

华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
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	期末上市基金前十名持有人	50
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	51
9	开放式基金份额变动	51
10	重大事件揭示	51
10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.7.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	54
10.8	其他重大事件	55
11	备查文件目录	56
11.1	备查文件目录	56
11.2	存放地点	56
11.3	查阅方式	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安科创主题混合
场内简称	科创混合
基金主代码	501073
交易代码	501073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 11 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	988,565,281.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。 本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。 本基金管理人根据多因素框架的分析结果，给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。 本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪科创板企业所处行业，努力探寻具备长期价值增长潜力的科创板上市公司。采用定性分析与定量分析相结合、自上而下与自下而上相结合、书面资料与实地调研相结合的方式，系统地审视与判断投资机遇。
业绩比较基准	（一）封闭运作期内 本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×40%+中债综合指数收益率×60%。 （二）封闭运作期届满转为开放式运作后 本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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	27,329,267.61
本期利润	66,406,926.35
加权平均基金份额本期利润	0.0672
本期加权平均净值利润率	5.81%
本期基金份额净值增长率	5.90%
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	135,594,436.16
期末可供分配基金份额利润	0.1372

期末基金资产净值	1,192,564,583.33
期末基金份额净值	1.2064
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	20.64%

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

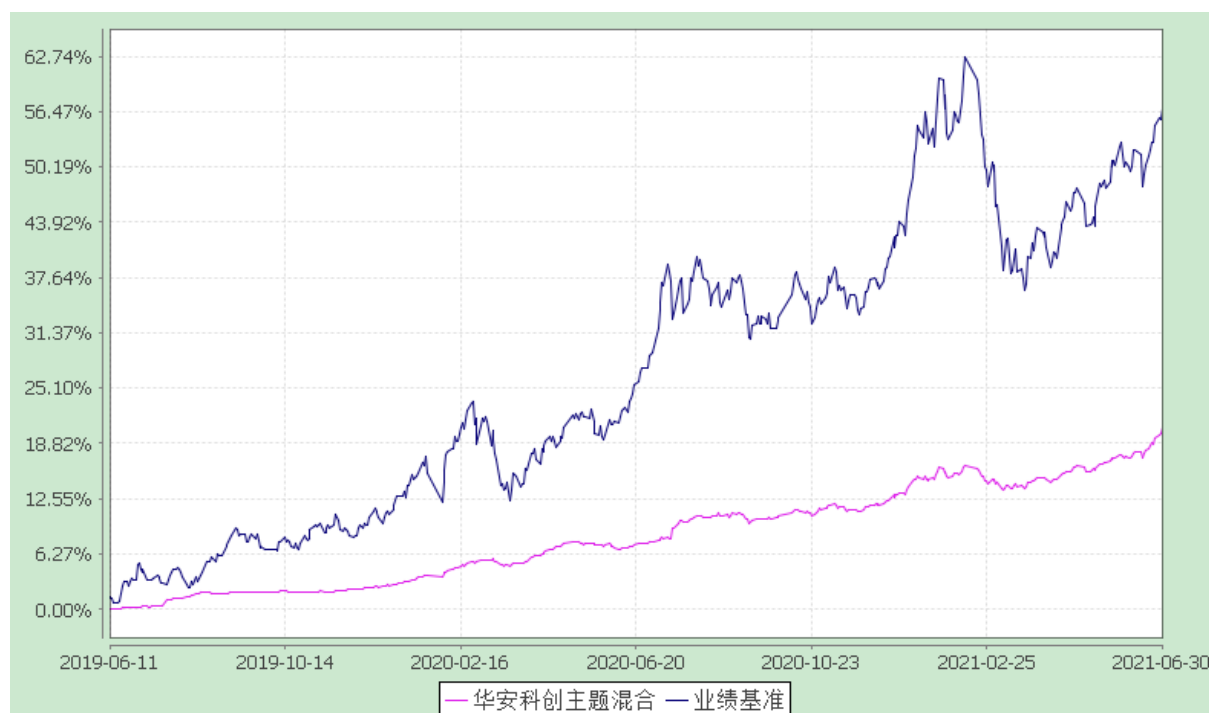
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.65%	0.27%	1.83%	0.56%	0.82%	-0.29%
过去三个月	5.32%	0.21%	8.20%	0.61%	-2.88%	-0.40%
过去六个月	5.90%	0.24%	5.05%	0.82%	0.85%	-0.58%
过去一年	12.14%	0.22%	16.46%	0.73%	-4.32%	-0.51%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.64%	0.16%	56.72%	0.67%	-36.08%	-0.51%

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

华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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

(2019 年 6 月 11 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		
谢昌旭	本基金的基金经理	2019-06-11	-	8 年	硕士研究生，8 年基金及相关行业从业经验。曾任融通基金管理有限公司研究员、平安养老保险股份有限公司权益投资经理。2018 年 9 月加入华安基金，2018 年 10 月起，担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安安华灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安医疗创新混合型证券投资

					基金的基金经理。2020 年 7 月起，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。
朱才敏	本基金的基金经理	2021-03-08	-	13 年	金融工程硕士，具有基金从业资格证书，13 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月至 2017 年 7 月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 11 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金、华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 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 月起，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。2016 年 9 月至 2018 年 1 月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2021 年 3 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019 年 8 月至 2021 年 3 月，同时担任华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵

					活配置混合型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。
李欣	本基金的基金经理	2019-06-11	2021-03-08	11 年	硕士研究生，11 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 11 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安科技动力混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起，同时担任华安科技创新混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安汇宏精选混合型证券投资基金的基金经理。
胡宜斌	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2019-06-11	2021-03-08	9 年	硕士研究生，9 年证券、基金行业从业经验。曾任杭州核新同花顺股份有限公司产品经理、长江证券股份有限公司研究员、上投摩根基金管理有限公司研究员，2015 年 5 月加入华安基金，担任基金投资部基金经理助理。2015 年 11 月起担任华安媒体互联网混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 1 月至 2017 年 7 月，担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月起，同时担任华安智能生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2021

					年 3 月,同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起,同时担任华安成长创新混合型证券投资基金的基金经理。
郑如熙	本基金的基金经理、固定收益部助理总监	2019-06-11	2021-03-08	16 年	复旦大学硕士,16 年相关从业经验。历任上海远东资信评估有限公司评级分析师、太平资产管理有限公司信用研究员、华泰证券股份有限公司投资经理、交易团队负责人,2017 年 5 月加入华安基金,任固定收益部研究员。2017 年 7 月起,担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 5 月,同时担任华安慧增优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月起,同时担任华安安悦债券型证券投资基金、华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起,同时担任华安鼎益债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 11 月,同时担任华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 4 月起,同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起,同时担任华安安平 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2021 年 3 月,同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月起,同时担任华安安嘉 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起,同时担任华安年年丰一年定期开放债券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，中国经济处于高位逐步回落的状态，社融增速、固定资产投资持续下行，消费受到疫情和居民收入预期影响恢复较为缓慢，而金融市场流动性呈现较为宽松的状态。上半年中国股票市场呈现较大波动、分化明显的状态，其中上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.24%，创业板则表现突出，上涨 17.22%。行业方面，钢铁、电气设备、化工、采掘、综合等板块表现较好，而非银行金融、军工、家电、农林牧渔、传媒等行业表现较为落后。

报告期内本基金重点投资了新能源、人工智能、创新药及创新药产业链、半导体、医疗器械、计算机等方向的优秀公司。债券方面，本基金保持组合高等级信用债策略，动态调整组合久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2064 元，本报告期份额净值增长率为 5.90%，同期业绩比较基准增长率为 5.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，我们认为中国经济增长趋于平稳，系统性风险不大。在此轮疫情中，中国

制造业的优势得到持续体现，很多细分行业的龙头公司竞争优势持续扩大，民族自信心得到了极大增强。疫情也带来了很多其他长周期的趋势改变或者进一步加强，我们预期未来还将持续。政府政策着力于提高经济的中长期潜在增长率，如双循环、资本市场改革、打破刚兑、地产调控、反垄断等，都是为了支持经济转型升级、持续创新和效率提升，这些将对有持续成长能力的行业和公司带来持续的正面作用。就科技行业而言，我们认为新能源、人工智能、创新药、半导体、5G 应用、云计算、高端医疗器械、自动化等细分行业还有较大成长空间，中期发展态势也非常良好。从估值来看，当前股票市场的估值分化较大，成长性较好的新兴产业估值处于偏高的状态，对未来的成长性有一定透支，但长期来看一些细分行业中的优秀公司成长空间仍然比较大。

综上所述，我们对 2021 年下半年股票市场具有结构性机会，重点投资我们看好的科技领域中成长空间大、竞争优势突出的优秀公司，从中选择风险收益比高的投资标的构建投资组合。债券操作上，短期高等级信用债估值水平偏高，暂时降低久期和杠杆水平。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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	84,283,961.65	44,102,458.89
结算备付金		149,581.26	372,140.72
存出保证金		23,079.03	55,639.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,098,368,551.79	1,170,923,958.38

其中：股票投资		369,215,051.79	126,777,431.38
基金投资		-	-
债券投资		729,153,500.00	1,044,146,527.00
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	-	21,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	11,550,029.70	17,600,292.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,194,375,203.43	1,254,054,489.99
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		-	126,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,151,135.66	1,128,615.29
应付托管费		191,855.92	188,102.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	262,719.97	235,688.84
应交税费		95,812.61	79,562.07
应付利息		-	47,864.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,095.94	217,000.00
负债合计		1,810,620.10	127,896,833.01
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	988,565,281.49	988,565,281.49
未分配利润	6.4.7.10	203,999,301.84	137,592,375.49
所有者权益合计		1,192,564,583.33	1,126,157,656.98
负债和所有者权益总计		1,194,375,203.43	1,254,054,489.99

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2064 元，基金份额总额 988,565,281.49 份。

6.2 利润表

会计主体：华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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		75,330,620.78	57,449,017.72
1.利息收入		18,762,536.04	21,962,657.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	163,903.34	183,751.86
债券利息收入		18,524,397.29	21,399,832.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		74,235.41	379,073.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,490,426.00	24,550,320.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,265,218.54	18,606,627.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,204,037.22	5,708,206.84
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	429,244.68	235,485.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	39,077,658.74	10,936,039.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、费用		8,923,694.43	10,330,623.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,806,241.28	6,237,702.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,134,373.57	1,039,617.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	435,831.46	139,958.12
5. 利息支出		346,247.20	2,673,168.62
其中：卖出回购金融资产支出		346,247.20	2,673,168.62
6.税金及附加		66,446.21	76,514.02
7. 其他费用	6.4.7.18	134,554.71	163,663.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		66,406,926.35	47,118,394.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		66,406,926.35	47,118,394.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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）	988,565,281.49	137,592,375.49	1,126,157,656.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,406,926.35	66,406,926.35
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	988,565,281.49	203,999,301.84	1,192,564,583.33
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）	988,565,281.49	27,858,010.33	1,016,423,291.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,118,394.45	47,118,394.45
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	988,565,281.49	74,976,404.78	1,063,541,686.27

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

华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 935 号《关于准予华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 988,565,281.49 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0346 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 6 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 988,565,281.49 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金(LOF)，基金名称调整为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”，并接受场外、场内申购赎回。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]286 号文核准同意，本基金 323,941,884.00 份基金份额于 2019 年 12 月 20 日在上交所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金于封闭运作期内投资于国内依法发行上市的股票(含科创板、中小板、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)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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)。本基金于封闭运作期的投资组合比例为：股票资产投资比例为

基金资产的 0%-100%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金于封闭运作期的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×40%+中债综合指数收益率×60%。

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》、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	84,283,961.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	84,283,961.65

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		299,871,451.42	369,215,051.79	69,343,600.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	370,118,914.67	367,354,500.00	-2,764,414.67
	银行间市场	359,973,320.02	361,799,000.00	1,825,679.98
	合计	730,092,234.69	729,153,500.00	-938,734.69
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,029,963,686.11	1,098,368,551.79	68,404,865.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	14,734.64
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	60.57
应收债券利息	11,535,225.22
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	9.27
合计	11,550,029.70

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	259,826.88
银行间市场应付交易费用	2,893.09
合计	262,719.97

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	49,588.57
合计	109,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	988,565,281.49	988,565,281.49
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	988,565,281.49	988,565,281.49

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	108,265,168.55	29,327,206.94	137,592,375.49
本期利润	27,329,267.61	39,077,658.74	66,406,926.35
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,594,436.16	68,404,865.68	203,999,301.84

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	159,462.50
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	4,148.62
其他	292.22
合计	163,903.34

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	76,124,768.33
减：卖出股票成本总额	57,859,549.79
买卖股票差价收入	18,265,218.54

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	537,615,469.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	527,671,882.94
减：应收利息总额	11,147,623.32
买卖债券差价收入	-1,204,037.22

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 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	429,244.68
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	429,244.68

6.4.7.18 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	39,077,658.74

——股票投资	37,440,448.98
——债券投资	1,637,209.76
——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	39,077,658.74

6.4.7.19 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	434,056.46
银行间市场交易费用	1,775.00
合计	435,831.46

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,498.77
账户维护费	18,360.00
其他费用	600.00
合计	134,554.71

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(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	139,500,850.21	42.78%	63,943.07	0.15%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	88,181.00	0.17%	41,283,287.68	7.34%

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	127,127.52	42.47%	87,640.08	33.73%
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	58.27	0.14%	58.27	0.14%

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	6,806,241.28	6,237,702.00
其中：支付销售机构的客户维护费	1,495,393.14	1,525,962.39

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 × 1.20% / 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	1,134,373.57	1,039,617.03

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	29,968,762.51	3.03%	32,972,526.51	3.34%

6.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	84,283,961.65	159,462.50	37,877,221.81	156,109.25

6.4.10.5 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

6.4.11 利润分配情况

本报告期内无利润分配情况。

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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
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	-
688660	电气风电	2021-05-11	2021-11-19	新股限售	5.44	7.26	51,238.00	278,734.72	371,987.88	-
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	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	717.00	33,935.61	180,655.32	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	新股限售	16.43	63.50	2,617.00	42,997.31	166,179.50	-
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	12.76	39.20	3,711.00	47,352.36	145,471.20	-
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	-
688316	青云科技	2021-03-05	2021-09-16	新股限售	63.70	65.00	1,428.00	90,963.60	92,820.00	-
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	-
688359	三孚新科	2021-05-14	2021-11-22	新股限售	11.03	26.35	2,213.00	24,409.39	58,312.55	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	489.00	23,760.51	44,200.71	-

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	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	新股限售	6.50	10.46	3,671.00	23,861.50	38,398.66	-
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	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-

300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股限售	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312.00	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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

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都要低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	30,231,000.00	50,195,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	50,140,000.00	50,035,000.00
合计	80,371,000.00	100,230,000.00

注：未评级债券为国债、短期融资券、政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	638,722,500.00	943,814,500.00
AAA 以下	-	102,027.00
未评级	10,060,000.00	-
合计	648,782,500.00	943,916,527.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

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于约定开放日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。

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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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	84,283,961.65	-	-	-	84,283,961.65
结算备付金	149,581.26	-	-	-	149,581.26
存出保证金	23,079.03	-	-	-	23,079.03
交易性金融资产	391,781,000.00	337,372,500.00	-	369,215,051.79	1,098,368,551.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	11,550,029.70	11,550,029.70
资产总计	476,237,621.94	337,372,500.00	-	380,765,081.49	1,194,375,203.43
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,151,135.66	1,151,135.66
应付托管费	-	-	-	191,855.92	191,855.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	262,719.97	262,719.97
应交税费	-	-	-	95,812.61	95,812.61
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	109,095.94	109,095.94
负债总计	-	-	-	1,810,620.10	1,810,620.10
利率敏感度缺口	476,237,621.94	337,372,500.00	-	378,954,461.39	1,192,564,583.33
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	44,102,458.89	-	-	-	44,102,458.89
结算备付金	372,140.72	-	-	-	372,140.72
存出保证金	55,639.64	-	-	-	55,639.64
交易性金融资产	661,562,027.00	382,584,500.00	-	126,777,431.38	1,170,923,958.38
买入返售金融资产	21,000,000.00	-	-	-	21,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	17,600,292.36	17,600,292.36
资产总计	727,092,266.25	382,584,500.00	-	144,377,723.74	1,254,054,489.99
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	126,000,000.00	-	-	-	126,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,128,615.29	1,128,615.29
应付托管费	-	-	-	188,102.54	188,102.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	235,688.84	235,688.84
应交税费	-	-	-	79,562.07	79,562.07
应付利息	-	-	-	47,864.27	47,864.27
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	217,000.00	217,000.00
负债总计	126,000,000.00	-	-	1,896,833.01	127,896,833.01

					1
利率敏感度缺口	601,092,266.25	382,584,500.00	-	142,480,890.73	1,126,157,656.98

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 160	增加约 240
	市场利率上升 25 个基点	减少约 159	减少约 239

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。本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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。

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	369,215,051.79	30.96	126,777,431.38	11.26
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	369,215,051.79	30.96	126,777,431.38	11.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,654	增加约 700
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,654	减少约 700

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	369,215,051.79	30.91
	其中：股票	369,215,051.79	30.91

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	729,153,500.00	61.05
	其中：债券	729,153,500.00	61.05
	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	84,433,542.91	7.07
8	其他各项资产	11,573,108.73	0.97
9	合计	1,194,375,203.43	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	275,261,587.33	23.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.43
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.03
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	34,839,940.58	2.92
J	金融业	97,319.40	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.00
M	科学研究和技术服务业	25,345,186.76	2.13
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,329,796.94	2.21
R	文化、体育和娱乐业	1,721,860.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	369,215,051.79	30.96

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	300750	宁德时代	58,700	31,392,760.00	2.63
2	002415	海康威视	311,000	20,059,500.00	1.68
3	300760	迈瑞医疗	38,700	18,577,935.00	1.56
4	002475	立讯精密	400,900	18,441,400.00	1.55
5	601012	隆基股份	175,435	15,585,645.40	1.31
6	603259	药明康德	97,700	15,298,843.00	1.28
7	002812	恩捷股份	62,500	14,631,250.00	1.23
8	688111	金山办公	36,779	14,520,349.20	1.22
9	002594	比亚迪	53,800	13,503,800.00	1.13
10	300347	泰格医药	68,887	13,315,857.10	1.12
11	603501	韦尔股份	40,900	13,169,800.00	1.10
12	300363	博腾股份	150,100	12,626,412.00	1.06
13	603290	斯达半导	35,900	11,488,000.00	0.96
14	002241	歌尔股份	220,900	9,441,266.00	0.79
15	300014	亿纬锂能	88,365	9,183,774.45	0.77
16	300223	北京君正	85,600	8,638,752.00	0.72
17	300595	欧普康视	82,880	8,582,224.00	0.72
18	300896	爱美客	10,620	8,377,905.60	0.70
19	300759	康龙化成	35,250	7,648,897.50	0.64
20	600570	恒生电子	81,100	7,562,575.00	0.63
21	002821	凯莱英	20,102	7,490,005.20	0.63
22	600763	通策医疗	15,900	6,534,900.00	0.55
23	300782	卓胜微	11,900	6,396,250.00	0.54
24	300613	富瀚微	37,262	5,808,400.56	0.49
25	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.43
26	300327	中颖电子	51,000	4,346,730.00	0.36
27	603876	鼎胜新材	126,024	3,913,045.20	0.33
28	603882	金域医学	23,800	3,802,526.00	0.32
29	002371	北方华创	13,700	3,800,106.00	0.32

30	688029	南微医学	11,955	3,726,253.95	0.31
31	688012	中微公司	22,137	3,672,971.04	0.31
32	688036	传音控股	17,210	3,605,495.00	0.30
33	688018	乐鑫科技	15,114	3,527,909.88	0.30
34	002410	广联达	44,500	3,034,900.00	0.25
35	300957	贝泰妮	10,967	2,965,477.82	0.25
36	300015	爱尔眼科	37,708	2,676,513.84	0.22
37	300408	三环集团	51,000	2,163,420.00	0.18
38	002444	巨星科技	51,200	1,744,896.00	0.15
39	300413	芒果超媒	25,100	1,721,860.00	0.14
40	002460	赣锋锂业	12,500	1,513,625.00	0.13
41	300450	先导智能	22,400	1,347,136.00	0.11
42	300122	智飞生物	6,000	1,120,380.00	0.09
43	300012	华测检测	34,000	1,083,920.00	0.09
44	300747	锐科激光	9,150	1,043,649.00	0.09
45	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.09
46	000739	普洛药业	32,300	949,620.00	0.08
47	002353	杰瑞股份	20,900	934,230.00	0.08
48	002595	豪迈科技	31,500	841,050.00	0.07
49	002690	美亚光电	13,400	747,184.00	0.06
50	300628	亿联网络	8,600	720,680.00	0.06
51	002236	大华股份	33,300	702,630.00	0.06
52	300316	晶盛机电	13,800	696,900.00	0.06
53	002001	新 和 成	22,920	657,345.60	0.06
54	002597	金禾实业	18,500	641,950.00	0.05
55	688179	阿拉丁	3,944	553,106.56	0.05
56	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.04
57	300973	立高食品	3,193	480,770.60	0.04
58	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.03
59	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.03
60	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.03
61	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.03
62	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
63	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.02
64	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.02
65	688386	泛亚微透	3,217	188,998.75	0.02
66	688513	苑东生物	3,847	173,307.35	0.01
67	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
68	688288	鸿泉物联	3,429	163,186.11	0.01
69	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
70	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
71	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.01
72	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
73	688229	博睿数据	1,643	124,424.39	0.01

74	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.01
75	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
76	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
77	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
78	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
79	688577	浙海德曼	1,503	77,675.04	0.01
80	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
81	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
82	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
83	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.01
84	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
85	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
86	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
87	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
88	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
89	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
90	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
91	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
92	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
93	300981	中红医疗	489	44,200.71	0.00
94	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
95	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
96	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
97	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
98	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
99	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
100	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
101	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
102	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
103	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
104	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
105	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
106	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
107	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
108	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
109	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
110	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
111	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
112	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
113	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
114	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
115	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
116	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
117	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00

118	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
119	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
120	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
121	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
122	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
123	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
124	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
125	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
126	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
127	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
128	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
129	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
130	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
131	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
132	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
133	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
134	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
135	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
136	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
137	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
138	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
139	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
140	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
141	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
142	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
143	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
144	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
145	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	18,748,372.22	1.66
2	002594	比亚迪	13,166,616.12	1.17
3	002812	恩捷股份	13,018,050.00	1.16
4	300363	博腾股份	12,902,481.00	1.15
5	300760	迈瑞医疗	11,978,339.00	1.06
6	603501	韦尔股份	11,710,473.84	1.04
7	688111	金山办公	11,644,271.74	1.03

8	002415	海康威视	11,272,990.84	1.00
9	300750	宁德时代	11,089,552.00	0.98
10	603259	药明康德	10,177,249.20	0.90
11	002241	歌尔股份	9,414,368.00	0.84
12	601012	隆基股份	9,367,827.87	0.83
13	300347	泰格医药	9,337,372.68	0.83
14	603290	斯达半导	9,302,541.44	0.83
15	300223	北京君正	8,247,149.00	0.73
16	300759	康龙化成	6,976,382.00	0.62
17	300595	欧普康视	6,881,008.40	0.61
18	300782	卓胜微	5,774,195.00	0.51
19	600763	通策医疗	5,763,574.47	0.51
20	300014	亿纬锂能	4,651,282.04	0.41

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	300124	汇川技术	4,928,753.00	0.44
2	002025	航天电器	4,918,506.00	0.44
3	300601	康泰生物	4,491,447.96	0.40
4	300699	光威复材	3,702,620.00	0.33
5	603501	韦尔股份	3,229,390.00	0.29
6	601012	隆基股份	2,396,982.00	0.21
7	603986	兆易创新	2,283,920.00	0.20
8	002475	立讯精密	2,114,616.54	0.19
9	300896	爱美客	1,959,907.00	0.17
10	600905	三峡能源	1,789,584.00	0.16
11	300750	宁德时代	1,541,464.00	0.14
12	300014	亿纬锂能	1,290,386.00	0.11
13	601995	中金公司	1,143,582.15	0.10
14	688036	传音控股	1,119,386.03	0.10
15	300408	三环集团	1,110,728.00	0.10
16	688819	天能股份	1,056,963.60	0.09
17	002206	海利得	1,032,256.00	0.09
18	000157	中联重科	1,030,396.00	0.09
19	002709	天赐材料	977,281.00	0.09
20	300347	泰格医药	911,491.00	0.08

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	262,856,721.22
卖出股票的收入（成交）总额	76,124,768.33

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,060,000.00	0.84
	其中：政策性金融债	10,060,000.00	0.84
4	企业债券	437,009,500.00	36.64
5	企业短期融资券	80,371,000.00	6.74
6	中期票据	201,713,000.00	16.91
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	729,153,500.00	61.14

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	112413	16 兴蓉 01	900,000	90,063,000.00	7.55
2	102001129	20 中国中药 MTN001	900,000	90,000,000.00	7.55
3	101801149	18 中电国际 MTN001	600,000	60,600,000.00	5.08

4	1980190	19 广铁绿色债 02	500,000	50,635,000.00	4.25
5	155263	19 国科 01	500,000	50,405,000.00	4.23

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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	23,079.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,550,029.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,573,108.73

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投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例
78,161	12,647.81	206,290,165.45	20.87%	782,275,116.04	79.13%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国泰君安证券股份有限公司	29,968,762.51	3.03%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅十三号证券投资私募基金	26,074,803.00	2.64%
3	中国人寿保险股份有限公司	22,938,972.00	2.32%
4	中国工商银行股份有限公司—兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	14,255,305.00	1.44%
5	中信证券信安盈利混合型养老金产品—中信银行股份有限公司	9,294,500.00	0.94%
6	民生通惠资管—工商银行—民生通惠聚鑫 16 号资产管理产品	7,759,410.00	0.78%
7	中信证券—建设银行—中信证券鑫盛 1 号集合资产管理计划	7,336,325.00	0.74%
8	兴证全球基金—建设银行—兴全—建信理财 1 号 FOF 集合资产管理计划	6,999,908.00	0.71%
9	兴证全球基金—广东顺德农村商业银行股份有限公司—兴全—顺德农商行 1 号 FOF 单一	6,365,839.00	0.64%
10	招商财富资管—建设银行—招商财富—鑫鹏 1 号集合资产管理计划	5,775,827.00	0.58%

8.3 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	130,789.45	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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（2019 年 6 月 11 日）基金份额总额	988,565,281.49
本报告期期初基金份额总额	988,565,281.49
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	988,565,281.49

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：

无。

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 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	1	139,500,850.21	42.78%	127,127.52	42.47%	-
东北证券	1	90,392,602.22	27.72%	84,182.74	28.13%	-
长江证券	2	69,792,742.97	21.40%	63,602.12	21.25%	-
方正证券	3	8,451,251.70	2.59%	7,701.55	2.57%	-
招商证券	3	8,144,140.35	2.50%	7,584.58	2.53%	-
兴业证券	1	3,994,112.21	1.22%	3,719.72	1.24%	-
银河证券	1	2,420,586.00	0.74%	2,254.30	0.75%	-
天风证券	2	1,528,100.96	0.47%	1,423.13	0.48%	-
广发证券	1	1,229,651.01	0.38%	1,145.20	0.38%	-
国盛证券	1	474,036.56	0.15%	441.47	0.15%	-
中信建投	2	141,729.00	0.04%	131.99	0.04%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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：

2021 年 3 月完成租用托管在建设银行的中信建投证券上交所 49968 交易单元。

2021 年 6 月完成托管在建设银行的申万宏源深交所 278300 交易单元退租。

10.7.2 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		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
国泰君安证券	88,181.00	0.17%	-	-	-	-
东北证券	50,250,729.32	99.57%	2,000,000.00	0.84%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	33,000,000.00	13.92%	-	-
兴业证券	-	-	57,000,000.00	24.05%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	66,000,000.00	27.85%	-	-
广发证券	130,851.60	0.26%	54,000,000.00	22.78%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	25,000,000.00	10.55%	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销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	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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	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
6	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合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指定媒介	2021-03-06
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	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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	2021-03-10
9	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(2021 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-10
10	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
11	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型	中国证监会基金电子披	2021-03-30

	证券投资基金 2020 年年度报告	露网站和公司网站等指定媒介	
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（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
13	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
14	华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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
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（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
16	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（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
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（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
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合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；

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