	慧博云通	600	26,808.00	0.04
429	000581	威孚高科	1,300	26,806.00	0.04
430	603229	奥翔药业	2,700	26,784.00	0.04
431	301091	深城交	1,000	26,740.00	0.04
432	600075	新疆天业	5,400	26,730.00	0.04
433	603328	依顿电子	2,400	26,304.00	0.04
434	605090	九丰能源	600	25,860.00	0.04
435	000928	中钢国际	3,900	25,779.00	0.04
436	600559	老白干酒	1,600	25,664.00	0.04
437	000422	湖北宜化	1,800	25,578.00	0.04
438	601500	通用股份	5,300	25,546.00	0.04
439	002697	红旗连锁	4,300	25,542.00	0.04
440	003039	顺控发展	1,600	25,488.00	0.04
441	300783	三只松鼠	1,100	25,465.00	0.04

442	688596	正帆科技	805	25,462.15	0.04
443	002053	云南能投	2,200	25,344.00	0.04
444	688153	唯捷创芯	673	25,331.72	0.04
445	300634	彩讯股份	1,000	25,230.00	0.04
446	301526	国际复材	3,600	25,200.00	0.04
447	300171	东富龙	1,600	25,120.00	0.04
448	000813	德展健康	6,500	24,960.00	0.04
449	603678	火炬电子	700	24,724.00	0.04
450	600020	中原高速	5,800	24,708.00	0.04
451	600877	电科芯片	1,400	24,570.00	0.04
452	603919	金徽酒	1,200	24,504.00	0.04
453	300113	顺网科技	1,200	24,288.00	0.04
454	688776	国光电气	241	24,278.34	0.04
455	688062	迈威生物	630	24,236.10	0.04
456	000029	深深房 A	1,100	24,222.00	0.04
457	688016	心脉医疗	264	24,198.24	0.04
458	603009	北特科技	500	24,080.00	0.04
459	300009	安科生物	2,500	23,925.00	0.04
460	688029	南微医学	293	23,897.08	0.04
461	002292	奥飞娱乐	2,700	23,895.00	0.04
462	002948	青岛银行	5,300	23,744.00	0.04
463	600179	安通控股	4,300	23,736.00	0.04
464	002901	大博医疗	500	23,685.00	0.04
465	002626	金达威	1,200	23,652.00	0.04
466	002219	新里程	11,100	23,643.00	0.04
467	002006	精工科技	1,000	23,160.00	0.03
468	002745	木林森	2,400	22,968.00	0.03
469	688660	电气风电	1,345	22,878.45	0.03
470	300101	振芯科技	800	22,744.00	0.03
471	600273	嘉化能源	2,600	22,724.00	0.03
472	002690	美亚光电	1,100	22,627.00	0.03
473	002643	万润股份	1,500	22,485.00	0.03
474	301238	瑞泰新材	1,100	22,440.00	0.03
475	300398	飞凯材料	1,000	22,410.00	0.03
476	688639	华恒生物	684	22,284.72	0.03
477	002941	新疆交建	1,400	22,190.00	0.03
478	002368	太极股份	900	22,041.00	0.03
479	300660	江苏雷利	400	21,928.00	0.03
480	601952	苏垦农发	2,400	21,888.00	0.03
481	600597	光明乳业	2,700	21,843.00	0.03
482	688372	伟测科技	200	21,818.00	0.03
483	300841	康华生物	300	21,678.00	0.03
484	600623	华谊集团	2,800	21,588.00	0.03

485	601908	京运通	5,500	21,505.00	0.03
486	301511	德福科技	600	21,474.00	0.03
487	300416	苏试试验	1,200	21,408.00	0.03
488	601137	博威合金	1,000	21,370.00	0.03
489	300861	美畅股份	1,420	21,200.60	0.03
490	300151	昌红科技	1,400	21,112.00	0.03
491	002635	安洁科技	1,500	20,790.00	0.03
492	300183	东软载波	1,400	20,762.00	0.03
493	301631	壹连科技	200	20,710.00	0.03
494	002675	东诚药业	1,500	20,610.00	0.03
495	688698	伟创电气	208	20,567.04	0.03
496	688548	广钢气体	1,396	20,297.84	0.03
497	600635	大众公用	3,100	20,274.00	0.03
498	600933	爱柯迪	1,000	20,100.00	0.03
499	002158	汉钟精机	800	20,024.00	0.03
500	000935	四川双马	800	19,872.00	0.03
501	601187	厦门银行	2,700	19,818.00	0.03
502	603025	大豪科技	1,100	19,756.00	0.03
503	601801	皖新传媒	3,000	19,740.00	0.03
504	300917	特发服务	500	19,550.00	0.03
505	600586	金晶科技	3,400	19,142.00	0.03
506	002354	天娱数科	3,000	19,110.00	0.03
507	300772	运达股份	1,000	19,060.00	0.03
508	000049	德赛电池	700	18,816.00	0.03
509	300821	东岳硅材	1,600	18,656.00	0.03
510	600072	中船科技	1,600	18,592.00	0.03
511	300678	中科信息	600	18,456.00	0.03
512	300618	寒锐钴业	400	18,084.00	0.03
513	603997	继峰股份	1,300	18,070.00	0.03
514	002408	齐翔腾达	3,700	18,056.00	0.03
515	002015	协鑫能科	1,800	17,910.00	0.03
516	600757	长江传媒	2,000	17,760.00	0.03
517	688107	安路科技	641	17,422.38	0.03
518	002550	千红制药	2,200	17,292.00	0.03
519	600480	凌云股份	1,400	17,206.00	0.03
520	600718	东软集团	1,700	17,119.00	0.03
521	600782	新钢股份	4,400	17,072.00	0.03
522	300357	我武生物	600	17,010.00	0.03
523	002182	宝武镁业	1,100	16,830.00	0.03
524	600993	马应龙	600	16,800.00	0.03
525	002681	奋达科技	2,500	16,625.00	0.03
526	301589	诺瓦星云	100	16,455.00	0.02
527	300428	立中集团	700	16,345.00	0.02

528	603267	鸿远电子	300	16,329.00	0.02
529	300026	红日药业	4,600	16,192.00	0.02
530	688519	南亚新材	200	16,172.00	0.02
531	002706	良信股份	1,500	16,170.00	0.02
532	000848	承德露露	1,900	16,150.00	0.02
533	002468	申通快递	1,200	16,104.00	0.02
534	600037	歌华有线	2,200	16,060.00	0.02
535	000012	南玻 A	3,600	15,948.00	0.02
536	002649	博彦科技	1,200	15,828.00	0.02
537	601311	骆驼股份	1,700	15,589.00	0.02
538	002091	江苏国泰	1,700	15,351.00	0.02
539	600821	金开新能	3,000	15,300.00	0.02
540	000690	宝新能源	3,600	15,084.00	0.02
541	000550	江铃汽车	800	14,880.00	0.02
542	002545	东方铁塔	800	14,760.00	0.02
543	002867	周大生	1,200	14,616.00	0.02
544	300188	国投智能	1,000	14,610.00	0.02
545	603662	柯力传感	200	14,400.00	0.02
546	688403	汇成股份	877	14,365.26	0.02
547	300284	苏交科	1,800	14,184.00	0.02
548	301015	百洋医药	600	14,160.00	0.02
549	002654	万润科技	1,000	14,070.00	0.02
550	601609	金田股份	1,300	14,040.00	0.02
551	300613	富瀚微	300	13,818.00	0.02
552	300598	诚迈科技	300	13,791.00	0.02
553	603883	老百姓	900	13,320.00	0.02
554	300633	开立医疗	500	13,210.00	0.02
555	300926	博俊科技	400	13,112.00	0.02
556	003006	百亚股份	600	13,104.00	0.02
557	000682	东方电子	1,100	13,046.00	0.02
558	002060	广东建工	3,500	12,600.00	0.02
559	301500	飞南资源	800	12,552.00	0.02
560	300776	帝尔激光	200	12,428.00	0.02
561	301381	赛维时代	600	12,354.00	0.02
562	000712	锦龙股份	1,000	12,020.00	0.02

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	000657	中钨高新	15,800	437,818.00	0.66
2	688019	安集科技	1,980	431,481.60	0.65
3	603920	世运电路	8,500	411,485.00	0.62
4	688347	华虹公司	3,603	388,655.61	0.59

5	603766	隆鑫通用	21,400	344,754.00	0.52
6	002402	和而泰	8,200	320,784.00	0.48
7	603008	喜临门	15,100	309,248.00	0.47
8	688166	博瑞医药	5,808	284,940.48	0.43
9	002126	银轮股份	7,400	279,720.00	0.42
10	300393	中来股份	38,400	257,280.00	0.39
11	600477	杭萧钢构	75,400	223,938.00	0.34
12	688322	奥比中光	2,494	223,636.98	0.34
13	600967	内蒙一机	11,700	196,560.00	0.30
14	601015	陕西黑猫	46,100	166,882.00	0.25
15	300570	太辰光	1,000	115,550.00	0.17
16	600966	博汇纸业	16,300	111,329.00	0.17
17	605222	起帆电缆	5,500	101,145.00	0.15
18	002335	科华数据	1,800	99,954.00	0.15
19	300129	泰胜风能	9,300	97,278.00	0.15
20	301306	西测测试	800	91,488.00	0.14
21	688018	乐鑫科技	525	89,250.00	0.13
22	688266	泽璟制药	925	85,747.50	0.13
23	603444	吉比特	200	84,770.00	0.13
24	300596	利安隆	2,000	84,420.00	0.13
25	688192	迪哲医药	1,436	82,713.60	0.12
26	301292	海科新源	1,200	77,292.00	0.12
27	600313	农发种业	11,100	71,484.00	0.11
28	603626	科森科技	3,300	69,102.00	0.10
29	601827	三峰环境	8,000	67,760.00	0.10
30	688629	华丰科技	669	66,940.14	0.10
31	688539	高华科技	1,266	62,679.66	0.09
32	003041	真爱美家	1,100	59,763.00	0.09
33	300432	富临精工	3,440	57,448.00	0.09
34	688115	思林杰	860	56,398.80	0.09
35	000402	金融街	20,400	56,100.00	0.08
36	301270	汉仪股份	1,500	56,070.00	0.08
37	000988	华工科技	700	55,531.00	0.08
38	002738	中矿资源	700	54,985.00	0.08
39	301193	家联科技	2,500	53,925.00	0.08
40	688031	星环科技	488	52,796.72	0.08
41	000968	蓝焰控股	7,900	52,219.00	0.08
42	688323	瑞华泰	2,306	51,908.06	0.08
43	300513	恒实科技	5,300	50,297.00	0.08
44	688472	阿特斯	3,155	47,041.05	0.07
45	688651	盛邦安全	1,045	46,000.90	0.07
46	000959	首钢股份	9,100	44,590.00	0.07
47	000821	京山轻机	3,300	44,451.00	0.07

48	600665	天地源	13,400	43,952.00	0.07
49	688597	煜邦电力	5,282	43,365.22	0.07
50	600183	生益科技	600	42,846.00	0.06
51	301313	凡拓数创	1,600	42,416.00	0.06
52	000031	大悦城	15,000	42,300.00	0.06
53	301212	联盛化学	1,400	41,944.00	0.06
54	301333	诺思格	700	41,685.00	0.06
55	603699	纽威股份	800	41,576.00	0.06
56	600549	厦门钨业	1,000	41,060.00	0.06
57	688478	晶升股份	1,086	40,627.26	0.06
58	688212	澳华内镜	858	37,503.18	0.06
59	688601	力芯微	873	37,181.07	0.06
60	300978	东箭科技	2,800	35,112.00	0.05
61	002240	盛新锂能	900	30,987.00	0.05
62	000807	云铝股份	800	26,272.00	0.04
63	603993	洛阳钼业	1,200	24,000.00	0.04
64	002916	深南电路	100	23,229.00	0.04
65	300858	科拓生物	1,200	20,124.00	0.03
66	300395	菲利华	200	20,060.00	0.03
67	002463	沪电股份	200	14,614.00	0.02
68	300765	新诺威	400	14,428.00	0.02

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	002716	湖南白银	1,699,093.90	2.04
2	600409	三友化工	1,685,850.00	2.03
3	002839	张家港行	1,651,331.00	1.99
4	002061	浙江交科	1,612,239.20	1.94
5	002506	协鑫集成	1,610,272.00	1.94
6	300088	长信科技	1,604,819.00	1.93
7	000968	蓝焰控股	1,588,725.00	1.91
8	600475	华光环能	1,543,841.00	1.86
9	600252	中恒集团	1,535,342.00	1.85
10	300079	数码视讯	1,533,574.00	1.84
11	300393	中来股份	1,523,894.00	1.83
12	002807	江阴银行	1,519,688.00	1.83
13	300232	洲明科技	1,517,728.00	1.83
14	600908	无锡银行	1,503,710.00	1.81
15	601860	紫金银行	1,490,980.00	1.79
16	000059	华锦股份	1,481,928.00	1.78
17	600395	盘江股份	1,470,464.00	1.77

18	600662	外服控股	1,464,196.00	1.76
19	002174	游族网络	1,462,768.00	1.76
20	601908	京运通	1,445,986.00	1.74

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	600409	三友化工	1,848,946.00	2.22
2	002839	张家港行	1,826,108.40	2.20
3	002716	湖南白银	1,703,749.00	2.05
4	002807	江阴银行	1,699,987.00	2.04
5	300088	长信科技	1,698,376.00	2.04
6	002859	洁美科技	1,671,124.00	2.01
7	300079	数码视讯	1,661,474.00	2.00
8	000968	蓝焰控股	1,651,902.00	1.99
9	600252	中恒集团	1,647,851.00	1.98
10	603323	苏农银行	1,646,417.56	1.98
11	002948	青岛银行	1,639,463.00	1.97
12	601860	紫金银行	1,627,798.00	1.96
13	601528	瑞丰银行	1,586,665.00	1.91
14	002233	塔牌集团	1,574,094.90	1.89
15	600273	嘉化能源	1,569,907.00	1.89
16	002506	协鑫集成	1,551,446.00	1.87
17	600037	歌华有线	1,545,005.20	1.86
18	000690	宝新能源	1,511,133.00	1.82
19	000727	冠捷科技	1,511,088.00	1.82
20	002091	江苏国泰	1,495,543.00	1.80

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	1,052,846,832.36
卖出股票收入（成交）总额	1,092,204,282.38

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）	5,722.88	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,722.88	0.01

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	113697	应流转债	30	5,722.88	0.01

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，浙江臻镭科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会立案调查。

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	715,747.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,636.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	721,383.26

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	936	32,478.50	49,520.70	0.16	30,350,350.64	99.84
华安中证 1000 指数 增强 C	460	65,124.25	23,059,384.01	76.97	6,897,771.20	23.03
合计	1,396	43,235.69	23,108,904.71	38.29	37,248,121.84	61.71

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	1,926.75	0.01
	华安中证 1000 指数增强 C	21,473.05	0.07
	合计	23,399.80	0.04

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	71,886,419.56	25,212,969.69
本报告期基金总申 购份额	7,309,763.30	27,777,821.59

减：本报告期基金总赎回份额	48,796,311.52	23,033,636.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	30,399,871.34	29,957,155.21

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 27,000.00 元。

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

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人

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

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3；高级管理人员 4；
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函；出具警示函；
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、人员管理、其他问题：基金销售、财务管理；投资运作、合规内控；其他问题：基金销售、财务管理；其他问题：财务管理；
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》、《证券基金经

	营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、优化管理机制、加强事后检查等多种方式完成整改并通过监管机构检查验收。目前已恢复受理公司固定收益类公募基金产品注册。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	2,145,051,114.74	100.00	420,207.50	100.00	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

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

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

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

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

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

(1) 证券公司的尽职调查

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

(2) 证券公司的准入评估

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

(3) 证券公司的审批程序

公司领导对证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：无。

撤销交易单元的证券公司：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	134,028.62	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	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 1 月 22 日
2	华安基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 29 日
3	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 31 日
4	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 31 日
5	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日

	告	定媒介	
6	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日
7	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 6 月 27 日
8	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金（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和公司网站等规定媒介	2025 年 6 月 27 日
9	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金（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和公司网站等规定媒介	2025 年 6 月 27 日
10	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 7 月 21 日
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票华虹公司估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 27 日
12	华安基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 28 日
13	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 30 日
14	华安基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 27 日
15	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 27 日
16	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 11 日
17	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 2 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 14 日
18	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金（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和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 14 日
19	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金（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和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 14 日
20	华安基金管理有限公司关于调整旗	中国证监会基金电子披	2025 年 10 月 20 日

	下部分基金风险等级的公告	露网站和公司网站等规定媒介	
21	华安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 28 日
22	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 28 日
23	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和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 29 日
24	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和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 29 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20251031~20251231	0.00	20,059,384.01	0.00	20,059,384.01	33.23
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安中证 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

2026 年 3 月 31 日