

华安策略优选混合型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	52
10.9 其他重大事件	53
11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安策略优选混合型证券投资基金	
基金简称	华安策略优选混合	
基金主代码	040008	
交易代码	040008(前端)	041008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 8 月 2 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,294,930,847.32 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	以优选股票为主，配合多种投资策略，在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	① 资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定合适的资产配置比例。 ② 股票投资策略 本基金的股票投资策略将采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方法，通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以“自下而上”的优选成长策略为主，辅以“自上而下”的主题优选策略、逆势操作策略，优选具有良好投资潜力的个股，力求基金资产的中长期稳定增值。 ③ 债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种，基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。 ④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债国债总财富指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨牧云	陆志俊

负责人	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		朱学华	任德奇

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	832,168,192.18
本期利润	656,495,457.90
加权平均基金份额本期利润	0.2878
本期加权平均净值利润率	10.12%
本期基金份额净值增长率	10.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,210,879,422.83
期末可供分配基金份额利润	2.2706
期末基金资产净值	6,774,281,259.00

期末基金份额净值	2.9518
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	231.44%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

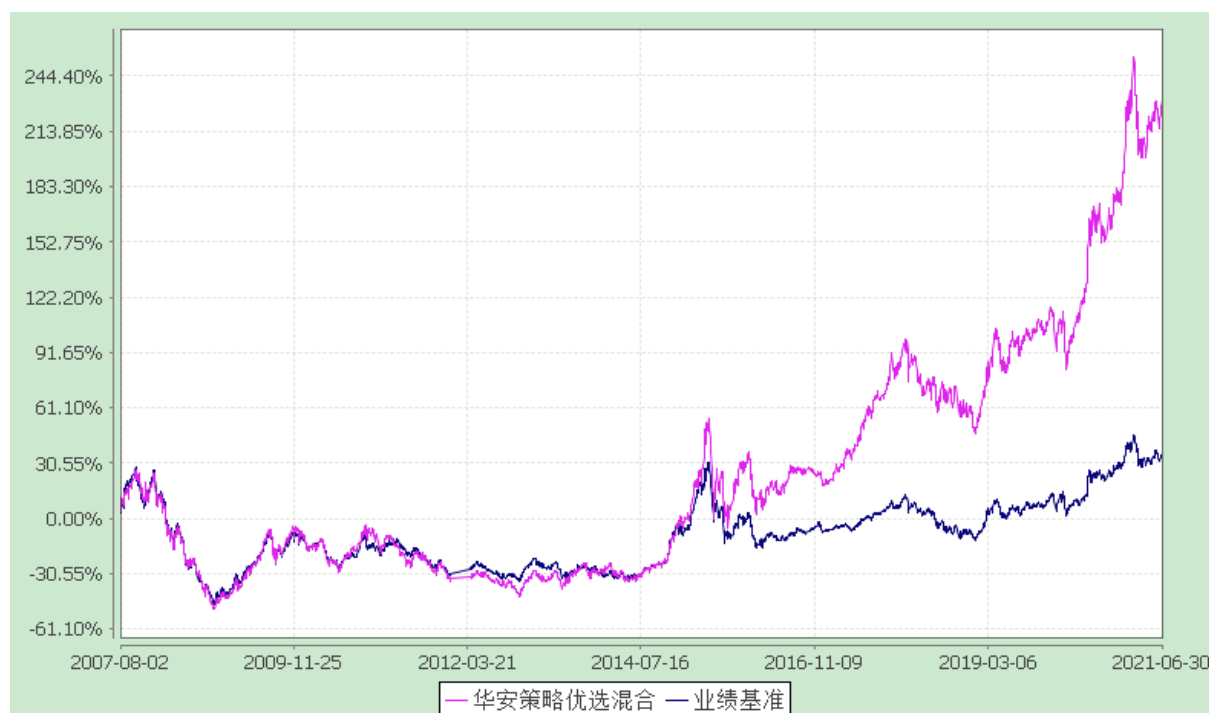
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.49%	0.94%	-1.62%	0.64%	2.11%	0.30%
过去三个月	8.05%	0.95%	3.06%	0.78%	4.99%	0.17%
过去六个月	10.55%	1.31%	0.63%	1.05%	9.92%	0.26%
过去一年	41.82%	1.33%	20.78%	1.06%	21.04%	0.27%
过去三年	101.17%	1.32%	41.71%	1.09%	59.46%	0.23%
自基金合同生效起至今	231.44%	1.50%	34.95%	1.33%	196.49%	0.17%

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

华安策略优选混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨明	本基金的基金	2013-06-0	-	21 年	中央财经大学硕士研究生，21 年

	经理、投资研究部高级总监	5			银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月加入华安基金管理有限公司, 历任研究发展部研究员, 现任投资研究部高级总监。 2013 年 6 月起担任华安策略优选混合型证券投资基金的基金经理。 2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 2016 年 3 月至 2018 年 3 月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 2016 年 5 月至 2018 年 10 月, 同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月至 2019 年 8 月, 同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 1 月起, 同时担任华安红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起, 同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起, 同时担任华安创新证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起, 同时担任华安优势企业混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起, 同时担任华安聚恒精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--------------	---	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理

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

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资

组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年全球继续努力摆脱疫情、恢复经济。虽然疫苗开始大范围接种，但是病毒变种也不断出现，人类与新冠病毒的斗争还在继续，还有不确定性。

2021 年上半年 A 股剧烈震荡，结构差异明显。医美、医疗服务、消费先涨后跌，震荡剧烈；电动车、光伏、半导体则持续强劲；周期、家电、银行走势疲软。小盘股、次新股表现较为强劲，显示市场风险偏好仍然较高。

本基金在报告期内净值波动。主要是由于我们对期间涨幅较大的板块配置较低，这与我们认为当前市场有些板块估值过高，采取了防御策略有关。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.9518 元，本报告期份额净值增长率为 10.55%，同期业绩比较基准增长率为 0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段事件，主导全球金融市场的首要因素还是抗疫形势。从目前的情况看，各国都在加紧接种疫苗、密切跟踪病毒变化情况。我们依然以病毒不发生会导致疫苗失效的重大变化、各国接种疫苗情况逐步加快并到年底基本达成全面接种为前提假设。

在这个假设下，我们认为全球经济活动将逐步解锁，而在此之前各国支持性的货币财政救助政策也会维持。由于欧美国家累计的政策力度已经非常大，随着疫苗接种的普及，经济回升的力度会逐步强化，全球整体经济形势将保持复苏的态势，但是复苏的结构会有所变化，从前期主要拉动有形商品的消费，到后期主要拉动服务类消费转变。

中国经济恢复较早，未来一段时间仍能受益于抗疫形势的好转，但我们认为中国经济恢复最快的阶段已经过去，正逐步回到潜在增长率，同时回到以提升经济运行质量为主的长期趋势上，继续深化产业升级、消费升级、供给侧改革。

但我们也看到，面临的挑战也不容小觑。

宏观方面，短期我们主要关注国内外通胀、利率的走势，关注国内局部去杠杆、房地产调控和信用风险的变化。中长期我们主要关注中美关系的演变，中国进一步加大开放改革的举措，关注关键领域“自主可控”、“碳中和”等重大产业政策的影响。

股市方面，我们认为存在的主要矛盾是高景气行业龙头股估值过高导致投资中期预期回报率不足，而周期性行业虽然估值较为合适但面临经济减速的压力。由于我们秉持相对均衡配置的投资方法，不在少数方向上集中，因此面临的投资难度也加大。

未来一段时间，我们认为市场将以横盘震荡为主，结构差异仍然较大。

我们将聚焦符合时代趋势的好行业，聚焦这些好行业中具有好生意模式，公司能够持续为社会创造真实价值的优秀公司，在估值相对可容忍的范围内进行投资，耐心等待其价值释放；同时，积极关注传统行业中能够适应环境变化、估值显著偏低的优质公司在经济逐渐走稳后估值修复的机会。继续努力为投资者提供风险有效控制基础上的良好长期回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，基金托管人在华安策略优选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，华安基金管理有限公司在华安策略优选混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安策略优选混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）**6.1 资产负债表**

会计主体：华安策略优选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,034,926,881.36	495,619,885.37
结算备付金		15,580,401.11	24,287,643.24
存出保证金		4,824,777.52	4,726,662.92
交易性金融资产	6.4.7.2	5,910,810,448.75	5,677,506,925.45
其中：股票投资		5,670,832,448.75	5,677,506,925.45
基金投资		-	-

债券投资		239,978,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,965,593.56
应收利息	6.4.7.5	1,061,796.41	141,801.91
应收股利		-	-
应收申购款		4,707,361.25	8,339,887.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,971,911,666.40	6,215,588,399.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		111,489,932.44	-
应付赎回款		51,824,344.72	26,316,682.48
应付管理人报酬		8,233,815.18	7,458,860.78
应付托管费		1,372,302.53	1,243,143.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,339,580.95	31,786,461.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,370,431.58	1,366,887.45
负债合计		197,630,407.40	68,172,035.95
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	904,825,210.80	907,752,197.89
未分配利润	6.4.7.10	5,869,456,048.20	5,239,664,166.13
所有者权益合计		6,774,281,259.00	6,147,416,364.02
负债和所有者权益总计		6,971,911,666.40	6,215,588,399.97

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.9518 元，基金份额总额 2,294,930,847.32 份。

6.2 利润表

会计主体：华安策略优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		751,652,176.79	564,112,810.23
1.利息收入		5,487,908.76	3,224,788.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,161,640.26	3,148,743.40
债券利息收入		326,268.50	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	76,045.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		920,608,299.67	834,369,824.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	853,129,267.56	786,247,202.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	804,913.04	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	66,674,119.07	48,122,622.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-175,672,734.28	-277,110,395.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,228,702.64	3,628,592.21
减：二、费用		95,156,718.89	101,433,614.83
1. 管理人报酬		48,421,071.65	45,786,321.47
2. 托管费		8,070,178.58	7,631,053.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	38,521,885.59	47,860,750.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		4.68	-
7. 其他费用	6.4.7.19	143,578.39	155,489.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		656,495,457.90	462,679,195.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		656,495,457.90	462,679,195.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安策略优选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	907,752,197.89	5,239,664,166.13	6,147,416,364.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	656,495,457.90	656,495,457.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,926,987.09	-26,703,575.83	-29,630,562.92
其中：1.基金申购款	208,301,248.32	1,300,522,185.67	1,508,823,433.99
2.基金赎回款	-211,228,235.41	-1,327,225,761.50	-1,538,453,996.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	904,825,210.80	5,869,456,048.20	6,774,281,259.00
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,745,589,794.72	6,663,763,731.26	8,409,353,525.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	462,679,195.40	462,679,195.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-618,730,709.98	-2,304,494,652.39	-2,923,225,362.37
其中：1.基金申购款	282,724,888.19	1,037,594,292.11	1,320,319,180.30
2.基金赎回款	-901,455,598.17	-3,342,088,944.50	-4,243,544,542.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,126,859,084.74	4,821,948,274.27	5,948,807,359.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安策略优选混合型证券投资基金(原名为华安策略优选股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)是根据原安久证券投资基金(以下简称“基金安久”)基金份额持有人大会 2007 年 6 月 29 日审议通过的《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]210 号《关于核准安久证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安久转型而来。原基金安久为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 8 月 30 日止。根据中国证监会批复及深交所深证复[2007]41 号《关于同意安久证券投资基金终止上市的批复》，原基金安久于 2007 年 8 月 1 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 8 月 2 日起，原基金安久终止上市，原基金安久更名为华安策略优选股票型证券投资基金(以下简称“策略优选股票基金”)，《安久证券投资基金基金合同》失效的同时《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》生效。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金安久于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,129,381,474.76 元，已于策略优选股票基金合同生效日全部转为策略优选股票基金的基金资产净值。根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告》，策略优选股票基金于 2007 年 8 月 20 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.536335136，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额变更登记。

策略优选股票基金在基金合同生效后于 2007 年 8 月 15 日开放集中申购，共募集人民币 9,853,567,332.90 元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计人民币 318,719.94 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 111 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 8 月 20 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,853,567,332.90 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 318,719.94 份基金份额，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安策略优选股

票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安策略优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(含存托凭证)、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或衍生金融工具。其中,股票投资比例为基金资产的 60%-95%;债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%;现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%以上,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债国债总财富指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 8 月 25 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,034,926,881.36
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,034,926,881.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,934,074,184.21	5,670,832,448.75	736,758,264.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	239,907,740.00	239,978,000.00	70,260.00
	合计	239,907,740.00	239,978,000.00	70,260.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,173,981,924.21	5,910,810,448.75	736,828,524.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	231,893.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,309.99
应收债券利息	821,638.36
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,954.08
合计	1,061,796.41

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	23,337,580.95
银行间市场应付交易费用	2,000.00
合计	23,339,580.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	167,451.13
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	139,507.37
预提审计费	63,473.08
其他	1,000,000.00
合计	1,370,431.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,302,353,187.96	907,752,197.89
本期申购	528,320,040.91	208,301,248.32
本期赎回（以“-”号填列）	-535,742,381.55	-211,228,235.41
本期末	2,294,930,847.32	904,825,210.80

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,386,488,427.25	853,175,738.88	5,239,664,166.13
本期利润	832,168,192.18	-175,672,734.28	656,495,457.90
本期基金份额交易产生的变动数	-7,777,196.60	-18,926,379.23	-26,703,575.83
其中：基金申购款	1,140,193,990.15	160,328,195.52	1,300,522,185.67
基金赎回款	-1,147,971,186.75	-179,254,574.75	-1,327,225,761.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,210,879,422.83	658,576,625.37	5,869,456,048.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,954,109.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	168,954.58
其他	38,575.89
合计	5,161,640.26

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,916,316,587.79
减：卖出股票成本总额	12,063,187,320.23
买卖股票差价收入	853,129,267.56

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,674,504.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,813,020.54
减：应收利息总额	56,570.46
买卖债券差价收入	804,913.04

6.4.7.13.2 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	66,674,119.07
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	66,674,119.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-175,672,734.28
——股票投资	-175,742,994.28
——债券投资	70,260.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-175,672,734.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,138,182.54
转换费收入	90,520.10
合计	1,228,702.64

注：基金赎回费收入包括赎回及转换基金补偿收入，本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	38,519,885.59
银行间市场交易费用	2,000.00
合计	38,521,885.59

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	63,473.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,997.94
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	143,578.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	698,257,035.16	2.27%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	650,276.81	2.28%	650,276.81	2.28%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	48,421,071.65	45,786,321.47
其中：支付销售机构的客户维护费	15,177,219.13	11,933,288.53

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,070,178.58	7,631,053.56

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	100,009,984.93	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

交通银行	1,034,926,88 1.36	4,954,109.79	410,935,281. 15	2,946,871.46
------	----------------------	--------------	--------------------	--------------

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-12-08	新股限售	64.99	247.10	1,955.00	127,055.45	483,080.50	-
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	新股限售	43.22	63.82	5,740.00	248,082.80	366,326.80	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	15.57	48.55	4,984.00	77,600.88	241,973.20	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	-
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股限售	18.94	100.92	1,941.00	36,762.54	195,885.72	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	新股限售	35.76	103.23	1,768.00	63,223.68	182,510.64	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	75.42	103.88	1,191.00	89,825.22	123,721.08	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股限售	9.41	38.46	3,049.00	28,691.09	117,264.54	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股限售	33.62	53.14	1,558.00	52,379.96	82,792.12	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股限售	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股限售	33.44	42.34	1,400.00	46,816.00	59,276.00	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-

30094 2	易瑞 生物	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 限售	5.31	28.52	443.00	2,352. 33	12,634 .36	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 限售	4.94	13.05	928.00	4,584. 32	12,110 .40	-
30100 2	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新股 限售	18.71	57.62	201.00	3,760. 71	11,581 .62	-
30095 5	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	新股 限售	16.53	46.07	232.00	3,834. 96	10,688 .24	-
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 限售	20.81	42.23	241.00	5,015. 21	10,177 .43	-
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 限售	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 限售	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	-
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 限售	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	-
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 限售	8.24	31.54	286.00	2,356. 64	9,020. 44	-
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 限售	4.56	18.88	474.00	2,161. 44	8,949. 12	-
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 限售	13.00	27.42	324.00	2,808. 00	8,884. 08	-
30093 1	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 限售	4.31	13.11	672.00	2,896. 32	8,809. 92	-
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 限售	8.48	22.07	394.00	3,341. 12	8,695. 58	-
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 限售	8.41	39.13	219.00	1,841. 79	8,569. 47	-
30095 8	建工 修复	2021-0 3-18	2021-0 9-29	新股 限售	8.53	27.22	300.00	2,559. 00	8,166. 00	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 限售	14.79	30.57	264.00	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 限售	6.79	26.81	301.00	2,043. 79	8,069. 81	-
30097 8	东箭 科技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 限售	8.42	13.60	593.00	4,993. 06	8,064. 80	-
30092 6	博俊 科技	2020-1 2-29	2021-0 7-12	新股 限售	10.76	22.20	359.00	3,862. 84	7,969. 80	-
30099 3	玉马 遮阳	2021-0 5-17	2021-1 1-24	新股 限售	12.10	19.29	410.00	4,961. 00	7,908. 90	-
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 限售	24.90	24.81	295.00	7,345. 50	7,318. 95	-
30100 4	嘉益 股份	2021-0 6-18	2021-1 2-27	新股 限售	7.81	21.94	312.00	2,436. 72	6,845. 28	-

300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234.00	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-

688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是以优选股票为主，配合多种投资策略，在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益，实现基

金资产的长期稳定增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在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。

6.4.13.3 流动性风险

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

格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,034,926,881.36	-	-	-	1,034,926,881.36
结算备付金	15,580,401.11	-	-	-	15,580,401.11
存出保证金	4,824,777.52	-	-	-	4,824,777.52
交易性金融资产	239,978,000.00	-	-	5,670,832,448.75	5,910,810,448.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,061,796.41	1,061,796.41
应收申购款	-	-	-	4,707,361.25	4,707,361.25
资产总计	1,295,310,059.99	-	-	5,676,601,606.41	6,971,911,666.40

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	111,489,932.44	111,489,932.44
应付赎回款	-	-	-	51,824,344.72	51,824,344.72
应付管理人报酬	-	-	-	8,233,815.18	8,233,815.18
应付托管费	-	-	-	1,372,302.53	1,372,302.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	23,339,580.95	23,339,580.95
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,370,431.58	1,370,431.58
负债总计	-	-	-	197,630,407.40	197,630,407.40
利率敏感度缺口	1,295,310,059.99	-	-	5,478,971,199.01	6,774,281,259.00
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	495,619,885.37	-	-	-	495,619,885.37
结算备付金	24,287,643.24	-	-	-	24,287,643.24
存出保证金	4,726,662.92	-	-	-	4,726,662.92
交易性金融资产	-	-	-	5,677,506,925.45	5,677,506,925.45
应收证券清算款	-	-	-	4,965,593.56	4,965,593.56
应收利息	-	-	-	141,801.91	141,801.91
应收申购款	-	-	-	8,339,887.52	8,339,887.52
资产总计	524,634,191.53	-	-	5,690,954,208.44	6,215,588,399.97
负债					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	26,316,682.48	26,316,682.48
应付管理人报酬	-	-	-	7,458,860.78	7,458,860.78
应付托管费	-	-	-	1,243,143.48	1,243,143.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	31,786,461.76	31,786,461.76
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,366,887.45	1,366,887.45
负债总计	-	-	-	68,172,035.95	68,172,035.95
利率敏感度缺口	524,634,191.53	-	-	5,622,782,172.49	6,147,416,364.02

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结

合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的 60%-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,670,832,448.75	83.71	5,677,506,925.45	92.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,670,832,448.75	83.71	5,677,506,925.45	92.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 38,923	增加约 33,853
	业绩比较基准下降 5%	减少约 38,923	减少约 33,853

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,670,832,448.75	81.34
	其中：股票	5,670,832,448.75	81.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	239,978,000.00	3.44
	其中：债券	239,978,000.00	3.44
	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	1,050,507,282.47	15.07
8	其他各项资产	10,593,935.18	0.15
9	合计	6,971,911,666.40	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,598,500,712.94	53.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00

E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.00
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	52,230,233.23	0.77
J	金融业	1,088,181,891.98	16.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	416,690,839.00	6.15
M	科学研究和技术服务业	514,442,049.16	7.59
N	水利、环境和公共设施管理业	408,286.50	0.01
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	5,670,832,448.75	83.71

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	8,299,239	449,735,761.41	6.64
2	603259	药明康德	2,783,231	435,826,142.29	6.43
3	300750	宁德时代	717,728	383,840,934.40	5.67
4	002415	海康威视	5,552,668	358,147,086.00	5.29
5	300767	震安科技	4,310,505	357,987,440.25	5.28
6	002142	宁波银行	8,482,367	330,557,841.99	4.88
7	002812	恩捷股份	1,371,284	321,017,584.40	4.74
8	000001	平安银行	13,604,126	307,725,330.12	4.54
9	300408	三环集团	6,586,550	279,401,451.00	4.12
10	600507	方大特钢	35,547,804	241,014,111.12	3.56
11	601888	中国中免	705,266	211,650,326.60	3.12
12	002027	分众传媒	21,789,640	205,040,512.40	3.03

13	000858	五粮液	669,506	199,439,142.34	2.94
14	600782	新钢股份	27,329,730	152,499,893.40	2.25
15	603806	福斯特	1,325,946	139,396,702.98	2.06
16	601865	福莱特	3,525,401	139,359,101.53	2.06
17	000568	泸州老窖	588,026	138,738,854.44	2.05
18	600519	贵州茅台	65,281	134,263,432.70	1.98
19	603187	海容冷链	3,119,272	133,754,383.36	1.97
20	000932	华菱钢铁	20,224,178	133,479,574.80	1.97
21	600563	法拉电子	658,133	104,221,941.88	1.54
22	002706	良信股份	4,605,140	103,799,855.60	1.53
23	300760	迈瑞医疗	145,008	69,611,090.40	1.03
24	300012	华测检测	2,171,691	69,233,509.08	1.02
25	300957	贝泰妮	243,723	66,200,272.18	0.98
26	000786	北新建材	1,604,756	62,986,673.00	0.93
27	300613	富瀚微	333,310	51,956,362.80	0.77
28	002254	泰和新材	1,834,993	37,195,308.11	0.55
29	603345	安井食品	133,700	33,962,474.00	0.50
30	688133	泰坦科技	27,427	8,718,220.49	0.13
31	300896	爱美客	852	672,125.76	0.01
32	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.01
33	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.01
34	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
35	688383	新益昌	2,701	380,868.01	0.01
36	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.01
37	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
38	688578	艾力斯	10,734	353,899.98	0.01
39	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.00
40	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.00
41	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
42	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
43	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.00
44	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.00
45	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.00
46	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.00
47	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
48	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.00
49	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.00
50	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.00
51	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.00
52	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
53	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.00
54	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.00
55	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.00
56	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.00

57	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.00
58	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.00
59	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.00
60	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
61	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
62	300987	川网传媒	3,004	113,378.69	0.00
63	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.00
64	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.00
65	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.00
66	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.00
67	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
68	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
69	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
70	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.00
71	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
72	688685	迈信林	2,612	67,781.40	0.00
73	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
74	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
75	688557	兰剑智能	1,812	60,973.80	0.00
76	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
77	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
78	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
79	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
80	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
81	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
82	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
83	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
84	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
85	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
86	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
87	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
88	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
89	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
90	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
91	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
92	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
93	600031	三一重工	800	23,256.00	0.00
94	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
95	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
96	300884	狄耐克	749	20,133.12	0.00
97	605305	中际联合	368	19,364.16	0.00
98	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
99	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
100	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00

101	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
102	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
103	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
104	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
105	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
106	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
107	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
108	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
109	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
110	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
111	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
112	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
113	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
114	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
115	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
116	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
117	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
118	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
119	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
120	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
121	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
122	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
123	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
124	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
125	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
126	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
127	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
128	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
129	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
130	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
131	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
132	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
133	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
134	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
135	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	--------------------

1	300750	宁德时代	688,521,756.33	11.20
2	600519	贵州茅台	527,212,213.78	8.58
3	000568	泸州老窖	494,373,822.59	8.04
4	000858	五粮液	491,441,493.02	7.99
5	603259	药明康德	478,095,821.02	7.78
6	000786	北新建材	372,689,497.58	6.06
7	002812	恩捷股份	343,305,481.61	5.58
8	601888	中国中免	334,212,130.70	5.44
9	300408	三环集团	322,067,164.27	5.24
10	600507	方大特钢	309,351,716.62	5.03
11	600019	宝钢股份	301,667,261.51	4.91
12	000001	平安银行	299,965,403.00	4.88
13	601865	福莱特	291,095,100.57	4.74
14	600908	无锡银行	266,982,503.54	4.34
15	000333	美的集团	264,487,041.64	4.30
16	300015	爱尔眼科	255,082,185.39	4.15
17	002714	牧原股份	253,227,116.96	4.12
18	601166	兴业银行	249,790,546.23	4.06
19	300014	亿纬锂能	232,160,297.45	3.78
20	000739	普洛药业	223,143,891.25	3.63
21	000516	国际医学	222,642,723.36	3.62
22	002352	顺丰控股	203,207,554.33	3.31
23	601601	中国太保	199,944,731.09	3.25
24	000157	中联重科	190,174,630.62	3.09
25	000338	潍柴动力	188,436,785.99	3.07
26	601899	紫金矿业	184,217,392.78	3.00
27	600066	宇通客车	184,016,312.78	2.99
28	002241	歌尔股份	183,501,608.95	2.99
29	300759	康龙化成	169,527,071.07	2.76
30	600782	新钢股份	166,071,805.84	2.70
31	600298	安琪酵母	164,633,255.82	2.68
32	600176	中国巨石	161,625,251.29	2.63
33	300124	汇川技术	152,611,039.57	2.48
34	000932	华菱钢铁	148,619,511.38	2.42
35	002353	杰瑞股份	135,466,349.57	2.20
36	603806	福斯特	135,392,460.40	2.20
37	600036	招商银行	133,680,769.38	2.17
38	002415	海康威视	131,454,681.04	2.14
39	601012	隆基股份	129,761,554.51	2.11
40	000661	长春高新	128,360,847.86	2.09
41	600809	山西汾酒	123,478,713.72	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	639,823,230.21	10.41
2	000858	五粮液	626,955,845.80	10.20
3	601888	中国中免	562,349,152.98	9.15
4	600519	贵州茅台	549,295,058.00	8.94
5	300750	宁德时代	522,139,574.72	8.49
6	000333	美的集团	442,747,225.97	7.20
7	000786	北新建材	369,754,938.17	6.01
8	601012	隆基股份	344,100,218.57	5.60
9	601166	兴业银行	333,876,289.50	5.43
10	002812	恩捷股份	325,875,431.46	5.30
11	600019	宝钢股份	314,093,748.92	5.11
12	000516	国际医学	303,484,726.64	4.94
13	600176	中国巨石	293,521,048.05	4.77
14	300015	爱尔眼科	278,499,409.33	4.53
15	300014	亿纬锂能	249,704,311.60	4.06
16	002714	牧原股份	241,892,819.81	3.93
17	000002	万科 A	236,683,353.15	3.85
18	600908	无锡银行	235,577,068.34	3.83
19	000739	普洛药业	224,515,619.55	3.65
20	600048	保利地产	216,815,867.95	3.53
21	000157	中联重科	211,389,216.52	3.44
22	300760	迈瑞医疗	202,858,259.41	3.30
23	002241	歌尔股份	201,482,731.92	3.28
24	002027	分众传媒	198,450,962.82	3.23
25	601865	福莱特	195,023,757.22	3.17
26	002511	中顺洁柔	193,823,940.57	3.15
27	600486	扬农化工	187,624,919.15	3.05
28	000338	潍柴动力	185,173,166.10	3.01
29	601601	中国太保	183,466,529.15	2.98
30	600031	三一重工	182,062,987.53	2.96
31	300759	康龙化成	174,917,768.66	2.85
32	601899	紫金矿业	172,043,028.29	2.80
33	002352	顺丰控股	164,705,683.25	2.68
34	600298	安琪酵母	160,741,213.78	2.61
35	002967	广电计量	159,333,786.34	2.59
36	600066	宇通客车	158,112,803.37	2.57
37	002475	立讯精密	147,333,765.75	2.40
38	300274	阳光电源	147,320,944.12	2.40

39	300124	汇川技术	140,342,188.77	2.28
40	600887	伊利股份	139,135,104.90	2.26
41	002299	圣农发展	135,849,128.34	2.21
42	600690	海尔智家	133,405,331.06	2.17
43	600809	山西汾酒	130,107,235.90	2.12
44	603259	药明康德	127,598,548.93	2.08
45	601100	恒立液压	126,763,059.95	2.06
46	300628	亿联网络	126,013,371.58	2.05

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,232,255,837.81
卖出股票的收入（成交）总额	12,916,316,587.79

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,006,000.00	0.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	219,972,000.00	3.25
	其中：政策性金融债	219,972,000.00	3.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	239,978,000.00	3.54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	092118100	21 农发清发 100	1,000,000	100,040,000.00	1.48
2	210304	21 进出 04	1,000,000	99,930,000.00	1.48
3	210006	21 付息国债 06	200,000	20,006,000.00	0.30
4	210206	21 国开 06	200,000	20,002,000.00	0.30

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

2020 年 10 月 16 日，宁波银行因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字（2020）48 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，被宁波银保监局（甬银保监罚决字（2021）36 号）给予罚款人民币 25 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

2020 年 10 月 16 日，平安银行因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字（2020）66 号）给予合计罚款人民币 100 万元的行政处罚。2021 年 5 月 28 日，平安银行因利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规事项，被中国银保监会云南监管局（云银保监罚决字（2021）34 号）给予罚款人民币 210 万元的行政处罚。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,824,777.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,061,796.41
5	应收申购款	4,707,361.25
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,593,935.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
541,079	4,241.40	232,040,306.35	10.11%	2,062,890,540.97	89.89%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	372,774.26	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 8 月 2 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,302,353,187.96
本报告期基金总申购份额	528,320,040.91
减：本报告期基金总赎回份额	535,742,381.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,294,930,847.32

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的 比例		金总量的 比例	
华创证券	1	7,540,975,530.34	30.00%	7,022,920.49	30.09%	-
西部证券	1	3,283,000,939.20	13.06%	3,057,450.09	13.10%	-
海通证券	1	2,663,321,283.10	10.59%	2,427,092.15	10.40%	-
东方证券	2	2,204,575,646.60	8.77%	2,053,123.97	8.80%	-
中信证券	2	1,936,045,685.52	7.70%	1,803,036.14	7.73%	-
国元证券	1	1,460,547,896.56	5.81%	1,360,195.62	5.83%	-
平安证券	1	1,293,914,938.25	5.15%	1,205,021.19	5.16%	-
浙商证券	1	1,201,086,093.20	4.78%	1,118,575.94	4.79%	-
广发证券	2	1,200,346,403.39	4.78%	1,109,663.46	4.75%	-
中泰证券	1	722,720,941.23	2.88%	673,056.63	2.88%	-
华宝证券	1	588,631,146.37	2.34%	548,190.68	2.35%	-
信达证券	1	503,859,434.93	2.00%	459,168.36	1.97%	-
江海证券	1	268,445,939.90	1.07%	250,006.08	1.07%	-
东兴证券	1	114,243,685.78	0.45%	106,395.22	0.46%	-
国海证券	1	79,062,982.34	0.31%	73,632.13	0.32%	-
上海证券	1	76,342,656.96	0.30%	69,570.88	0.30%	-
国金证券	1	517,413.49	0.00%	481.92	0.00%	-
长城国瑞证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	6,593,422.95	53.15%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	5,812,100.00	46.85%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长城国瑞证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安策略优选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-21
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
4	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
5	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2021-02-08

		定媒介	
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19
7	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
8	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盛京银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-20
9	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
10	华安策略优选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-30
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（味知香）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（华生科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
13	华安策略优选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
16	华安策略优选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
17	华安策略优选混合型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
18	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-07
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（可靠股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-09
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会基金电子披	2021-06-18

	联方承销证券的公告（百克生物）	露网站和公司网站等指定媒介	
--	-----------------	---------------	--

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安策略优选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《华安策略优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华安策略优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华安策略优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 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。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日