

华安现代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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
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	48
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	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	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	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
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	54
10.9	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	57
11.3	查阅方式	57

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安现代生活混合型证券投资基金
基金简称	华安现代生活混合
基金主代码	008290
交易代码	008290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	406,436,605.06 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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率调整）×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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区复兴门内大街55

	世纪大道8号国金中心二期31 —32层	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	103,426,986.26
本期利润	34,551,534.23
加权平均基金份额本期利润	0.0724
本期加权平均净值利润率	4.67%
本期基金份额净值增长率	4.61%
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	222,868,732.69
期末可供分配基金份额利润	0.5483
期末基金资产净值	629,305,337.75
期末基金份额净值	1.5483
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	54.83%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

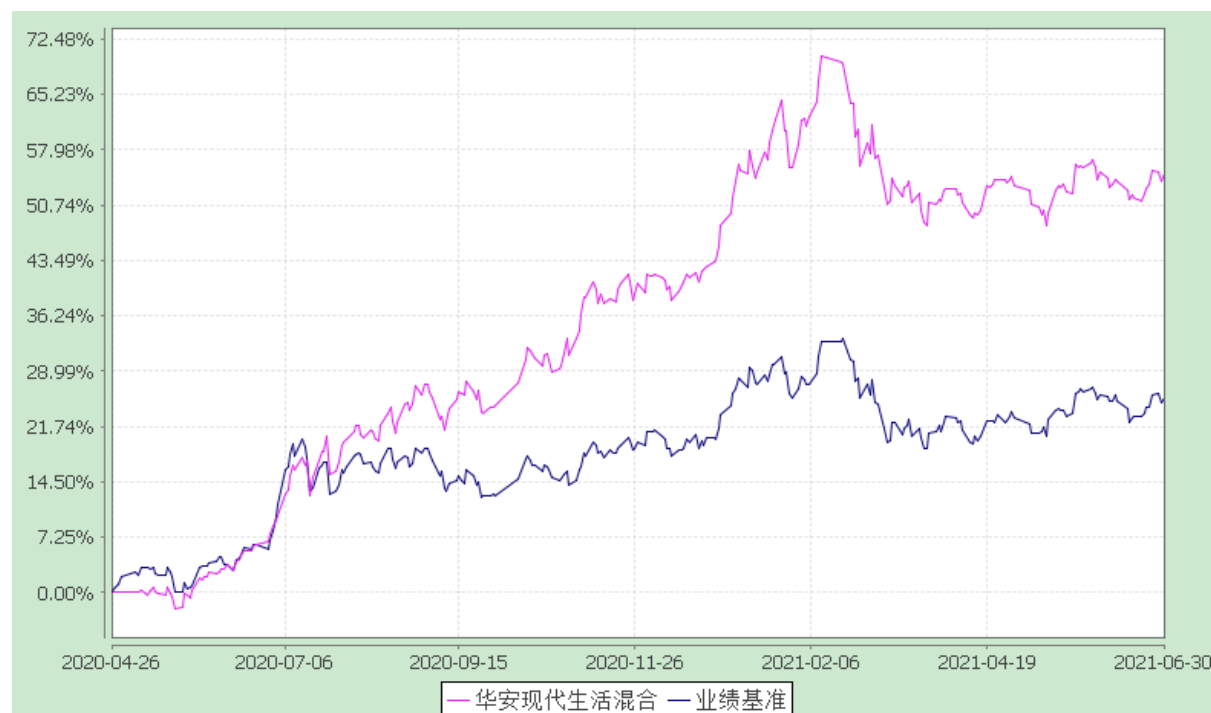
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.94%	0.62%	-0.89%	0.58%	-0.05%	0.04%
过去三个月	2.39%	0.76%	3.37%	0.67%	-0.98%	0.09%
过去六个月	4.61%	1.18%	1.80%	0.92%	2.81%	0.26%
过去一年	43.67%	1.17%	16.88%	0.96%	26.79%	0.21%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	54.83%	1.11%	25.41%	0.93%	29.42%	0.18%

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

华安现代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

（2020 年 4 月 26 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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2020-04-26	-	13 年	硕士，13 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月至 2020 年 5 月，同时担任华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起，同时担任华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安汇智精选两年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安现代生活混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月起，同时担任华安聚优精选混合型证券投资基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年上证指数上涨 3.4%，创业板指数上涨 17.22%。行业层面，化工、钢铁、电力设备、综合、煤炭、有色等涨幅靠前，非银金融、家电、军工、地产、农业等相对落后。

上半年市场整体震荡，但结构性机会较多。华安现代生活采取了相对保守的策略，2021 年上半年华安现代生活取得了 4.61% 的收益率。

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 1.5483 元，本报告期份额净值增长率为 4.61%，同期业绩比较基准增长率为 1.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年二季度，经济持续恢复，更多的行业逐步回到疫情前的正常状态。经济转型升级的动力进一步增强。展望未来，经济恢复和转型升级两个因素会持续存在。

去年疫情得到控制后，以制造业为主的工业领域恢复较快，为中国经济的稳定奠定了良好基础。局部疫情对经济的影响和人们生活的影响仍在持续，一些线下服务业恢复相对缓慢。疫苗的注射或群体免疫保障这些行业进一步恢复。另一方面，随着经济的持续恢复，需求回升，主要经济体的工

业产能利用率、库存逐步回到疫情前的水平，部分供给端的结构性因素又导致一些商品出现供需缺口。疫情以后，海外部分经济体采取了激进的货币政策，在经济复苏和供给端的共同作用下，宽松而暧昧的货币政策极易成为通胀的温床。

中国经济仍处于长期的转型期，高质量发展逐步成为主要方向。尽管面对激烈的国际竞争我们仍有需要补足的短板，但在一些制造业我们看到一批具备全球竞争优势的企业。过去他们在中国市场已经证明过自己，正逐步走向全球。随着转型升级的深入，中国市场的巨大容量和深度的潜力正逐步显现。

在此背景下，未来市场可能仍以结构性机会为主。在一季度震荡后市场风险快速回升。我们仍将把合理估值和公司质地放在重要的位置，放弃一些不符合我们收益风险要求的标的。短期看市场有很强的随机性，长期看，市场反映的是确定性。尽管选股难度较过去两年多有所加大，我们仍将客观评价各类投资机会，积极耐心寻找估值合理的优质公司、理解其成长逻辑、关注他们的能力建设，争取未来为持有人争取更好的收益。

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**

本报告期内，本基金托管人在对华安现代生活混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华安现代生活混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安现代生活混合型证券投资基金证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安现代生活混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安现代生活混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）**6.1 资产负债表**

会计主体：华安现代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	95,860,021.32	104,787,766.96
结算备付金		1,276,456.73	2,151,388.85
存出保证金		469,305.95	288,493.55
交易性金融资产	6.4.7.2	552,391,434.23	678,853,587.92

其中：股票投资		552,374,834.23	678,637,509.10
基金投资		-	-
债券投资		16,600.00	216,078.82
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		2,003,840.46	6,286,132.01
应收利息	6.4.7.5	9,059.98	10,646.49
应收股利		328,731.20	11,568.52
应收申购款		607,105.76	4,321,139.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		652,945,955.63	796,710,724.22
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		4,920,538.50	11,103,882.52
应付赎回款		15,659,353.96	10,354,861.89
应付管理人报酬		806,994.57	971,077.00
应付托管费		134,499.07	161,846.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,013,866.76	2,802,373.81
应交税费		-	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,365.02	178,375.00
负债合计		23,640,617.88	25,572,416.77
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	406,436,605.06	521,014,444.32
未分配利润	6.4.7.10	222,868,732.69	250,123,863.13
所有者权益合计		629,305,337.75	771,138,307.45
负债和所有者权益总计		652,945,955.63	796,710,724.22

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5483 元，基金份额总额 406,436,605.06 份。

6.2 利润表

会计主体：华安现代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 4 月 26 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		45,135,520.41	97,451,680.90
1.利息收入		229,211.73	632,681.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	229,198.18	488,567.17
债券利息收入		13.55	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	144,113.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		112,698,945.62	14,456,851.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	109,335,169.18	10,944,587.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	30,448.25	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,333,328.19	3,512,263.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-68,875,452.03	82,362,148.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,082,815.09	-
减：二、费用		10,583,986.18	5,854,424.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2	5,528,976.84	3,197,196.42
2. 托管费	6.4.10.2	921,496.15	532,866.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	4,015,374.20	2,075,816.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.04	-
7. 其他费用	6.4.7.21	118,138.95	48,545.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,551,534.23	91,597,256.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,551,534.23	91,597,256.66

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安现代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）	521,014,444.32	250,123,863.13	771,138,307.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,551,534.23	34,551,534.23
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）	-114,577,839.26	-61,806,664.67	-176,384,503.93
其中：1.基金申购款	233,180,231.27	132,893,994.44	366,074,225.71
2.基金赎回款	-347,758,070.53	-194,700,659.11	-542,458,729.64
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）	406,436,605.06	222,868,732.69	629,305,337.75
项目	上年度可比期间 2020 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,179,587,442.65	-	1,179,587,442.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,597,256.66	91,597,256.66
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）	1,179,587,442.65	91,597,256.66	1,271,184,699.31

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

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

华安现代生活混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2109 号《关于准予华安现代生活混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2020 年 4 月 9 日至 2020 年 4 月 22 日止期间向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 60971571_B02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 4 月 26 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,179,342,437.83 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 245,004.82 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,179,587,442.65 元，折合 1,179,587,442.65 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、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）、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、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于现代生活主题相关证券的比例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；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。如果法律法规对

该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率调整）×10%+中债综合全价指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市

场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	95,860,021.32
定期存款	-
其他存款	-
合计	95,860,021.32

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		507,175,628.55	552,374,834.23	45,199,205.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	16,600.00	16,600.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,600.00	16,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		507,192,228.55	552,391,434.23	45,199,205.68

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

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	7,785.08
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	1,169.99
应收债券利息	0.87
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	104.04
合计	9,059.98

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	2,013,866.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,013,866.76

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	6,186.07
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37

预提审计费	39,671.58
合计	105,365.02

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	521,014,444.32	521,014,444.32
本期申购	233,180,231.27	233,180,231.27
本期赎回（以“-”号填列）	-347,758,070.53	-347,758,070.53
本期末	406,436,605.06	406,436,605.06

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	197,232,008.61	52,891,854.52	250,123,863.13
本期利润	103,426,986.26	-68,875,452.03	34,551,534.23
本期基金份额交易产生的变动数	-63,608,285.26	1,801,620.59	-61,806,664.67
其中：基金申购款	120,099,924.50	12,794,069.94	132,893,994.44
基金赎回款	-183,708,209.76	-10,992,449.35	-194,700,659.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	237,050,709.61	-14,181,976.92	222,868,732.69

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	207,059.26
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	18,531.30
其他	3,607.62
合计	229,198.18

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	1,335,491,219.31
减：卖出股票成本总额	1,226,156,050.13
买卖股票差价收入	109,335,169.18

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	200,383.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	169,900.00
减：应收利息总额	35.00
买卖债券差价收入	30,448.25

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

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	3,333,328.19
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	3,333,328.19

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	-68,875,452.03
——股票投资	-68,829,273.21
——债券投资	-46,178.82
——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	-68,875,452.03

6.4.7.19 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	1,059,190.57
转换费收入	23,624.52
合计	1,082,815.09

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

6.4.7.20 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	4,015,374.20
银行间市场交易费用	-
合计	4,015,374.20

6.4.7.21 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	360.00
账户维护费	18,300.00
其他费用	300.00
合计	118,138.95

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

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

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年4月26日（基金合同生效日） 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	243,111,879.26	9.74%	377,959,415.83	26.43%

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 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	220,629.08	9.97%	21,449.48	1.07%
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月26日（基金合同生效日）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	334,146.06	25.95%	334,146.06	25.95%

注：本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

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4月26日（基金合同生 效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,528,976.84	3,197,196.42
其中：支付销售机构的客户维护费	2,513,027.40	1,315,486.72

注：(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

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4月26日（基金合同生 效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	921,496.15	532,866.07

注：(1) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 本基金于 2020 年 4 月 26 日成立，上年度可比期间为 2020 年 4 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日。

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4月26日（基金合同生效 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

中国工商银行	95,860,021.32	207,059.26	409,387,593.77	474,262.49
--------	---------------	------------	----------------	------------

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	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	新股限售	41.79	43.69	10,004.00	418,067.16	437,074.76	-
688161	威高骨科	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	36.22	82.27	3,069.00	111,159.18	252,486.63	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	75.42	103.88	1,191.00	89,825.22	123,721.08	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	485.00	22,955.05	122,200.60	-

688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股限售	26.89	63.99	1,485.00	39,931.65	95,025.15	-
688607	康众医疗	2021-01-25	2021-08-02	新股限售	23.21	44.50	1,890.00	43,866.90	84,105.00	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	新股限售	33.62	53.14	1,558.00	52,379.96	82,792.12	-
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新股限售	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股限售	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股限售	33.22	87.50	680.00	22,589.60	59,500.00	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股限售	33.44	42.34	1,400.00	46,816.00	59,276.00	-
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	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股限售	9.39	14.00	2,464.00	23,136.96	34,496.00	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股限售	14.71	24.83	1,259.00	18,519.89	31,260.97	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	48.59	90.39	313.00	15,208.67	28,292.07	-
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	-
30102	英诺	2021-0	2021-0	新股	9.46	9.46	2,609.	24,681	24,681	-

1	激光	6-28	7-06	未上市			00	.14	.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	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	配债未上市	100.00	100.00	166.00	16,600.00	16,600.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 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。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益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

金的基金管理人会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	95,860,021.32	-	-	-	95,860,021.32
结算备付金	1,276,456.73	-	-	-	1,276,456.73
存出保证金	469,305.95	-	-	-	469,305.95
交易性金融资产	16,600.00	-	-	552,374,834.23	552,391,434.23
应收证券清算款	-	-	-	2,003,840.46	2,003,840.46
应收股利	-	-	-	328,731.20	328,731.20
应收利息	-	-	-	9,059.98	9,059.98
应收申购款	-	-	-	607,105.76	607,105.76
资产总计	97,622,384.00	-	-	555,323,571.63	652,945,955.63
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	-	-	-	4,920,538.50	4,920,538.50
应付赎回款	-	-	-	15,659,353.96	15,659,353.96
应付管理人报酬	-	-	-	806,994.57	806,994.57
应付托管费	-	-	-	134,499.07	134,499.07

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,013,866.76	2,013,866.76
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	105,365.02	105,365.02
负债总计	-	-	-	23,640,617.88	23,640,617.88
利率敏感度缺口	97,622,384.00	-	-	531,682,953.75	629,305,337.75
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	104,787,766.96	-	-	-	104,787,766.96
结算备付金	2,151,388.85	-	-	-	2,151,388.85
存出保证金	288,493.55	-	-	-	288,493.55
交易性金融资产	216,078.82	-	-	678,637,509.10	678,853,587.92
应收证券清算款	-	-	-	6,286,132.01	6,286,132.01
应收股利	-	-	-	11,568.52	11,568.52
应收利息	-	-	-	10,646.49	10,646.49
应收申购款	-	-	-	4,321,139.92	4,321,139.92
资产总计	107,443,728.18	-	-	689,266,996.04	796,710,724.22
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	-	-	-	11,103,882.52	11,103,882.52
应付赎回款	-	-	-	10,354,861.89	10,354,861.89
应付管理人报酬	-	-	-	971,077.00	971,077.00
应付托管费	-	-	-	161,846.20	161,846.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	2,802,373.81	2,802,373.81
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	178,375.00	178,375.00
负债总计	-	-	-	25,572,416.77	25,572,416.77
利率敏感度缺口	107,443,728.18	-	-	663,694,579.27	771,138,307.45

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日持有的交易性债券资产比例较低，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	-	121,411,348.11	121,411,348.11
应收股利	-	328,731.20	328,731.20
资产合计	-	121,740,079.31	121,740,079.31
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	-	121,740,079.31	121,740,079.31
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	-	144,915,020.29	144,915,020.29
应收股利	-	11,568.52	11,568.52
资产合计	-	144,926,588.81	144,926,588.81
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	-	144,926,588.81	144,926,588.81

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
	港币相对人民币升值 5%	增加约 607	增加约 725
	港币相对人民币贬值 5%	减少约 607	减少约 725

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%；投资于现代生活主题相关证券的比例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%。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	552,374,834.23	87.78	678,637,509.10	88.00
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	552,374,834.23	87.78	678,637,509.10	88.00

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 3,730	增加约 3,743
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,730	减少约 3,743

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

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	552,374,834.23	84.60
	其中：股票	552,374,834.23	84.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,600.00	0.00
	其中：债券	16,600.00	0.00
	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	97,136,478.05	14.88
8	其他各项资产	3,418,043.35	0.52
9	合计	652,945,955.63	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 121,411,348.11 元，占基金资产净值比例为 19.29%

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	201,492,455.71	32.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,850,538.39	3.63
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	328,753.90	0.05
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	10,628,062.04	1.69
J	金融业	143,531,674.11	22.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	41,116,444.70	6.53
M	科学研究和技术服务业	3,101,553.15	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	5,963,672.47	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,913,670.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	430,963,486.12	68.48
--	----	----------------	-------

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（%）
能源	7,016,639.41	1.11
工业	3,712,491.34	0.59
非日常生活消费品	39,122,051.80	6.22
日常消费品	4,294,780.92	0.68
医疗保健	935,736.36	0.15
金融	1,300,790.66	0.21
信息技术	25,520,892.10	4.06
通信服务	34,209,804.29	5.44
房地产	5,298,161.23	0.84
合计	121,411,348.11	19.29

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	002142	宁波银行	1,146,043	44,661,295.71	7.10
2	600036	招商银行	689,510	37,364,546.90	5.94
3	00700	腾讯控股	70,400	34,209,804.29	5.44
4	601939	建设银行	5,143,700	34,205,605.00	5.44
5	002415	海康威视	524,505	33,830,572.50	5.38
6	601888	中国中免	105,747	31,734,674.70	5.04
7	300750	宁德时代	48,500	25,937,800.00	4.12
8	000001	平安银行	1,063,920	24,065,870.40	3.82
9	01810	小米集团—W	973,600	21,873,053.38	3.48
10	06169	宇华教育	3,492,000	20,426,532.22	3.25
11	000858	五粮液	52,500	15,639,225.00	2.49
12	002311	海大集团	177,600	14,492,160.00	2.30
13	002812	恩捷股份	59,154	13,847,951.40	2.20
14	300911	亿田智能	183,800	12,733,664.00	2.02
15	600025	华能水电	2,149,800	12,447,342.00	1.98
16	300408	三环集团	283,600	12,030,312.00	1.91
17	688169	石头科技	8,590	10,831,990.00	1.72
18	600900	长江电力	503,400	10,390,176.00	1.65
19	600519	贵州茅台	4,800	9,872,160.00	1.57
20	002027	分众传媒	997,000	9,381,770.00	1.49
21	002241	歌尔股份	214,200	9,154,908.00	1.45

22	300782	卓胜微	15,280	8,213,000.00	1.31
23	688016	心脉医疗	17,820	8,101,150.20	1.29
24	603833	欧派家居	52,341	7,430,328.36	1.18
25	600570	恒生电子	77,824	7,257,088.00	1.15
26	00883	中国海洋石油	955,000	7,016,639.41	1.11
27	300760	迈瑞医疗	12,500	6,000,625.00	0.95
28	600323	瀚蓝环境	270,066	5,884,738.14	0.94
29	03690	美团-W	21,600	5,758,526.13	0.92
30	01209	华润万象生活	119,800	5,298,161.23	0.84
31	01999	敏华控股	323,600	5,024,411.90	0.80
32	603899	晨光文具	52,200	4,414,032.00	0.70
33	00291	华润啤酒	74,000	4,294,780.92	0.68
34	00027	银河娱乐	72,000	3,723,391.58	0.59
35	06865	福莱特玻璃	137,000	3,647,838.72	0.58
36	601166	兴业银行	155,700	3,199,635.00	0.51
37	603259	药明康德	19,200	3,006,528.00	0.48
38	00667	中国东方教育	292,000	2,964,201.79	0.47
39	300529	健帆生物	34,100	2,944,876.00	0.47
40	600845	宝信软件	43,500	2,214,150.00	0.35
41	00868	信义玻璃	80,000	2,106,826.56	0.33
42	300347	泰格医药	9,900	1,913,670.00	0.30
43	06098	碧桂园服务	23,000	1,605,664.78	0.26
44	000725	京东方 A	223,500	1,394,640.00	0.22
45	01299	友邦保险	16,200	1,300,790.66	0.21
46	00839	中教控股	85,000	1,224,988.18	0.19
47	688111	金山办公	2,813	1,110,572.40	0.18
48	01801	信达生物	8,500	640,431.17	0.10
49	605186	健麾信息	16,700	572,476.00	0.09
50	300973	立高食品	3,593	542,770.60	0.09
51	688819	天能股份	10,004	437,074.76	0.07
52	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.06
53	603160	汇顶科技	2,700	350,001.00	0.06
54	01477	欧康维视生物-B	13,000	295,305.19	0.05
55	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.04
56	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.04
57	688559	海目星	5,924	179,082.52	0.03
58	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
59	688575	亚辉龙	3,435	152,514.00	0.02
60	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.02
61	300957	贝泰妮	485	122,200.60	0.02
62	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
63	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
64	301004	嘉益股份	3,115	90,654.98	0.01

65	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.01
66	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.01
67	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
68	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
69	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
70	300979	华利集团	680	59,500.00	0.01
71	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
72	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
73	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
74	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.01
75	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
76	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
77	688601	力芯微	235	43,263.50	0.01
78	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
79	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
80	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
81	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
82	300981	中红医疗	313	28,292.07	0.00
83	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
84	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
85	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
86	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
87	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
88	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
89	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
90	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
91	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
92	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
93	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
94	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
95	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
96	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
97	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
98	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
99	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
100	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
101	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
102	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
103	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
104	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
105	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
106	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
107	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
108	300950	德固特	219	8,569.47	0.00

109	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
110	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
111	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
112	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
113	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
114	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
115	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
116	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
117	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
118	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
119	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
120	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
121	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
122	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
123	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
124	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
125	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
126	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
127	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
128	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
129	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
130	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
131	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	601939	建设银行	39,675,684.71	5.15
2	600519	贵州茅台	38,692,691.64	5.02
3	601899	紫金矿业	36,118,523.62	4.68
4	601888	中国中免	35,443,091.15	4.60
5	300750	宁德时代	35,397,181.61	4.59
6	002475	立讯精密	34,542,803.78	4.48
7	002938	鹏鼎控股	30,651,878.15	3.97
8	000858	五粮液	29,460,675.07	3.82
9	01810	小米集团－W	26,829,570.38	3.48
10	002236	大华股份	25,480,997.28	3.30
11	002415	海康威视	25,341,634.00	3.29
12	000001	平安银行	25,035,690.71	3.25

13	00939	建设银行	24,341,030.23	3.16
14	002142	宁波银行	23,716,664.30	3.08
15	002812	恩捷股份	22,939,064.12	2.97
16	00883	中国海洋石油	22,579,762.04	2.93
17	002352	顺丰控股	21,986,908.00	2.85
18	600966	博汇纸业	21,851,108.24	2.83
19	600036	招商银行	21,697,407.87	2.81
20	002557	洽洽食品	19,582,876.07	2.54
21	06169	宇华教育	18,020,726.28	2.34
22	300529	健帆生物	17,720,910.20	2.30
23	601128	常熟银行	17,338,977.00	2.25
24	002311	海大集团	16,995,420.98	2.20
25	600570	恒生电子	16,559,301.10	2.15
26	601288	农业银行	15,539,633.00	2.02

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	601888	中国中免	45,936,261.66	5.96
2	000333	美的集团	45,162,940.51	5.86
3	601899	紫金矿业	44,287,668.66	5.74
4	000858	五粮液	42,427,951.26	5.50
5	002475	立讯精密	41,445,502.64	5.37
6	002027	分众传媒	39,518,137.00	5.12
7	600519	贵州茅台	37,658,926.00	4.88
8	002415	海康威视	34,541,045.36	4.48
9	603833	欧派家居	33,018,121.36	4.28
10	002938	鹏鼎控股	32,979,839.32	4.28
11	000001	平安银行	29,971,108.75	3.89
12	601318	中国平安	29,829,794.44	3.87
13	600036	招商银行	29,259,274.67	3.79
14	002236	大华股份	25,724,761.10	3.34
15	00939	建设银行	25,125,705.61	3.26
16	06186	中国飞鹤	22,834,164.19	2.96
17	600887	伊利股份	22,634,850.92	2.94
18	002352	顺丰控股	22,467,891.84	2.91
19	600966	博汇纸业	21,652,646.00	2.81
20	600438	通威股份	21,244,421.78	2.75
21	600323	瀚蓝环境	19,841,591.44	2.57

22	600176	中国巨石	18,695,505.34	2.42
23	02899	紫金矿业	18,307,089.93	2.37
24	002812	恩捷股份	18,155,356.81	2.35
25	300750	宁德时代	17,948,251.60	2.33
26	03690	美团-W	17,854,761.36	2.32
27	000002	万科A	17,055,590.51	2.21
28	002557	洽洽食品	16,535,252.15	2.14
29	00291	华润啤酒	16,321,887.50	2.12
30	00883	中国海洋石油	15,580,312.62	2.02
31	601128	常熟银行	15,503,386.72	2.01

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	1,168,722,648.47
卖出股票的收入（成交）总额	1,335,491,219.31

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	-	-
	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）	16,600.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	16,600.00	0.00
----	----	-----------	------

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	123117	健帆转债	166	16,600.00	0.00

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

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

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

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

2020 年 7 月 13 日，建设银行因内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2020〕32 号）给予罚款合计 3920 万元的行政处罚。

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	469,305.95
2	应收证券清算款	2,003,840.46
3	应收股利	328,731.20
4	应收利息	9,059.98
5	应收申购款	607,105.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,418,043.35

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 比例	持有份额	占总份额 比例
18,885	21,521.66	988,402.95	0.24%	405,448,202.11	99.76%

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	18,710.60	0.00%

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

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只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（2020 年 4 月 26 日）基金份额总额	1,179,587,442.65
本报告期期初基金份额总额	521,014,444.32
本报告期基金总申购份额	233,180,231.27
减：本报告期基金总赎回份额	347,758,070.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	406,436,605.06

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

信达证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	297,450,275.31	11.92%	254,876.91	11.52%	-
华泰证券	1	281,852,550.70	11.29%	255,081.99	11.53%	-
华西证券	1	279,906,683.27	11.22%	239,800.02	10.84%	-
国泰君安证券	1	243,111,879.26	9.74%	220,629.08	9.97%	-
东北证券	1	236,826,857.72	9.49%	200,206.70	9.05%	-
国金证券	2	217,199,145.14	8.70%	192,381.76	8.69%	-
广发华福证券	1	155,387,295.57	6.23%	144,712.75	6.54%	-
中金公司	1	147,736,034.08	5.92%	131,947.13	5.96%	-
广发证券	1	129,963,284.78	5.21%	116,369.19	5.26%	-
长江证券	1	124,063,953.08	4.97%	112,251.60	5.07%	-
瑞银证券	1	87,306,841.37	3.50%	79,030.63	3.57%	-
安信证券	1	82,862,205.15	3.32%	75,512.64	3.41%	-
华创证券	1	78,684,507.63	3.15%	68,703.47	3.10%	-
开源证券	1	69,119,188.36	2.77%	62,988.37	2.85%	-
东吴证券	1	37,467,698.62	1.50%	34,144.15	1.54%	-
中信建投	1	26,857,072.14	1.08%	24,409.97	1.10%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	200,383.25	92.35%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	16,600.00	7.65%	-	-	-	-

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	华安现代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	华安现代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
11	华安现代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
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
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（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
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（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指定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安现代生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安现代生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安现代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现代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

基金管理人和基金托管人的住所（或办公场所），并登载于基金管理人互联网
<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

华安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日