

华安低碳生活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	12
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	15
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合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
9	开放式基金份额变动	53
10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
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	56
10.9	其他重大事件	57
11	备查文件目录	58
11.1	备查文件目录	58
11.2	存放地点	58
11.3	查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安低碳生活混合型证券投资基金
基金简称	华安低碳生活混合
基金主代码	006122
交易代码	006122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 12 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	232,903,284.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。 本基金所指“低碳生活”投资主线重点关注节能环保、绿色消费、新能源与新材料、新能源汽车等行业和主线。 对于低碳生活相关股票，本基金将采用定量与定性相结合的研究方法进行投资。在定性研究方面主要采用 ESG（即环境 Environment、社会 Society 和公司治理 Governance 的简称）投资理念进行筛选，重点关注上市公司在环境友好、社会责任和公司治理等方面的实际履行情况。 在定量研究方面，本基金基于公司财务指标分析公司的基本面价值，选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。具体的考察指标包括成长性指标（主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流）、盈利指标（毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率）等指标。结合相关财务模型的分析，形成对标的股票的初步判断。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	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	47,926,480.75
本期利润	80,799,615.06
加权平均基金份额本期利润	0.3201
本期加权平均净值利润率	13.58%
本期基金份额净值增长率	16.01%
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	252,379,362.18

期末可供分配基金份额利润	1.0836
期末基金资产净值	626,535,547.19
期末基金份额净值	2.6901
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	169.01%

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	10.32%	1.93%	-1.03%	0.59%	11.35%	1.34%
过去三个月	24.04%	1.62%	3.52%	0.67%	20.52%	0.95%
过去六个月	16.01%	1.82%	1.92%	0.93%	14.09%	0.89%
过去一年	54.95%	1.85%	17.93%	0.97%	37.02%	0.88%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	169.01%	1.62%	25.76%	1.00%	143.25%	0.62%

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

华安低碳生活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 3 月 12 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		
李欣	本基金的基金	2019-03-1	-	11 年	硕士研究生，11 年证券、基金从

	经理	2			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，历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。
--	----	---	--	--	---

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

报告期内，全球经济整体而言进一步从疫情中恢复，经济活动趋于正常增长的同时，生产端由于产业链的复杂与绵长带来的脆弱性，以及洲际运输并未完全恢复，从而产生供需剪刀差；叠加疫情期间西方主要经济体的货币超发现象，引发全球通胀压力上行，出现了商品的牛市，钢铁、采掘、化工等行业上涨显著；另一方面，很多成长性行业尤其是信息产品消费、新能源车消费、健康消费等呈现出高增长亮点，中美两国长端利率在上半年均走出先涨后跌的走势，为成长股的结构行情提供了条件。在钢铁、采掘、化工等行业走势较强的同时，以新能源车和新能源发电为主要驱动的电气设备、汽车行业，和以 AIOT（人工智能物联网）和新能源智能网联车等新需求驱动的电子行业，以及以健康消费和医药外包服务等驱动的医药生物行业也有较好表现。上半年的结构性市场走势既体现出全球经济处于复苏期的状况，也体现出我国处于经济结构升级转型期的时代特征，反映出这些行业在近期的技术进步和商业化进展。

本基金在综合考虑宏观和流动性因素的基础上，重点研究、分析、跟踪了信息、能源、健康等领域的行业和公司的基本面发展变化，亦对受益于经济复苏与通胀的行业进行了研究与配置，同时也考虑了基金合同对配置方向的约束与强调，综合以上因素遴选优质标的进行配置。报告期内我们注意到半导体行业出现了比以往更加显著的投资机会。在需求侧，AIOT 和智能网联车对控制芯片（SOC、MCU 等）、连接与传输芯片（wifi、蓝牙等无线传输以及各类有线连接的接口芯片）、存储芯片、各类传感器的需求大增，新能源车和光伏风电以及消费电子的快充等应用对功率半导体的需求大增；在供给侧，物联网和车载对成熟和特色工艺制程的产能有很大需求，而此类产能扩产所需设备的供应却长期不足，同时先进工艺扩产的进度在一定程度上也受到海外非市场因素的影响。新能源车处于渗透率提升速度快并且空间大的产业甜蜜期，投资价值显著。医药和新兴消费行业也显示出良好的增长态势和投资机会。本基金在确定投资标的和投资比例时，也会参考基金合同中对投资方向的相关表述。

在本基金的操作中，注重以低碳、环保、健康、节能等环境友好与生活健康的标准对投资标的进行衡量和筛选；也注重将 ESG（环境 Environment、社会 Society 和治理 Governance）的投资理念贯彻进投资组合的构建过程中。基金经理注重学习和借鉴各类 ESG 研究和 ESG 指数制定机构对 ESG 概念的全面、深入理解，并用于对投资的指导。

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 2.6901 元，本报告期份额净值增长率为 16.01%，同期业绩比较基准增长率为 1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为，今后相当长的一段时间内，我国经济发展的主基调是结构升级调整与补短板，体现在几个方面：继续以信息化和自动化带动制造业产业结构调整，提升在全球产业链的价值分配地位，尤其是对半导体、关键材料等短板产业重点攻关；在碳达峰、碳中和的政策指引下，继续推动发电端的光伏风电、用电端的新能源车等新能源产业的发展，并以新能源产业为契机和抓手，实现我国在汽车、机电、化工等领域相对于全球先进水平的弯道超车；抓住生物创新药、细胞基因疗法等生物医药领域的创新浪潮，实现医药行业全球竞争力的快速提升，满足人民群众对健康和生活品质的需求；以移动互联网、优质高效工业化供应链为基础设施，发展新消费，满足多样化需求，树立中国品牌；等等。

基于对我国当前经济发展主基调是产业结构调整与升级的认知，我们持续在三大赛道上进行长期深入的研究与投资：信息产业，包括半导体、消费电子、互联网等；能源产业，包括新能源车、光伏、风电等；健康产业，包括创新药、医疗器械、医疗服务等。

信息产业方面，我们认为，半导体产业的机遇不仅在于供不应求带来的产业景气以及价格等直观表现形式，更在于为有准备的优秀企业提供了加速弯道超车的机会，使得他们得以在此供需失衡的产业环境下加速导入新客户、新产品、增强产业链掌控能力。从全球半导体供需状况来看，我们认为行业景气的持续时间很有可能比市场预期的更持久。从供给端来看，全球代工龙头公司的主要扩产方向是适用于高性能计算和核心处理器的高端制程，对于 AIOT（人工智能物联网）终端、电源管理、传感器芯片等特色应用的需求存在缺口，中国大陆龙头代工厂的扩产进度受到海外非市场因素的影响，行业供给的相对紧缺在一个时期内都是存在的；从需求端来看，新能源车、智能网联汽车、AIOT 等新应用对于半导体产生了快速而持续的增长推动力，供需对比支持半导体行业景气的持续。

我们认为，当前尤其应当重视 AIOT 对于半导体等产业环节的推动作用。AIOT 相对于智能手机，具有多样、长尾、泛在的特征。我们认为消费电子终端的发展具有“分久必合，合久必分”的规律，从 2007 年 iPhone 发布到 2020 年是智能手机的时代，几乎所有其他电子终端的功能都被聚合进智能手机这一“超级终端”，这是“合”的周期；但当智能手机的承载能力发展到相对饱和的程度以后，各种创新功能逐渐分化成为多样化的智能终端，即 AIOT，包括 VR、AR、MR 等信息交互产品，智能手写本、智能会议硬件等工作辅助产品，智能扫地机器人等家居产品，以及基于人工智能和机器视

觉的安全、工业、商业管理系统等，疫情后的 WFH（work from home）催化和加速了这一“分”的进程。历史上看，PC 作为桌面互联网时代的“超级终端”，也曾经承担了聚合世纪之交的诸多电子创新功能的角色，而 PC 成熟之后、智能手机崛起之前的几年，是上一个电子终端产品多样化发展的“合久必分”的时代。

我们认为，中国半导体行业在 AIOT 时代有相对于智能手机时代更好的竞争机会。AIOT 所具有的快速迭代、市场导向、多样化个性化的特点，非常匹配中国供应链的竞争特质和资源禀赋。

能源产业方面，我们关注在电能的产生、传输、利用环节能够满足低碳、零碳要求的产业，目前阶段主要产品形态是新能源汽车、光伏、风电等。新能源车正处于渗透率尚低，但技术、供应链、产品、使用环境都已成熟的关键时间点，产业长期高速增长可期。在新能源车产业链中，我们看好几类产业环节：第一是对下游具有信息不对称，能够为整车提供安全和品质背书的产业环节，如品质控制节点众多的复杂电化学系统--电池；第二是需求弹性大、工艺壁垒高、自身扩产周期和下游增长节奏匹配的电池中上游材料；第三是电控相关的被动器件，能够借助新能源车这一产业机遇实现对欧日竞争对手的弯道超车，后者的竞争力和品牌力往往是建立在工控、家电等相对成熟的行业领域之上。

新能源车天然的和智能化、网联化相关联，因为相较于热机驱动，电机驱动可以直接和数字信号控制对接。我们认为，智能汽车产业的生态系统，相较于智能手机更加多样性，两个领域的全球龙头均以软硬件一体、垂直整合的方式保持消费者体验的领先，但智能汽车发展于全球 ICT（信息与通信技术）产业已经相对发达、中国内源性创新层出不穷的时代，将智能化作为重要竞争点是“造车新势力”和传统车厂的产业共识。在系统层面，我们看好 ICT 能力强的 tier1 厂商，他们能够契合汽车控制方案从分布式控制发展到域控制再到中央集中控制的产业趋势；在器件层面，我们看好信息的采集层（摄像头、激光雷达等）、传输层、处理层相关器件的需求放量，尤其是，我们注意到目前的人工智能主要基于深度学习，其精度的提升有赖于模型层数的增多（深度更深）、参数的增加（更加细致的刻画视觉信息特征）、算法的优化，因此不仅对 GPU、NPU 等运算处理单元，也对 DRAM 等存储器件的需求有巨大的增长空间。

医药健康方面，我们认为，目前是生物技术在医药领域应用快速普及的时期。业界对于既有靶点和新靶点的认知和探索都在不断深化，对于药物结构、合成工艺、药效药理的研究也在不断深入，这些都在加速疗效更好、靶向性更强、副作用更小的创新药的推出。同时，我国具有医学、生物、化学、电子、机电等相关领域的专业人才红利，也拥有技术和管理水平先进、配套齐全的化工、机电等相关产业链，具有发展创新药、医疗器械、医疗服务等行业的优良土壤。2020 年疫情以来，全球对疫苗的大量需求，以及各种创新药在研发和生产端快速向我国进行产能转移的趋势，进一步推

动了我国的 CRO 和 CDMO 产业发展。我们关注创新药相关上市公司在小分子创新药、单抗、双抗、ADC（抗体药物偶联物）、CGT（细胞和基因疗法）等领域的管线布局、试验评审与商业化进程，寻找长期成长性好的公司。我们同样看好医疗器械、医疗服务等领域的投资机会。

我们也看好消费、军工以及竞争环境明显改善的传统产业等投资方向，限于篇幅原因，就不一一展开了。

我们认为，投资应当反映产业中正在或将要发生的变革与进步，希望努力做到：从产业中来，到投资中去。在对产业的研究中，我们努力做到三个方面：第一是努力通过专业和细致的研究缩小研究的颗粒度，提高投资在空间（细分行业和公司的选择）和时间（投资节奏应匹配产业节奏）上的精确度；第二是注重产业链研究，在上下游和相关行业间进行交叉验证；第三是以长远视角看待 α 和 β 的关系， β （例如供需失衡带来的涨价）是过程， α （例如利用供需失衡的非正常产业环境加速导入新客户、新产品，并建立供应链壁垒，抬高长期发展曲线）才是目的。

本基金在投资标的选择上，首选具有长期成长能力的成长股，重点考核衡量成长空间的“渗透率”因素，包括行业渗透率和公司在行业的渗透率（市占率），以及衡量公司持续盈利能力的“定价权”因素。

“渗透率”表征行业所处的生命周期，其绝对值对应新业务收入，其斜率对应增速。相对于基本面和估值体系都充满变数的“成长早期”和估值下滑的“成熟期”，处于“高速成长期”的公司是我们重点投资的对象，其新业务的规模、增速、竞争力达到均衡。优秀公司有能力持续跨越多个新产品周期。

而“定价权”不仅是消费股的重要考量因素，也是研究科技等各类成长股的重要指标。“定价权”表征了公司对供应链的议价能力、对客户的产品定义能力、相对于竞争对手的护城河宽度，科技成长股的定价权往往来自于这几个方面：经营生态系统、引领行业标准、规模成本优势。财务报表质量往往是企业定价权的体现。

关于投资方向，管理人注重对基金合同的全面、深入的理解和把握。基金合同中指出，本基金所指的“低碳生活”是指低碳、环保、健康、节能等环境友好与健康的生活方式的统称。“低碳生活”依托节能环保、新一代信息技术、工业制造、生物医药等先进技术，为人们提供更加低碳、环保和健康的产品及服务，全面提升人们在衣、食、住、行、健康、教育、运动、娱乐等物质生活和精神生活方面的质量。基金经理注重学习和借鉴各类 ESG 研究和 ESG 指数制定机构对 ESG 概念的全面、深入理解，力求更加全面、精准的把握 ESG 投资的涵义，并用于帮助不断投高投资业绩。

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的真实、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：华安低碳生活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	56,172,502.38	63,043,954.89
结算备付金		200,668.29	1,648,981.90
存出保证金		253,370.44	6,279,580.69
交易性金融资产	6.4.7.2	580,271,428.34	550,774,792.95
其中：股票投资		579,495,369.89	550,423,993.17
基金投资		-	-
债券投资		776,058.45	350,799.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	5,916,531.23
应收利息	6.4.7.5	7,027.84	6,993.92
应收股利		-	-
应收申购款		6,854,112.11	2,032,066.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		643,759,109.40	629,702,902.54
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		1,602,455.58	21,502,429.14
应付赎回款		13,629,484.15	7,022,048.98

应付管理人报酬		707,770.37	711,197.71
应付托管费		117,961.76	118,532.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,042,924.87	2,738,089.64
应交税费		2.02	0.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	122,963.46	191,553.50
负债合计		17,223,562.21	32,283,852.37
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	232,903,284.73	257,631,472.29
未分配利润	6.4.7.10	393,632,262.46	339,787,577.88
所有者权益合计		626,535,547.19	597,419,050.17
负债和所有者权益总计		643,759,109.40	629,702,902.54

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.6901 元，基金份额总额 232,903,284.73 份。

6.2 利润表

会计主体：华安低碳生活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		89,998,393.01	60,607,303.63
1.利息收入		148,393.80	101,770.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	148,128.37	100,038.34
债券利息收入		265.43	1,731.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		55,444,431.49	46,278,534.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	53,591,030.54	45,818,426.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-2,922.76
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	1,853,400.95	463,031.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.15	32,873,134.31	13,647,067.19

填列)			
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	1,532,433.41	579,931.51
减: 二、费用		9,198,777.95	2,385,251.84
1. 管理人报酬		4,447,142.46	1,190,007.32
2. 托管费		741,190.47	198,334.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	3,906,392.98	895,022.70
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.99	-
7. 其他费用	6.4.7.18	104,051.05	101,887.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		80,799,615.06	58,222,051.79
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		80,799,615.06	58,222,051.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安低碳生活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)	257,631,472.29	339,787,577.88	597,419,050.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	80,799,615.06	80,799,615.06
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)	-24,728,187.56	-26,954,930.48	-51,683,118.04
其中: 1.基金申购款	180,648,253.77	258,145,894.78	438,794,148.55
2.基金赎回款	-205,376,441.33	-285,100,825.26	-490,477,266.59
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)	232,903,284.73	393,632,262.46	626,535,547.19
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）	131,906,813.20	33,168,084.32	165,074,897.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,222,051.79	58,222,051.79
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）	23,772,679.56	23,206,316.24	46,978,995.80
其中：1.基金申购款	148,812,273.67	71,060,348.79	219,872,622.46
2.基金赎回款	-125,039,594.11	-47,854,032.55	-172,893,626.66
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）	155,679,492.76	114,596,452.35	270,275,945.11

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

华安低碳生活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[2018]第 959 号《关于准予华安低碳生活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《华安低碳生活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 739,227,753.48 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 0141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安低碳生活混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 739,531,003.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 303,250.20 份基金份额。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安低碳生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、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)。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%;投资于低碳生活相关证券不低于非现金基金资产的 80%;港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等;权证、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。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合全价指数收益率×20%。

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》、《华安低碳生活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于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	56,172,502.38
定期存款	-
其他存款	-
合计	56,172,502.38

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		467,025,224.43	579,495,369.89	112,470,145.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	553,100.00	776,058.45	222,958.45
	银行间市场	-	-	-
	合计	553,100.00	776,058.45	222,958.45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		467,578,324.43	580,271,428.34	112,693,103.91

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

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	5,041.03
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	1,593.41
应收债券利息	296.38
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	97.02
合计	7,027.84

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	1,042,924.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,042,924.87

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	33,703.31
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
合计	122,963.46

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	257,631,472.29	257,631,472.29
本期申购	180,648,253.77	180,648,253.77
本期赎回（以“-”号填列）	-205,376,441.33	-205,376,441.33
本期末	232,903,284.73	232,903,284.73

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	229,858,725.30	109,928,852.58	339,787,577.88
本期利润	47,926,480.75	32,873,134.31	80,799,615.06
本期基金份额交易产生的变动数	-25,405,843.87	-1,549,086.61	-26,954,930.48
其中：基金申购款	195,131,348.53	63,014,546.25	258,145,894.78
基金赎回款	-220,537,192.40	-64,563,632.86	-285,100,825.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	252,379,362.18	141,252,900.28	393,632,262.46

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	97,118.72
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	41,683.92
其他	9,325.73
合计	148,128.37

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	1,247,234,805.48
减：卖出股票成本总额	1,193,643,774.94
买卖股票差价收入	53,591,030.54

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 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	1,853,400.95
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,853,400.95

6.4.7.15 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	32,873,134.31
——股票投资	32,692,875.64
——债券投资	180,258.67

——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	32,873,134.31

6.4.7.16 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	1,436,229.94
转换费收入	96,203.47
合计	1,532,433.41

6.4.7.17 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	3,906,392.98
银行间市场交易费用	-
合计	3,906,392.98

6.4.7.18 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,430.90
账户维护费	9,000.00
其他费用	360.00
合计	104,051.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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（“国泰君安”）	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 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	1,385,832,497.56	57.04%	17,314,243.32	3.08%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
国泰君安	245,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 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	1,143,873.13	54.38%	83,267.55	7.98%
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	13,212.41	2.71%	13,212.41	2.71%

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	4,447,142.46	1,190,007.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1,571,991.33	595,874.04

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	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的托管费	741,190.47	198,334.57

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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

无。

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 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	
	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	56,172,502.38	97,118.72	50,954,294.81	89,799.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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	3,137.00	114,600.10
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

				股/张)	
--	--	--	--	------	--

6.4.11 利润分配情况

无。

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
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股限售	28.82	104.16	3,521.00	101,475.22	366,747.36	-
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	29.53	129.46	1,687.00	49,817.11	218,399.02	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-12-07	新股限售	16.48	42.63	2,672.00	44,034.56	113,907.36	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	新股限售	14.80	32.09	3,435.00	50,838.00	110,229.15	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	384.00	18,174.72	96,752.64	-
688628	优利德	2021-01-22	2021-08-02	新股限售	19.11	32.62	2,789.00	53,297.79	90,977.18	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股限售	16.49	37.79	1,499.00	24,718.51	56,647.21	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	509.00	16,908.98	44,537.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股限售	28.28	115.71	282.00	7,974.96	32,630.22	-
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	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	241.00	11,710.19	21,783.99	-
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	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
30098	苏文	2021-0	2021-1	新股	15.83	45.29	317.00	5,018.	14,356	-

2	电能	4-19	0-27	限售				11	.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	-
30092	博俊	2020-1	2021-0	新股	10.76	22.20	359.00	3,862.	7,969.	-

6	科技	2-29	7-12	限售				84	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	-
301022	英诺	2021-06-09	2022-01-05	新股	9.46	9.46	290.00	2,743.00	2,743.00	-

1	激光	6-28	1-06	限售				40	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	-
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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项或临时停牌	56.35	2021-07-01	59.49	75,200.00	2,784,658.00	4,237,520.00	-

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 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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同责任, 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	56,172,502.38	-	-	-	56,172,502.38
结算备付金	200,668.29	-	-	-	200,668.29
存出保证金	253,370.44	-	-	-	253,370.44

交易性金融资产	776,058.45	-	-	579,495,369.89	580,271,428.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,027.84	7,027.84
应收申购款	-	-	-	6,854,112.11	6,854,112.11
资产总计	57,402,599.56	-	-	586,356,509.84	643,759,109.40
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	-	-	-	1,602,455.58	1,602,455.58
应付赎回款	-	-	-	13,629,484.15	13,629,484.15
应付管理人报酬	-	-	-	707,770.37	707,770.37
应付托管费	-	-	-	117,961.76	117,961.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,042,924.87	1,042,924.87
应交税费	-	-	-	2.02	2.02
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	122,963.46	122,963.46
负债总计	-	-	-	17,223,562.21	17,223,562.21
利率敏感度缺口	57,402,599.56	-	-	569,132,947.63	626,535,547.19
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	63,043,954.89	-	-	-	63,043,954.89
结算备付金	1,648,981.90	-	-	-	1,648,981.90
存出保证金	6,279,580.69	-	-	-	6,279,580.69
交易性金融资产	350,799.78	-	-	550,423,993.17	550,774,792.95
应收证券清算款	-	-	-	5,916,531.23	5,916,531.23

应收利息	-	-	-	6,993.92	6,993.92
应收申购款	-	-	-	2,032,066.96	2,032,066.96
资产总计	71,323,317.26	-	-	558,379,585.28	629,702,902.54
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	-	-	-	21,502,429.14	21,502,429.14
应付赎回款	-	-	-	7,022,048.98	7,022,048.98
应付管理人报酬	-	-	-	711,197.71	711,197.71
应付托管费	-	-	-	118,532.96	118,532.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,738,089.64	2,738,089.64
应交税费	-	-	-	0.44	0.44
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	191,553.50	191,553.50
负债总计	-	-	-	32,283,852.37	32,283,852.37
利率敏感度缺口	71,323,317.26	-	-	526,095,732.91	597,419,050.17

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.12%(2020 年 12 月 31 日：0.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	101,933,760.70	101,933,760.70
资产合计	-	101,933,760.70	101,933,760.70
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	101,933,760.70	101,933,760.70
项目	上年度末 2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	133,791,454.09	133,791,454.09
资产合计	-	133,791,454.09	133,791,454.09
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	133,791,454.09	133,791,454.09

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一汇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	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 510	增加约 669
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 510	减少约 669

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占基金资产的比例为 60-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时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		上年度末	
	2021 年 6 月 30 日		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	579,495,369.89	92.49	550,423,993.1	92.13

			7	
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	579,495,369.89	92.49	550,423,993.17	92.13

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 5,047	增加约 4,374
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,047	减少约 4,374

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	579,495,369.89	90.02
	其中：股票	579,495,369.89	90.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	776,058.45	0.12
	其中：债券	776,058.45	0.12
	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	56,373,170.67	8.76
8	其他各项资产	7,114,510.39	1.11
9	合计	643,759,109.40	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 101,933,760.70 人民币，占期末净值比例 16.27%。

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	87,114.38	0.01
B	采矿业	3,248,059.35	0.52
C	制造业	392,044,169.21	62.57
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	494,474.26	0.08
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	68,003,454.99	10.85
J	金融业	5,480,875.64	0.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,507,226.29	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	657,843.31	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	477,561,609.19	76.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
工业	5,698,316.82	0.91
非日常生活消费品	2,569,862.44	0.41
医疗保健	23,079,527.77	3.68
信息技术	70,586,053.67	11.27
合计	101,933,760.70	16.27

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	01347	华虹半导体	883,000	31,519,772.86	5.03
2	00981	中芯国际	1,522,500	30,277,519.02	4.83
3	603501	韦尔股份	91,427	29,439,494.00	4.70
4	603893	瑞芯微	193,800	27,027,348.00	4.31
5	688699	明微电子	87,601	24,994,317.32	3.99
6	300223	北京君正	233,600	23,574,912.00	3.76
7	300782	卓胜微	42,944	23,082,400.00	3.68
8	02269	药明生物	192,500	22,792,959.42	3.64
9	300613	富瀚微	142,992	22,289,592.96	3.56
10	300750	宁德时代	41,100	21,980,280.00	3.51
11	688595	芯海科技	238,660	20,994,920.20	3.35
12	688036	传音控股	82,314	17,244,783.00	2.75
13	688200	华峰测控	34,336	16,252,258.88	2.59
14	002920	德赛西威	140,800	15,499,264.00	2.47
15	002214	大立科技	771,000	14,756,940.00	2.36
16	300014	亿纬锂能	136,400	14,176,052.00	2.26
17	603068	博通集成	170,700	14,048,610.00	2.24
18	300724	捷佳伟创	120,500	13,979,205.00	2.23
19	688608	恒玄科技	43,595	13,815,691.45	2.21
20	688018	乐鑫科技	57,049	13,316,377.58	2.13
21	002236	大华股份	608,821	12,846,123.10	2.05
22	002415	海康威视	198,200	12,783,900.00	2.04
23	300769	德方纳米	56,100	11,595,309.00	1.85
24	688022	瀚川智能	284,099	11,446,348.71	1.83

25	688286	敏芯股份	80,308	11,193,329.04	1.79
26	002241	歌尔股份	224,500	9,595,130.00	1.53
27	600519	贵州茅台	4,549	9,355,928.30	1.49
28	01810	小米集团－W	391,200	8,788,761.79	1.40
29	300327	中颖电子	79,100	6,741,693.00	1.08
30	603259	药明康德	40,920	6,407,662.80	1.02
31	688508	芯朋微	55,282	6,116,400.48	0.98
32	03898	中车时代电气	149,200	5,698,316.82	0.91
33	603290	斯达半导	17,400	5,568,000.00	0.89
34	605111	新洁能	30,769	5,546,727.63	0.89
35	300059	东方财富	160,272	5,255,318.88	0.84
36	600460	士兰微	75,200	4,237,520.00	0.68
37	600563	法拉电子	21,600	3,420,576.00	0.55
38	300911	亿田智能	46,700	3,235,376.00	0.52
39	600348	华阳股份	427,400	3,171,308.00	0.51
40	01478	丘钛科技	194,000	2,569,862.44	0.41
41	300034	钢研高纳	53,800	1,732,898.00	0.28
42	605336	帅丰电器	42,201	1,135,206.90	0.18
43	300957	贝泰妮	3,835	1,034,354.83	0.17
44	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.11
45	300316	晶盛机电	11,725	592,112.50	0.09
46	688680	海优新材	2,269	583,133.00	0.09
47	300979	华利集团	5,085	565,743.90	0.09
48	688083	中望软件	998	551,195.40	0.09
49	688063	派能科技	2,277	448,113.60	0.07
50	300973	立高食品	2,814	425,090.22	0.07
51	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.07
52	688626	翔宇医疗	3,521	366,747.36	0.06
53	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.05
54	688276	百克生物	3,137	328,067.46	0.05
55	688161	威高骨科	2,937	311,468.85	0.05
56	00241	阿里健康	20,000	286,568.35	0.05
57	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.04
58	688630	芯碁微装	3,397	261,840.76	0.04
59	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
60	688660	电气风电	27,668	243,478.40	0.04
61	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.04
62	300896	爱美客	299	235,875.12	0.04
63	002527	新时达	29,200	222,212.00	0.04
64	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.03
65	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.03
66	688079	美迪凯	10,622	208,509.86	0.03
67	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.03
68	002025	航天电器	3,900	195,663.00	0.03

69	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.03
70	688183	生益电子	13,243	192,420.79	0.03
71	688093	世华科技	4,595	182,697.20	0.03
72	688315	诺禾致源	3,711	181,096.80	0.03
73	688609	九联科技	10,372	179,228.16	0.03
74	300614	百川畅银	3,283	176,700.30	0.03
75	688059	华锐精密	1,023	171,761.70	0.03
76	688221	前沿生物	8,074	170,522.88	0.03
77	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.03
78	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.03
79	688619	罗普特	5,856	161,040.00	0.03
80	301002	崧盛股份	2,001	159,001.62	0.03
81	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
82	688378	奥来德	2,411	155,750.60	0.02
83	301006	迈拓股份	5,051	154,055.50	0.02
84	688186	广大特材	4,016	137,025.92	0.02
85	300962	中金辐照	5,757	133,773.12	0.02
86	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.02
87	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.02
88	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.02
89	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.02
90	688667	菱电电控	1,191	131,021.91	0.02
91	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.02
92	688569	铁科轨道	6,841	127,653.06	0.02
93	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.02
94	300966	共同药业	2,858	126,586.56	0.02
95	688689	银河微电	3,258	121,165.02	0.02
96	688379	华光新材	4,950	120,483.00	0.02
97	300955	嘉亨家化	2,314	115,870.88	0.02
98	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
99	300895	铜牛信息	3,395	115,463.95	0.02
100	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.02
101	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.02
102	300880	迦南智能	4,478	113,562.08	0.02
103	688201	信安世纪	2,129	111,240.25	0.02
104	300918	南山智尚	10,626	110,616.66	0.02
105	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.02
106	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
107	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.02
108	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.02
109	605376	博迁新材	1,421	104,983.48	0.02
110	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.02
111	688177	百奥泰	3,933	103,201.92	0.02
112	688316	青云科技	1,428	102,102.00	0.02

113	688218	江苏北人	5,790	100,282.80	0.02
114	300993	玉马遮阳	4,097	99,899.55	0.02
115	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.02
116	688398	赛特新材	2,423	98,713.02	0.02
117	688636	智明达	918	97,583.40	0.02
118	688013	天臣医疗	3,022	96,401.80	0.02
119	300961	深水海纳	3,936	95,687.10	0.02
120	300952	恒辉安防	3,398	95,320.48	0.02
121	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.02
122	688662	富信科技	2,556	93,856.32	0.01
123	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.01
124	300945	曼卡龙	4,731	92,939.73	0.01
125	300948	冠中生态	3,229	92,867.63	0.01
126	688560	明冠新材	3,832	92,351.20	0.01
127	300893	松原股份	4,134	92,270.88	0.01
128	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.01
129	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01
130	300931	通用电梯	6,713	89,880.14	0.01
131	300881	盛德鑫泰	2,906	89,475.74	0.01
132	300950	德固特	2,186	89,334.49	0.01
133	300975	商络电子	4,917	88,140.51	0.01
134	688669	聚石化学	2,681	87,909.99	0.01
135	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.01
136	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.01
137	688070	纵横股份	2,407	87,085.26	0.01
138	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.01
139	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
140	300963	中洲特材	2,830	85,321.67	0.01
141	300985	致远新能	2,945	83,877.45	0.01
142	300967	晓鸣股份	5,061	81,674.88	0.01
143	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
144	603087	甘李药业	753	80,254.74	0.01
145	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
146	688590	新致软件	4,171	77,163.50	0.01
147	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
148	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
149	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
150	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
151	603899	晨光文具	700	59,192.00	0.01
152	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.01
153	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
154	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
155	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
156	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01

157	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
158	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
159	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
160	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
161	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
162	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
163	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
164	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
165	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
166	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
167	300981	中红医疗	241	21,783.99	0.00
168	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
169	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
170	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
171	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
172	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
173	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
174	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
175	300122	智飞生物	70	13,071.10	0.00
176	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
177	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
178	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
179	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
180	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
181	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
182	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
183	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
184	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
185	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
186	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
187	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
188	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
189	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
190	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
191	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
192	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	01347	华虹半导体	56,920,246.09	9.53
2	00700	腾讯控股	50,611,827.54	8.47
3	600519	贵州茅台	49,656,919.90	8.31
4	00981	中芯国际	40,818,483.79	6.83
5	300782	卓胜微	39,191,688.45	6.56
6	300122	智飞生物	32,597,238.02	5.46
7	02269	药明生物	32,048,611.40	5.36
8	603501	韦尔股份	30,296,131.43	5.07
9	603290	斯达半导	24,815,775.00	4.15
10	000725	京东方 A	23,810,582.00	3.99
11	002415	海康威视	23,583,720.20	3.95
12	688396	华润微	23,160,257.38	3.88
13	688008	澜起科技	21,828,256.13	3.65
14	688536	思瑞浦	21,445,602.37	3.59
15	603893	瑞芯微	20,951,346.51	3.51
16	002241	歌尔股份	20,900,944.49	3.50
17	600809	山西汾酒	20,647,553.28	3.46
18	06862	海底捞	19,545,168.71	3.27
19	300223	北京君正	17,865,189.00	2.99
20	002920	德赛西威	17,483,592.69	2.93
21	300750	宁德时代	17,258,002.14	2.89
22	01898	中煤能源	17,206,228.45	2.88
23	600138	中青旅	17,003,662.33	2.85
24	600019	宝钢股份	15,092,204.52	2.53
25	688595	芯海科技	14,930,418.77	2.50
26	600966	博汇纸业	14,279,099.68	2.39
27	601919	中远海控	13,986,712.62	2.34
28	688699	明微电子	13,577,493.66	2.27
29	00522	ASM PACIFIC	13,535,554.77	2.27
30	603068	博通集成	13,370,608.20	2.24
31	300724	捷佳伟创	12,880,326.73	2.16
32	688036	传音控股	12,590,916.27	2.11
33	688608	恒玄科技	12,321,418.02	2.06
34	002027	分众传媒	12,159,501.00	2.04

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	00700	腾讯控股	52,446,198.92	8.78
2	601888	中国中免	40,651,952.95	6.80
3	600519	贵州茅台	39,250,769.95	6.57
4	01347	华虹半导体	38,190,804.10	6.39
5	00981	中芯国际	36,538,992.58	6.12
6	300782	卓胜微	33,187,143.35	5.56
7	300122	智飞生物	32,721,104.00	5.48
8	688396	华润微	28,139,650.94	4.71
9	002241	歌尔股份	26,429,951.00	4.42
10	00175	吉利汽车	24,711,317.37	4.14
11	603290	斯达半导	24,230,661.04	4.06
12	600460	士兰微	23,479,661.03	3.93
13	00522	ASM PACIFIC	23,287,690.67	3.90
14	688536	思瑞浦	22,973,787.96	3.85
15	688567	孚能科技	22,765,892.07	3.81
16	002475	立讯精密	22,371,769.44	3.74
17	000725	京东方 A	22,176,003.67	3.71
18	002460	赣锋锂业	21,865,133.78	3.66
19	002415	海康威视	20,680,510.64	3.46
20	688008	澜起科技	20,669,679.86	3.46
21	603501	韦尔股份	20,062,813.40	3.36
22	300316	晶盛机电	19,244,259.00	3.22
23	01898	中煤能源	18,005,507.78	3.01
24	600138	中青旅	16,886,299.03	2.83
25	600966	博汇纸业	16,068,160.68	2.69
26	03690	美团-W	15,611,390.19	2.61
27	01810	小米集团-W	15,564,448.75	2.61
28	002202	金风科技	15,481,801.94	2.59
29	600809	山西汾酒	15,167,397.00	2.54
30	300750	宁德时代	14,603,677.49	2.44
31	600019	宝钢股份	14,471,284.52	2.42
32	06862	海底捞	14,175,337.61	2.37
33	01478	丘钛科技	13,063,963.90	2.19
34	03888	金山软件	12,752,657.62	2.13
35	300073	当升科技	12,510,689.35	2.09
36	601919	中远海控	12,488,175.12	2.09
37	300613	富瀚微	12,012,419.99	2.01

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	1,190,022,276.02
卖出股票的收入（成交）总额	1,247,234,805.48

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	776,058.45	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	776,058.45	0.12

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	123111	东财转 3	2,450	358,582.00	0.06
2	113616	韦尔转债	1,510	233,748.00	0.04
3	128136	立讯转债	1,571	183,728.45	0.03

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	253,370.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,027.84
5	应收申购款	6,854,112.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,114,510.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128136	立讯转债	183,728.45	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

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

60,263	3,864.78	12,584,690.59	5.40%	220,318,594.14	94.60%
--------	----------	---------------	-------	----------------	--------

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	926,624.78	0.40%

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（2019 年 3 月 12 日）基金份额总额	739,531,003.68
本报告期期初基金份额总额	257,631,472.29
本报告期基金总申购份额	180,648,253.77
减：本报告期基金总赎回份额	205,376,441.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	232,903,284.73

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	1	1,385,832,497.56	57.04%	1,143,873.13	54.38%	-
东北证券	1	401,558,087.75	16.53%	373,968.44	17.78%	-
天风证券	2	180,900,352.72	7.45%	168,102.99	7.99%	-
招商证券	3	105,887,894.58	4.36%	98,612.77	4.69%	-
兴业证券	1	101,546,614.41	4.18%	94,569.76	4.50%	-
广发证券	1	93,655,573.88	3.86%	87,221.11	4.15%	-
长江证券	2	78,099,420.83	3.21%	61,069.42	2.90%	-
银河证券	1	28,559,007.68	1.18%	26,597.34	1.26%	-
国盛证券	1	22,144,655.57	0.91%	20,623.67	0.98%	-
中信建投	2	21,659,438.02	0.89%	20,171.34	0.96%	-
方正证券	3	9,569,328.45	0.39%	8,720.48	0.41%	-
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	2	-	-	-	-	-

南)						
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

10.8.2 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
国泰君安证券	245,000.00	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

10.9 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	华安低碳生活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
7	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
8	华安低碳生活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
9	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
10	华安低碳生活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
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（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

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（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
13	华安低碳生活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
14	华安低碳生活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
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
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（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、《华安低碳生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安低碳生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安低碳生活混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安低碳生活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

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

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