

华安物联网主题股票型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十日

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 2023 年 8 月 28 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 2023 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 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..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 13 |
| 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 14 |
| 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..... | 14 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| 7 投资组合报告 | 45 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 45 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 56 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 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..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 59 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 59 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 59 |
| 8 基金份额持有人信息 | 60 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 60 |

| | | |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 61 |
| 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 | 61 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 61 |
| 10 | 重大事件揭示 | 61 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 61 |
| 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 | 62 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 62 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 62 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 62 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 62 |
| 10.6.1 | 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 62 |
| 10.6.2 | 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 62 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 62 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 65 |
| 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 66 |
| 12 | 备查文件目录 | 66 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 66 |
| 12.2 | 存放地点 | 66 |
| 12.3 | 查阅方式 | 66 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|--------------|
| 基金名称 | 华安物联网主题股票型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华安物联网主题 | |
| 基金主代码 | 001028 | |
| 交易代码 | 001028 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 3 月 17 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 | 252,501,783.13 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001028 | 016292 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 252,151,796.18 份 | 349,986.95 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握该主题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。个股选择方面通过对物联网相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|----------------------|------------------------|
| 名称 | | 华安基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨牧云 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | service@huaan.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 021-60637228 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 | 北京市西城区金融大街25号 |

| | | |
|-------|---------------------------------|-------------------|
| | 临港新片区环湖西二路888号B楼2118室 | |
| 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 | 证券日报 |
| 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 层、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（2023年1月1日至2023年6月30日） | |
|---------------|---------------------------|-------------|
| | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C |
| 本期已实现收益 | 11,299,313.65 | 11,203.04 |
| 本期利润 | 17,656,755.88 | -672.19 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0690 | -0.0038 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.73% | -0.32% |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.01% | 5.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |
| | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C |
| 期末可供分配利润 | 50,355,854.37 | 67,973.29 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1997 | 0.1942 |
| 期末基金资产净值 | 302,507,650.55 | 417,960.24 |
| 期末基金份额净值 | 1.200 | 1.194 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |

| | | |
|-------------|-------------|-------------|
| | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 20.00% | -10.70% |

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：封闭式基金交易佣金、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）。

4、华安物联网主题股票型证券投资基金自 2022 年 8 月 11 日起新增 C 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安物联网主题股票 A

| 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 | 1.61% | 1.13% | 0.56% | 0.68% | 1.05% | 0.45% |
| 过去三个月 | -2.36% | 1.02% | -3.96% | 0.64% | 1.60% | 0.38% |
| 过去六个月 | 6.01% | 0.98% | 0.19% | 0.64% | 5.82% | 0.34% |
| 过去一年 | -10.85% | 1.12% | -9.80% | 0.75% | -1.05% | 0.37% |
| 过去三年 | 9.79% | 1.41% | -3.92% | 0.92% | 13.71% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.00% | 1.78% | 1.83% | 1.14% | 18.17% | 0.64% |

华安物联网主题股票 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.53% | 1.13% | 0.56% | 0.68% | 0.97% | 0.45% |
| 过去三个月 | -2.53% | 1.02% | -3.96% | 0.64% | 1.43% | 0.38% |
| 过去六个月 | 5.66% | 0.98% | 0.19% | 0.64% | 5.47% | 0.34% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -10.70% | 1.12% | -6.27% | 0.75% | -4.43% | 0.37% |

注：华安物联网主题股票型证券投资基金自 2022 年 8 月 11 日起新增 C 类基金份额。

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

华安物联网主题股票型证券投资基金

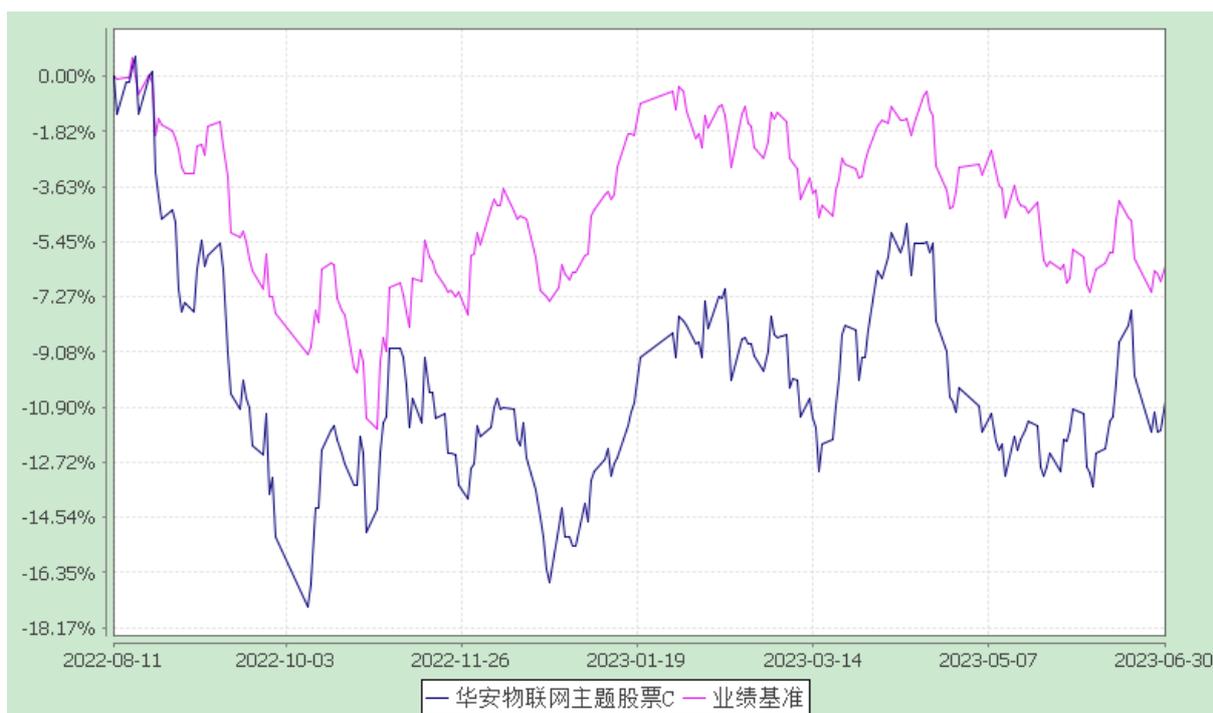
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月17日至2023年6月30日)

华安物联网主题股票 A



华安物联网主题股票 C



注：华安物联网主题股票型证券投资基金自 2022 年 8 月 11 日起新增 C 类基金份额。

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 2023 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 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 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 | | |
| 翁启森 | 本基金的基金经理，副总经理，首席投资官 | 2015-03-17 | - | 28 年 | 工业工程学硕士，28 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任公司副总经理兼首席投资官。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2016 年 9 月同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月至 2016 年 9 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 7 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

2023 年上半年市场分化巨大，其中通信、传媒、计算机、家电、机械等行业涨幅居前，消费者服务、房地产、农林牧渔、建材、基础化工等行业跌幅居前。报告期内，本基金在契约范围内积极配置科技、医药、新能源等板块的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.200 元，本报告期份额净值增长率为 6.01%，

同期业绩比较基准增长率为 0.19%；本基金 C 类份额净值为 1.194 元，本报告期份额净值增长率为 5.66%，同期业绩比较基准增长率为 0.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，国内经济平稳复苏，制造业 PMI 有所波动。海外经济显示出一定韧性。美国新建住房销售创过去两年以来新高，新增非农就业人数和 CPI 也略超预期。十年期美债收益率在二季度呈现上行趋势，人民币持续贬值。在国内经济尚未显著复苏的背景下，我们的投资聚焦于部分高景气的行业板块中。

我们长期看好中国新能源汽车的投资机会。随着国产新能源汽车销量的上升，中国新能源汽车的全球竞争力持续提升，正在快速实现弯道超车。海外新能源汽车的渗透率仍然不高，中国车企走向世界将是大概率事件，这也将带动一批国产零部件企业成长为世界级供应商。此外，伴随着智能汽车企业能力的提升，未来延展到人形机器人领域的竞争力也值得关注，有望分享行业成长的蛋糕。另外，在特斯拉 HW3.0 即将落地的引领下，汽车智能化可能成为汽车行业销量的胜负手，智能驾驶板块的相关机会亦值得重视。

科技领域是我们今年持续重点布局的方向，尤其是人工智能板块。在本轮人工智能浪潮中，国内部分企业深度参与到全球竞争，我们重视相关企业在上游算力以及下游应用端的投资机会。

医药行业呈现出许多投资机会。一方面，在后疫情时代，居民正常就医需求有望恢复到疫情前水平，带动相关药品、器械、医疗服务需求的回暖。另一方面，我们观察到一些国内创新药企业在海外的加速授权，反应了这些企业的研发能力持续提高，全球竞争力正在不断上升。

光伏行业尽管前期股价有所调整，但是随着硅料及电池价格下降，组件价格有望进一步下行，推动下游需求爆发，我们重点布局行业中格局较好以及估值调整到位的细分环节。

近期中央政治局会议对下半年经济工作，尤其是房地产、资本市场、货币政策、化解地方债务风险等方面做出积极指示，有助于提升市场信心，扭转宏观经济以及资本市场的预期。因此，我们看好顺周期行业中估值较低的一些方向，如券商、保险为代表的非银金融板块，以及有价格弹性的周期性板块预计会有表现。

今年的市场风险与机会并存，我们将密切跟踪科技、高端制造、医药、新能源，以及低估值中的非银金融、顺周期等板块的投资机会，选择风险收益比合适的标的进行重点投资。

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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：华安物联网主题股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 18,490,663.85 | 16,501,541.00 |
| 结算备付金 | | 32,727.06 | 54,111.55 |
| 存出保证金 | | 11,221.34 | 17,559.51 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 284,810,922.10 | 280,010,309.32 |
| 其中：股票投资 | | 284,541,463.90 | 279,414,938.32 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 269,458.20 | 595,371.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | 485,305.89 | 1,182,203.54 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 69,823.17 | 26,093.95 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 303,900,663.41 | 297,791,818.87 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | 217,401.89 | 1,104,047.81 |
| 应付赎回款 | | 83,610.69 | 28,105.72 |
| 应付管理人报酬 | | 372,573.31 | 387,462.76 |
| 应付托管费 | | 62,095.56 | 64,577.14 |
| 应付销售服务费 | | 220.26 | 26.90 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1.43 | 1.21 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 239,149.48 | 261,289.61 |
| 负债合计 | | 975,052.62 | 1,845,511.15 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 252,501,783.13 | 261,346,111.84 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 50,423,827.66 | 34,600,195.88 |
| 净资产合计 | | 302,925,610.79 | 295,946,307.72 |
| 负债和净资产总计 | | 303,900,663.41 | 297,791,818.87 |

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 252,501,783.13 份，其中 A 类基金份额净值 1.200 元，基金份额总额 252,151,796.18 份；C 类基金份额净值 1.194 元，基金份额总额 349,986.95 份。

6.2 利润表

会计主体：华安物联网主题股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 20,434,560.43 | -54,835,916.00 |
| 1.利息收入 | | 31,562.72 | 22,635.35 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 31,562.72 | 22,635.35 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 14,040,176.79 | 11,915,312.56 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 11,515,920.29 | 9,537,095.01 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 10,490.66 | 169,760.20 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 2,513,765.84 | 2,208,457.35 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 6,345,567.00 | -66,829,561.21 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 17,253.92 | 55,697.30 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,778,476.74 | 3,179,494.96 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 2,296,572.22 | 2,640,815.58 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 382,762.06 | 440,135.95 |
| 3. 销售服务费 | | 626.24 | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7.税金及附加 | | 1.07 | 3.28 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 98,515.15 | 98,540.15 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 17,656,083.69 | -58,015,410.96 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 17,656,083.69 | -58,015,410.96 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 17,656,083.69 | -58,015,410.96 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安物联网主题股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | | |
|----|---------------------------------|------|-------|-------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| | | | | |

| | | 收益（若有） | | |
|--|----------------|--------|---------------|----------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 261,346,111.84 | - | 34,600,195.88 | 295,946,307.72 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 261,346,111.84 | - | 34,600,195.88 | 295,946,307.72 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -8,844,328.71 | - | 15,823,631.78 | 6,979,303.07 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 17,656,083.69 | 17,656,083.69 |
| （二）、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） | -8,844,328.71 | - | -1,832,451.91 | -10,676,780.62 |
| 其中：1.基金申购款 | 6,728,918.99 | - | 1,382,368.06 | 8,111,287.05 |
| 2.基金赎回款 | -15,573,247.70 | - | -3,214,819.97 | -18,788,067.67 |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 252,501,783.13 | - | 50,423,827.66 | 302,925,610.79 |

| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
|----------------------|---------------------------------|------------|----------------|----------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 284,720,339.18 | - | 155,365,456.26 | 440,085,795.44 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 284,720,339.18 | - | 155,365,456.26 | 440,085,795.44 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -16,883,564.01 | - | -62,771,344.71 | -79,654,908.72 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -58,015,410.96 | -58,015,410.96 |
| （二）、本期基金 | -16,883,564.01 | - | -4,755,933.75 | -21,639,497.7 |

| | | | | |
|--|----------------|---|---------------|----------------|
| 份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | | | | 6 |
| 其中：1.基金申购款 | 12,414,014.14 | - | 3,660,610.14 | 16,074,624.28 |
| 2.基金赎回款 | -29,297,578.15 | - | -8,416,543.89 | -37,714,122.04 |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 267,836,775.17 | - | 92,594,111.55 | 360,430,886.72 |

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：陈松一

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安物联网主题股票型证券投资基金（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[2015]78 号《关于准予华安物联网主题股票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向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 3 月 17 日（基金合同生效日）生效，首次设立募集规模为 4,787,382,240.64 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人华安基金管理有限公司于 2022 年 8 月 9 日发布的《关于旗下部分基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2022 年 8 月 11 日起，在本基金现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额自动转换为 A 类基金份额。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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等权益类证券（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、权证等）、股指期货、债

券、货币市场工具、资产支持证券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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%，其中，投资于物联网相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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，

证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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法》、《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。

6.4.7 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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 18,490,663.85 |
| 等于：本金 | 18,489,026.19 |
| 加：应计利息 | 1,637.66 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 18,490,663.85 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|-------------------|------------------------|------------|----------------|---------------|-----------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 262,918,599.60 | - | 284,541,463.90 | 21,622,864.30 | |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市 场 | 218,800.00 | 190.33 | 269,458.20 | 50,467.87 |
| | 银行间市 场 | - | - | - | - |

| | | | | | |
|--------|----|----------------|--------|----------------|---------------|
| | 合计 | 218,800.00 | 190.33 | 269,458.20 | 50,467.87 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| | 合计 | 263,137,399.60 | 190.33 | 284,810,922.10 | 21,673,332.17 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 48.63 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 89,840.70 |
| 其中：交易所市场 | 89,840.70 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提审计费 | 89,752.78 |
| 合计 | 239,149.48 |

6.4.7.7 实收基金

华安物联网主题股票 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----|----------------------------|
| | |

| | 基金份额 | 账面金额 |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 261,296,096.13 | 261,296,096.13 |
| 本期申购 | 6,197,762.96 | 6,197,762.96 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,342,062.91 | -15,342,062.91 |
| 本期末 | 252,151,796.18 | 252,151,796.18 |

华安物联网主题股票 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------------|-------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 50,015.71 | 50,015.71 |
| 本期申购 | 531,156.03 | 531,156.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -231,184.79 | -231,184.79 |
| 本期末 | 349,986.95 | 349,986.95 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华安物联网主题股票 A

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 | 134,148,478.67 | -99,554,806.02 | 34,593,672.65 |
| 本期利润 | 11,299,313.65 | 6,357,442.23 | 17,656,755.88 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,763,063.72 | 2,868,489.56 | -1,894,574.16 |
| 其中：基金申购款 | 3,271,018.70 | -1,999,727.43 | 1,271,291.27 |
| 基金赎回款 | -8,034,082.42 | 4,868,216.99 | -3,165,865.43 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 140,684,728.60 | -90,328,874.23 | 50,355,854.37 |

华安物联网主题股票 C

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 | 25,579.79 | -19,056.56 | 6,523.23 |
| 本期利润 | 11,203.04 | -11,875.23 | -672.19 |
| 本期基金份额交易产生的 | 156,543.50 | -94,421.25 | 62,122.25 |

| | | | |
|----------|-------------|-------------|------------|
| 变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 280,553.22 | -169,476.43 | 111,076.79 |
| 基金赎回款 | -124,009.72 | 75,055.18 | -48,954.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 193,326.33 | -125,353.04 | 67,973.29 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 31,067.89 |
| 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 | 381.60 |
| 其他 | 113.23 |
| 合计 | 31,562.72 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 11,515,920.29 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 11,515,920.29 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 58,654,337.02 |
| 减：卖出股票成本总额 | 46,982,898.31 |
| 减：交易费用 | 155,518.42 |
| 买卖股票差价收入 | 11,515,920.29 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 3,291.68 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 7,198.98 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 10,490.66 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 455,290.18 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 438,245.00 |
| 减：应计利息总额 | 9,844.38 |
| 减：交易费用 | 1.82 |
| 买卖债券差价收入 | 7,198.98 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益**6.4.7.13.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,513,765.84 |
| 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 | 2,513,765.84 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 6,345,567.00 |
| ——股票投资 | 6,313,216.83 |
| ——债券投资 | 32,350.17 |
| ——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 | 6,345,567.00 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 16,552.57 |
| 基金转换费收入 | 701.35 |
| 合计 | 17,253.92 |

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023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 | - |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 银行汇划费 | 255.00 |
| 合计 | 98,515.15 |

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**

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 20,721,494.72 | 21.36% | 12,883,633.53 | 16.33% |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 44,800.00 | 33.87% | 360,666.88 | 2.17% |

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 2023年1月1日至2023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 | 19,091.11 | 21.25% | 19,091.11 | 21.25% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 11,762.16 | 16.23% | 11,762.16 | 16.23% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,296,572.22 | 2,640,815.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 968,675.88 | 1,099,935.00 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 382,762.06 | 440,135.95 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

| | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C | 合计 |
|----------------|---------------------------------|-------------|-------|
| 华安基金管理有限公司 | - | 10.41 | 10.41 |
| 中国建设银行股份有限公司 | - | - | 0.00 |
| 合计 | - | 10.41 | 10.41 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C | 合计 |
| 合计 | - | - | - |

注：自 2022 年 8 月 11 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 2022年1月1日至2022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 | 18,490,663.85 | 31,067.89 | 19,034,256.13 | 22,187.06 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 688361 | 中科飞测 | 网下申购 | 2,524.00 | 59,566.40 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 688479 | 友车科技 | 网下申购 | 1,935.00 | 65,770.65 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 001314 | 亿道信息 | 网下申购 | 508.00 | 17,780.00 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 603065 | 宿迁联盛 | 网下申购 | 581.00 | 7,465.85 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 001311 | 多利科技 | 网下申购 | 499.00 | 30,873.13 |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 688234 | 天岳先进 | 网下申购 | 1,980.00 | 164,743.82 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 603070 | 万控智造 | 网下申购 | 775.00 | 7,300.50 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 301263 | 泰恩康 | 网下申购 | 5,178.00 | 103,197.54 |

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 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 | 受限期 | 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 |
| 301293 | 三博脑科 | 2023-04-25 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 29.60 | 71.42 | 286.00 | 8,465.60 | 20,426.12 | - |
| 688472 | 阿特斯 | 2023-06-02 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 11.10 | 17.04 | 1,037.00 | 11,510.70 | 17,670.48 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023-05-12 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 23.60 | 64.67 | 253.00 | 5,970.80 | 16,361.51 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 76.80 | 107.95 | 150.00 | 11,520.00 | 16,192.50 | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023-02-01 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 23.77 | 42.89 | 363.00 | 8,628.51 | 15,569.07 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023-04-28 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 5.69 | 5.41 | 2,753.00 | 15,664.57 | 14,893.73 | - |
| 688443 | 智翔金泰 | 2023-06-13 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 37.88 | 29.49 | 460.00 | 17,424.80 | 13,565.40 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023-06-21 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 26.74 | 40.68 | 290.00 | 7,754.60 | 11,797.20 | - |
| 301399 | 英特科技 | 2023-05-16 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 43.99 | 51.57 | 221.00 | 9,721.79 | 11,396.97 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023-05-30 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 135.80 | 120.41 | 92.00 | 12,493.60 | 11,077.72 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023-03-27 | 1-6个月 | 新股限售 | 41.20 | 42.69 | 246.00 | 10,135.20 | 10,501.74 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----------|---------|--------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| | | | (含) | | | | | | | |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 26.68 | 26.68 | 390.00 | 10,405.20 | 10,405.20 | - |
| 301303 | 真兰仪表 | 2023-02-13 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 26.80 | 22.32 | 450.00 | 12,060.00 | 10,044.00 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023-06-21 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 57.88 | 49.17 | 201.00 | 11,633.88 | 9,883.17 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023-03-30 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 11.88 | 21.02 | 470.00 | 5,583.60 | 9,879.40 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023-06-09 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 14.16 | 16.21 | 605.00 | 8,566.80 | 9,807.05 | - |
| 301382 | 蜂助手 | 2023-05-09 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 23.80 | 32.84 | 294.00 | 6,997.20 | 9,654.96 | - |
| 688620 | 安凯微 | 2023-06-15 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 10.68 | 12.34 | 781.00 | 8,341.08 | 9,637.54 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 39.78 | 39.78 | 236.00 | 9,388.08 | 9,388.08 | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023-04-10 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 245.56 | 122.11 | 49.00 | 12,032.44 | 5,983.39 | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023-06-20 | 1-6个月(含) | 新股限售-送股 | - | 122.11 | 24.00 | - | 2,930.64 | - |
| 301307 | 美利信 | 2023-04-14 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 32.34 | 31.86 | 275.00 | 8,893.50 | 8,761.50 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 21.17 | 23.50 | 362.00 | 7,663.54 | 8,507.00 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023-06-20 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 19.20 | 25.53 | 327.00 | 6,278.40 | 8,348.31 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023-03-28 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 35.00 | 51.23 | 161.00 | 5,635.00 | 8,248.03 | - |
| 68857 | 天玛 | 2023-0 | 1-6个 | 新股 | 30.26 | 25.33 | 319.00 | 9,652. | 8,080. | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|--------------|------|-------|-------|--------|-----------|----------|---|
| 0 | 智控 | 5-29 | 月 (含) | 限售 | | | | 94 | 27 | |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 33.73 | 31.85 | 253.00 | 8,533.69 | 8,058.05 | - |
| 301305 | 朗坤环境 | 2023-05-15 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 25.25 | 19.69 | 406.00 | 10,251.50 | 7,994.14 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023-06-14 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 24.66 | 22.51 | 350.00 | 8,631.00 | 7,878.50 | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023-06-02 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 17.55 | 16.75 | 455.00 | 7,985.25 | 7,621.25 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023-06-16 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 34.00 | 34.93 | 216.00 | 7,344.00 | 7,544.88 | - |
| 688512 | 慧智微 | 2023-05-08 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 20.92 | 19.16 | 390.00 | 8,158.80 | 7,472.40 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 55.00 | 55.00 | 133.00 | 7,315.00 | 7,315.00 | - |
| 301323 | 新莱福 | 2023-05-29 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 39.06 | 39.36 | 185.00 | 7,226.10 | 7,281.60 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 72.50 | 58.42 | 124.00 | 8,990.00 | 7,244.08 | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023-05-10 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 26.35 | 30.60 | 229.00 | 6,034.15 | 7,007.40 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 36.90 | 36.90 | 189.00 | 6,974.10 | 6,974.10 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 25.28 | 29.87 | 233.00 | 5,890.24 | 6,959.71 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 29.99 | 23.79 | 289.00 | 8,667.11 | 6,875.31 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 1-6个月 (含) | 新股限售 | 6.58 | 7.58 | 895.00 | 5,889.10 | 6,784.10 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|-------------------|-----------------|--------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| 30128 1 | 科源 制药 | 2023-0 3-28 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 44.18 | 25.10 | 192.00 | 8,482. 56 | 4,819. 20 | - |
| 30128 1 | 科源 制药 | 2023-0 5-26 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售- 送股 | - | 25.10 | 77.00 | - | 1,932. 70 | - |
| 30120 2 | 朗威 股份 | 2023-0 6-28 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 25.82 | 25.82 | 261.00 | 6,739. 02 | 6,739. 02 | - |
| 30120 3 | 国泰 环保 | 2023-0 3-28 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 46.13 | 34.40 | 191.00 | 8,810. 83 | 6,570. 40 | - |
| 30133 7 | 亚华 电子 | 2023-0 5-16 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 32.60 | 30.37 | 203.00 | 6,617. 80 | 6,165. 11 | - |
| 30143 9 | 泓淋 电力 | 2023-0 3-10 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 19.99 | 16.90 | 351.00 | 7,016. 49 | 5,931. 90 | - |
| 68862 3 | 双元 科技 | 2023-0 5-31 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 125.88 | 86.79 | 68.00 | 8,559. 84 | 5,901. 72 | - |
| 68847 9 | 友车 科技 | 2023-0 5-04 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 33.99 | 29.49 | 194.00 | 6,594. 06 | 5,721. 06 | - |
| 30134 5 | 涛涛 车业 | 2023-0 3-10 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 73.45 | 46.64 | 110.00 | 8,079. 50 | 5,130. 40 | - |
| 60106 5 | 江盐 集团 | 2023-0 3-31 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 10.36 | 11.84 | 321.00 | 3,325. 56 | 3,800. 64 | - |
| 60113 3 | 柏诚 股份 | 2023-0 3-31 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 11.66 | 12.26 | 295.00 | 3,439. 70 | 3,616. 70 | - |
| 00132 8 | 登康 口腔 | 2023-0 3-29 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 20.68 | 25.49 | 135.00 | 2,791. 80 | 3,441. 15 | - |
| 00128 2 | 三联 锻造 | 2023-0 5-15 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 27.93 | 33.03 | 104.00 | 2,904. 72 | 3,435. 12 | - |
| 00136 0 | 南矿 集团 | 2023-0 3-31 | 1-6 个 月 (含) | 新股 限售 | 15.38 | 14.87 | 177.00 | 2,722. 26 | 2,631. 99 | - |
| 60312 5 | 常青 科技 | 2023-0 3-30 | 1-6 个 月 | 新股 限售 | 25.98 | 24.53 | 100.00 | 2,598. 00 | 2,453. 00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----------|-------|-------|-------|----------|-----------|-----------|---|
| | | | (含) | | | | | | | |
| 001324 | 长青科技 | 2023-05-12 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 18.88 | 19.60 | 114.00 | 2,152.32 | 2,234.40 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023-03-30 | 1-6个月(含) | 新股限售 | 44.48 | 39.48 | 54.00 | 2,401.92 | 2,131.92 | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 26.68 | 26.68 | 3,507.00 | 93,566.76 | 93,566.76 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 39.78 | 39.78 | 2,120.00 | 84,333.60 | 84,333.60 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 55.00 | 55.00 | 1,188.00 | 65,340.00 | 65,340.00 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 36.90 | 36.90 | 1,700.00 | 62,730.00 | 62,730.00 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 25.82 | 25.82 | 2,347.00 | 60,599.54 | 60,599.54 | - |

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 |
|--------|------|------------|-----------|--------|------------|--------|-----------|-----------|------------|----|
| 300346 | 南大光电 | 2023-06-26 | 重大事项或临时停牌 | 34.39 | 2023-07-06 | 35.60 | 10,173.00 | 92,855.78 | 349,849.47 | - |

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

截至报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业，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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023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 | 18,490,663.85 | - | - | - | 18,490,663.85 |
| 结算备付金 | 32,727.06 | - | - | - | 32,727.06 |
| 存出保证金 | 11,221.34 | - | - | - | 11,221.34 |
| 交易性金融资产 | 269,458.20 | - | - | 284,541,463.90 | 284,810,922.10 |
| 应收清算款 | - | - | - | 485,305.89 | 485,305.89 |
| 应收申购款 | - | - | - | 69,823.17 | 69,823.17 |
| 资产总计 | 18,804,070.45 | - | - | 285,096,592.96 | 303,900,663.41 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 217,401.89 | 217,401.89 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 83,610.69 | 83,610.69 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 372,573.31 | 372,573.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 62,095.56 | 62,095.56 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 220.26 | 220.26 |
| 应交税费 | - | - | - | 1.43 | 1.43 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 239,149.48 | 239,149.48 |
| 负债总计 | - | - | - | 975,052.62 | 975,052.62 |
| 利率敏感度缺口 | 18,804,070.45 | - | - | 284,121,540.34 | 302,925,610.79 |
| 上年度末 2022 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 | 16,501,541.00 | - | - | - | 16,501,541.00 |
| 结算备付金 | 54,111.55 | - | - | - | 54,111.55 |
| 存出保证金 | 17,559.51 | - | - | - | 17,559.51 |
| 交易性金融资产 | 595,371.00 | - | - | 279,414,938.32 | 280,010,309.32 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,182,203.54 | 1,182,203.54 |
| 应收申购款 | - | - | - | 26,093.95 | 26,093.95 |
| 资产总计 | 17,168,583.06 | - | - | 280,623,235.81 | 297,791,818.87 |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,104,047.81 | 1,104,047.81 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 28,105.72 | 28,105.72 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 387,462.76 | 387,462.76 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 应付托管费 | - | - | - | 64,577.14 | 64,577.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 26.90 | 26.90 |
| 应交税费 | - | - | - | 1.21 | 1.21 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 261,289.61 | 261,289.61 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,845,511.15 | 1,845,511.15 |
| 利率敏感度缺口 | 17,168,583.06 | - | - | 278,777,724.66 | 295,946,307.72 |

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 2023 年 06 月 30 日及 2022 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。

6.4.13.4.3 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交易的股票，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。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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 284,541,463. 90 | 93.93 | 279,414,938.3 2 | 94.41 |
| 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 | 284,541,463. 90 | 93.93 | 279,414,938.3 2 | 94.41 |

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 | | |
|----|---|---------------------------------|--------------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| 分析 | | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准增加 5% | 19,328,719.08 | 19,360,879.58 |
| | 业绩比较基准减少 5% | -19,328,719.08 | -19,360,879.58 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上期末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|-------------------------|
| 第一层次 | 283,629,824.80 | 276,844,663.57 |
| 第二层次 | 757,240.77 | 2,420,169.34 |
| 第三层次 | 423,856.53 | 745,476.41 |
| 合计 | 284,810,922.10 | 280,010,309.32 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.15.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 8 月 28 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 | 284,541,463.90 | 93.63 |
| | 其中：股票 | 284,541,463.90 | 93.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 269,458.20 | 0.09 |
| | 其中：债券 | 269,458.20 | 0.09 |
| | 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 | 18,523,390.91 | 6.10 |
| 8 | 其他各项资产 | 566,350.40 | 0.19 |
| 9 | 合计 | 303,900,663.41 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,361,182.40 | 0.78 |
| B | 采矿业 | 2,828,647.68 | 0.93 |
| C | 制造业 | 203,408,895.10 | 67.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,753,008.15 | 0.58 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| E | 建筑业 | 844,417.50 | 0.28 |
| F | 批发和零售业 | 1,454,928.08 | 0.48 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,731,397.54 | 1.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | 384,685.00 | 0.13 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 45,477,433.79 | 15.01 |
| J | 金融业 | 12,199,035.52 | 4.03 |
| K | 房地产业 | 277,539.00 | 0.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,724,612.58 | 0.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 243,553.50 | 0.08 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,431,394.99 | 0.47 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 193,291.55 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,705,987.92 | 1.55 |
| S | 综合 | 521,453.60 | 0.17 |
| | 合计 | 284,541,463.90 | 93.93 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000977 | 浪潮信息 | 175,547 | 8,514,029.50 | 2.81 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 33,480 | 7,659,889.20 | 2.53 |
| 3 | 002179 | 中航光电 | 162,630 | 7,375,270.50 | 2.43 |
| 4 | 002709 | 天赐材料 | 174,364 | 7,182,053.16 | 2.37 |
| 5 | 300316 | 晶盛机电 | 98,130 | 6,957,417.00 | 2.30 |
| 6 | 688111 | 金山办公 | 12,554 | 5,928,249.88 | 1.96 |
| 7 | 688036 | 传音控股 | 36,081 | 5,303,907.00 | 1.75 |
| 8 | 301269 | 华大九天 | 38,539 | 4,734,130.76 | 1.56 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 136,500 | 4,519,515.00 | 1.49 |
| 10 | 002230 | 科大讯飞 | 65,341 | 4,440,574.36 | 1.47 |
| 11 | 000063 | 中兴通讯 | 97,228 | 4,427,763.12 | 1.46 |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 219,430 | 4,340,325.40 | 1.43 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 13 | 300613 | 富瀚微 | 74,598 | 4,232,690.52 | 1.40 |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 91,508 | 4,201,132.28 | 1.39 |
| 15 | 002812 | 恩捷股份 | 43,500 | 4,191,225.00 | 1.38 |
| 16 | 600438 | 通威股份 | 117,500 | 4,031,425.00 | 1.33 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 63,700 | 3,853,850.00 | 1.27 |
| 18 | 688041 | 海光信息 | 52,785 | 3,603,631.95 | 1.19 |
| 19 | 688008 | 澜起科技 | 58,043 | 3,332,829.06 | 1.10 |
| 20 | 002371 | 北方华创 | 10,303 | 3,272,747.95 | 1.08 |
| 21 | 002466 | 天齐锂业 | 43,620 | 3,049,474.20 | 1.01 |
| 22 | 600845 | 宝信软件 | 49,980 | 2,539,483.80 | 0.84 |
| 23 | 600977 | 中国电影 | 169,500 | 2,381,475.00 | 0.79 |
| 24 | 600633 | 浙数文化 | 138,200 | 2,240,222.00 | 0.74 |
| 25 | 002594 | 比亚迪 | 8,600 | 2,221,122.00 | 0.73 |
| 26 | 601689 | 拓普集团 | 24,900 | 2,009,430.00 | 0.66 |
| 27 | 600584 | 长电科技 | 63,400 | 1,976,178.00 | 0.65 |
| 28 | 300820 | 英杰电气 | 23,400 | 1,927,692.00 | 0.64 |
| 29 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,400 | 1,918,720.00 | 0.63 |
| 30 | 688385 | 复旦微电 | 38,100 | 1,908,810.00 | 0.63 |
| 31 | 600536 | 中国软件 | 40,170 | 1,883,169.60 | 0.62 |
| 32 | 002984 | 森麒麟 | 59,100 | 1,859,286.00 | 0.61 |
| 33 | 601111 | 中国国航 | 222,400 | 1,832,576.00 | 0.60 |
| 34 | 002129 | TCL 中环 | 54,875 | 1,821,850.00 | 0.60 |
| 35 | 600563 | 法拉电子 | 13,003 | 1,785,311.90 | 0.59 |
| 36 | 300223 | 北京君正 | 19,808 | 1,749,244.48 | 0.58 |
| 37 | 000938 | 紫光股份 | 54,600 | 1,739,010.00 | 0.57 |
| 38 | 002555 | 三七互娱 | 47,900 | 1,670,752.00 | 0.55 |
| 39 | 300054 | 鼎龙股份 | 67,400 | 1,666,802.00 | 0.55 |
| 40 | 600111 | 北方稀土 | 67,100 | 1,609,058.00 | 0.53 |
| 41 | 300438 | 鹏辉能源 | 32,100 | 1,542,084.00 | 0.51 |
| 42 | 601012 | 隆基绿能 | 53,620 | 1,537,285.40 | 0.51 |
| 43 | 688981 | 中芯国际 | 29,985 | 1,514,842.20 | 0.50 |
| 44 | 600036 | 招商银行 | 44,700 | 1,464,372.00 | 0.48 |
| 45 | 603290 | 斯达半导 | 6,800 | 1,463,360.00 | 0.48 |
| 46 | 300059 | 东方财富 | 101,904 | 1,447,036.80 | 0.48 |
| 47 | 300378 | 鼎捷软件 | 40,700 | 1,393,975.00 | 0.46 |
| 48 | 600486 | 扬农化工 | 15,668 | 1,369,696.56 | 0.45 |
| 49 | 002460 | 赣锋锂业 | 22,396 | 1,365,260.16 | 0.45 |
| 50 | 300308 | 中际旭创 | 9,037 | 1,332,505.65 | 0.44 |
| 51 | 601238 | 广汽集团 | 124,500 | 1,297,290.00 | 0.43 |
| 52 | 688187 | 时代电气 | 30,880 | 1,292,636.80 | 0.43 |
| 53 | 300533 | 冰川网络 | 25,800 | 1,288,968.00 | 0.43 |
| 54 | 002138 | 顺络电子 | 53,000 | 1,267,230.00 | 0.42 |
| 55 | 000661 | 长春高新 | 8,900 | 1,213,070.00 | 0.40 |
| 56 | 002965 | 祥鑫科技 | 20,600 | 1,147,008.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 57 | 002050 | 三花智控 | 37,048 | 1,121,072.48 | 0.37 |
| 58 | 000999 | 华润三九 | 18,300 | 1,110,078.00 | 0.37 |
| 59 | 002850 | 科达利 | 8,000 | 1,058,000.00 | 0.35 |
| 60 | 000970 | 中科三环 | 82,486 | 1,057,470.52 | 0.35 |
| 61 | 600905 | 三峡能源 | 193,763 | 1,040,507.31 | 0.34 |
| 62 | 002318 | 久立特材 | 60,950 | 1,037,978.50 | 0.34 |
| 63 | 000998 | 隆平高科 | 66,100 | 1,014,635.00 | 0.33 |
| 64 | 000915 | 华特达因 | 27,906 | 984,802.74 | 0.33 |
| 65 | 300383 | 光环新网 | 90,500 | 972,875.00 | 0.32 |
| 66 | 603338 | 浙江鼎力 | 17,272 | 967,404.72 | 0.32 |
| 67 | 688392 | 骄成超声 | 8,680 | 963,393.20 | 0.32 |
| 68 | 000513 | 丽珠集团 | 24,400 | 949,404.00 | 0.31 |
| 69 | 300033 | 同花顺 | 5,400 | 946,512.00 | 0.31 |
| 70 | 300598 | 诚迈科技 | 20,200 | 932,634.00 | 0.31 |
| 71 | 300661 | 圣邦股份 | 11,310 | 928,890.30 | 0.31 |
| 72 | 601138 | 工业富联 | 36,800 | 927,360.00 | 0.31 |
| 73 | 688153 | 唯捷创芯 | 12,581 | 920,425.96 | 0.30 |
| 74 | 688141 | 杰华特 | 23,345 | 912,789.50 | 0.30 |
| 75 | 688376 | 美埃科技 | 22,836 | 901,793.64 | 0.30 |
| 76 | 603297 | 永新光学 | 11,100 | 886,890.00 | 0.29 |
| 77 | 300433 | 蓝思科技 | 72,548 | 853,164.48 | 0.28 |
| 78 | 002385 | 大北农 | 129,000 | 851,400.00 | 0.28 |
| 79 | 000066 | 中国长城 | 61,100 | 845,013.00 | 0.28 |
| 80 | 000333 | 美的集团 | 14,300 | 842,556.00 | 0.28 |
| 81 | 600938 | 中国海油 | 46,200 | 837,144.00 | 0.28 |
| 82 | 601126 | 四方股份 | 55,100 | 836,969.00 | 0.28 |
| 83 | 601728 | 中国电信 | 147,586 | 830,909.18 | 0.27 |
| 84 | 601058 | 赛轮轮胎 | 72,600 | 826,914.00 | 0.27 |
| 85 | 600259 | 广晟有色 | 22,850 | 825,799.00 | 0.27 |
| 86 | 601333 | 广深铁路 | 205,400 | 813,384.00 | 0.27 |
| 87 | 688349 | 三一重能 | 25,207 | 812,169.54 | 0.27 |
| 88 | 600570 | 恒生电子 | 18,200 | 806,078.00 | 0.27 |
| 89 | 002311 | 海大集团 | 17,200 | 805,648.00 | 0.27 |
| 90 | 601688 | 华泰证券 | 58,499 | 805,531.23 | 0.27 |
| 91 | 002025 | 航天电器 | 12,500 | 797,500.00 | 0.26 |
| 92 | 601877 | 正泰电器 | 28,800 | 796,320.00 | 0.26 |
| 93 | 601231 | 环旭电子 | 53,077 | 794,031.92 | 0.26 |
| 94 | 600760 | 中航沈飞 | 17,272 | 777,240.00 | 0.26 |
| 95 | 002080 | 中材科技 | 37,638 | 772,331.76 | 0.25 |
| 96 | 600038 | 中直股份 | 19,172 | 763,429.04 | 0.25 |
| 97 | 300450 | 先导智能 | 21,062 | 761,812.54 | 0.25 |
| 98 | 002373 | 千方科技 | 55,200 | 752,928.00 | 0.25 |
| 99 | 300236 | 上海新阳 | 18,716 | 742,089.40 | 0.24 |
| 100 | 600217 | 中再资环 | 154,100 | 735,057.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 101 | 600009 | 上海机场 | 16,100 | 731,262.00 | 0.24 |
| 102 | 301095 | 广立微 | 8,842 | 730,791.30 | 0.24 |
| 103 | 600837 | 海通证券 | 78,662 | 725,263.64 | 0.24 |
| 104 | 688031 | 星环科技 | 5,433 | 723,892.92 | 0.24 |
| 105 | 002273 | 水晶光电 | 60,241 | 719,277.54 | 0.24 |
| 106 | 002299 | 圣农发展 | 37,300 | 714,295.00 | 0.24 |
| 107 | 000997 | 新大陆 | 37,725 | 713,002.50 | 0.24 |
| 108 | 300724 | 捷佳伟创 | 6,300 | 707,805.00 | 0.23 |
| 109 | 300567 | 精测电子 | 7,398 | 703,919.70 | 0.23 |
| 110 | 688561 | 奇安信 | 13,508 | 699,849.48 | 0.23 |
| 111 | 600372 | 中航电子 | 45,811 | 695,410.98 | 0.23 |
| 112 | 600285 | 羚锐制药 | 43,047 | 691,334.82 | 0.23 |
| 113 | 002409 | 雅克科技 | 9,400 | 685,072.00 | 0.23 |
| 114 | 601601 | 中国太保 | 26,200 | 680,676.00 | 0.22 |
| 115 | 600426 | 华鲁恒升 | 22,120 | 677,535.60 | 0.22 |
| 116 | 002531 | 天顺风能 | 44,073 | 671,231.79 | 0.22 |
| 117 | 601668 | 中国建筑 | 116,920 | 671,120.80 | 0.22 |
| 118 | 000762 | 西藏矿业 | 22,300 | 660,749.00 | 0.22 |
| 119 | 688177 | 百奥泰 | 24,543 | 655,543.53 | 0.22 |
| 120 | 002938 | 鹏鼎控股 | 26,700 | 648,543.00 | 0.21 |
| 121 | 688029 | 南微医学 | 7,939 | 647,504.84 | 0.21 |
| 122 | 002185 | 华天科技 | 69,726 | 641,479.20 | 0.21 |
| 123 | 300388 | 节能国祯 | 95,060 | 637,852.60 | 0.21 |
| 124 | 600138 | 中青旅 | 50,930 | 637,134.30 | 0.21 |
| 125 | 002444 | 巨星科技 | 29,100 | 636,708.00 | 0.21 |
| 126 | 688233 | 神工股份 | 20,034 | 632,673.72 | 0.21 |
| 127 | 301028 | 东亚机械 | 56,729 | 632,528.35 | 0.21 |
| 128 | 600817 | 宇通重工 | 56,300 | 629,997.00 | 0.21 |
| 129 | 603239 | 浙江仙通 | 38,700 | 629,649.00 | 0.21 |
| 130 | 688003 | 天准科技 | 14,090 | 628,836.70 | 0.21 |
| 131 | 002215 | 诺普信 | 82,563 | 620,048.13 | 0.20 |
| 132 | 002714 | 牧原股份 | 14,624 | 616,401.60 | 0.20 |
| 133 | 603068 | 博通集成 | 21,405 | 612,611.10 | 0.20 |
| 134 | 002707 | 众信旅游 | 80,437 | 605,690.61 | 0.20 |
| 135 | 300144 | 宋城演艺 | 48,420 | 600,408.00 | 0.20 |
| 136 | 600887 | 伊利股份 | 21,100 | 597,552.00 | 0.20 |
| 137 | 002236 | 大华股份 | 30,200 | 596,450.00 | 0.20 |
| 138 | 300890 | 翔丰华 | 14,400 | 591,840.00 | 0.20 |
| 139 | 603489 | 八方股份 | 8,400 | 589,008.00 | 0.19 |
| 140 | 600029 | 南方航空 | 97,328 | 586,887.84 | 0.19 |
| 141 | 601600 | 中国铝业 | 106,500 | 584,685.00 | 0.19 |
| 142 | 600637 | 东方明珠 | 74,600 | 583,372.00 | 0.19 |
| 143 | 601799 | 星宇股份 | 4,602 | 568,807.20 | 0.19 |
| 144 | 002353 | 杰瑞股份 | 22,500 | 565,425.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 145 | 688167 | 炬光科技 | 5,207 | 560,012.85 | 0.18 |
| 146 | 300133 | 华策影视 | 77,800 | 551,602.00 | 0.18 |
| 147 | 600060 | 海信视像 | 22,245 | 550,563.75 | 0.18 |
| 148 | 603136 | 天目湖 | 21,335 | 550,443.00 | 0.18 |
| 149 | 601166 | 兴业银行 | 34,200 | 535,230.00 | 0.18 |
| 150 | 600559 | 老白干酒 | 21,800 | 534,318.00 | 0.18 |
| 151 | 002065 | 东华软件 | 75,500 | 533,030.00 | 0.18 |
| 152 | 300896 | 爱美客 | 1,186 | 527,710.70 | 0.17 |
| 153 | 002212 | 天融信 | 53,376 | 517,747.20 | 0.17 |
| 154 | 688223 | 晶科能源 | 36,778 | 517,098.68 | 0.17 |
| 155 | 300365 | 恒华科技 | 67,800 | 515,958.00 | 0.17 |
| 156 | 603876 | 鼎胜新材 | 26,640 | 511,221.60 | 0.17 |
| 157 | 300413 | 芒果超媒 | 14,900 | 509,729.00 | 0.17 |
| 158 | 000792 | 盐湖股份 | 26,500 | 508,005.00 | 0.17 |
| 159 | 002101 | 广东鸿图 | 25,900 | 507,122.00 | 0.17 |
| 160 | 600420 | 国药现代 | 44,858 | 506,446.82 | 0.17 |
| 161 | 603131 | 上海沪工 | 39,800 | 497,898.00 | 0.16 |
| 162 | 000049 | 德赛电池 | 13,807 | 487,110.96 | 0.16 |
| 163 | 300207 | 欣旺达 | 29,703 | 484,752.96 | 0.16 |
| 164 | 300911 | 亿田智能 | 12,400 | 470,828.00 | 0.16 |
| 165 | 600050 | 中国联通 | 97,700 | 468,960.00 | 0.15 |
| 166 | 002195 | 二三四五 | 159,053 | 459,663.17 | 0.15 |
| 167 | 605507 | 国邦医药 | 21,602 | 459,474.54 | 0.15 |
| 168 | 605208 | 永茂泰 | 45,480 | 455,709.60 | 0.15 |
| 169 | 688235 | 百济神州 | 4,083 | 445,496.13 | 0.15 |
| 170 | 000983 | 山西焦煤 | 48,800 | 444,080.00 | 0.15 |
| 171 | 600196 | 复星医药 | 14,300 | 441,870.00 | 0.15 |
| 172 | 600803 | 新奥股份 | 23,275 | 441,759.50 | 0.15 |
| 173 | 605111 | 新洁能 | 9,940 | 432,588.80 | 0.14 |
| 174 | 600745 | 闻泰科技 | 8,500 | 415,650.00 | 0.14 |
| 175 | 600703 | 三安光电 | 23,900 | 412,036.00 | 0.14 |
| 176 | 002585 | 双星新材 | 32,500 | 408,200.00 | 0.13 |
| 177 | 002475 | 立讯精密 | 12,491 | 405,332.95 | 0.13 |
| 178 | 603345 | 安井食品 | 2,730 | 400,764.00 | 0.13 |
| 179 | 301367 | 怡和嘉业 | 2,700 | 400,518.00 | 0.13 |
| 180 | 300168 | 万达信息 | 34,600 | 392,018.00 | 0.13 |
| 181 | 603885 | 吉祥航空 | 25,100 | 387,293.00 | 0.13 |
| 182 | 002727 | 一心堂 | 14,600 | 385,440.00 | 0.13 |
| 183 | 600258 | 首旅酒店 | 20,300 | 384,685.00 | 0.13 |
| 184 | 002559 | 亚威股份 | 43,091 | 382,648.08 | 0.13 |
| 185 | 600153 | 建发股份 | 34,600 | 377,486.00 | 0.12 |
| 186 | 688508 | 芯朋微 | 6,491 | 376,413.09 | 0.12 |
| 187 | 688365 | 光云科技 | 25,910 | 373,622.20 | 0.12 |
| 188 | 600603 | 广汇物流 | 52,960 | 368,601.60 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 189 | 002468 | 申通快递 | 33,900 | 366,798.00 | 0.12 |
| 190 | 300129 | 泰胜风能 | 38,100 | 365,379.00 | 0.12 |
| 191 | 002739 | 万达电影 | 29,000 | 363,660.00 | 0.12 |
| 192 | 300709 | 精研科技 | 14,507 | 357,887.69 | 0.12 |
| 193 | 600571 | 信雅达 | 39,050 | 356,917.00 | 0.12 |
| 194 | 300346 | 南大光电 | 10,173 | 349,849.47 | 0.12 |
| 195 | 002380 | 科远智慧 | 14,900 | 347,170.00 | 0.11 |
| 196 | 002202 | 金风科技 | 32,451 | 344,629.62 | 0.11 |
| 197 | 600271 | 航天信息 | 24,600 | 336,774.00 | 0.11 |
| 198 | 600958 | 东方证券 | 34,122 | 330,983.40 | 0.11 |
| 199 | 603605 | 珀莱雅 | 2,852 | 320,564.80 | 0.11 |
| 200 | 301035 | 润丰股份 | 4,038 | 317,265.66 | 0.10 |
| 201 | 688232 | 新点软件 | 5,826 | 313,497.06 | 0.10 |
| 202 | 688267 | 中触媒 | 14,801 | 311,857.07 | 0.10 |
| 203 | 000538 | 云南白药 | 5,920 | 310,681.60 | 0.10 |
| 204 | 000963 | 华东医药 | 7,051 | 305,801.87 | 0.10 |
| 205 | 000488 | 晨鸣纸业 | 62,750 | 304,337.50 | 0.10 |
| 206 | 600150 | 中国船舶 | 9,100 | 299,481.00 | 0.10 |
| 207 | 600066 | 宇通客车 | 20,300 | 299,222.00 | 0.10 |
| 208 | 600373 | 中文传媒 | 22,456 | 299,113.92 | 0.10 |
| 209 | 601311 | 骆驼股份 | 32,200 | 298,816.00 | 0.10 |
| 210 | 600109 | 国金证券 | 34,277 | 297,181.59 | 0.10 |
| 211 | 002903 | 宇环数控 | 11,500 | 294,630.00 | 0.10 |
| 212 | 002690 | 美亚光电 | 11,380 | 293,035.00 | 0.10 |
| 213 | 603358 | 华达科技 | 15,300 | 291,618.00 | 0.10 |
| 214 | 000034 | 神州数码 | 10,799 | 287,145.41 | 0.09 |
| 215 | 600176 | 中国巨石 | 20,116 | 284,842.56 | 0.09 |
| 216 | 002815 | 崇达技术 | 22,847 | 284,445.15 | 0.09 |
| 217 | 688503 | 聚和材料 | 2,848 | 277,680.00 | 0.09 |
| 218 | 001979 | 招商蛇口 | 21,300 | 277,539.00 | 0.09 |
| 219 | 002479 | 富春环保 | 58,099 | 270,741.34 | 0.09 |
| 220 | 603508 | 思维列控 | 15,440 | 263,252.00 | 0.09 |
| 221 | 002636 | 金安国纪 | 28,500 | 263,055.00 | 0.09 |
| 222 | 603825 | 华扬联众 | 19,700 | 261,813.00 | 0.09 |
| 223 | 600507 | 方大特钢 | 56,322 | 260,770.86 | 0.09 |
| 224 | 688049 | 炬芯科技 | 7,076 | 260,396.80 | 0.09 |
| 225 | 600585 | 海螺水泥 | 10,900 | 258,766.00 | 0.09 |
| 226 | 601766 | 中国中车 | 39,700 | 258,050.00 | 0.09 |
| 227 | 002241 | 歌尔股份 | 14,400 | 255,600.00 | 0.08 |
| 228 | 688303 | 大全能源 | 6,252 | 252,893.40 | 0.08 |
| 229 | 300603 | 立昂技术 | 20,552 | 252,378.56 | 0.08 |
| 230 | 600332 | 白云山 | 7,900 | 251,852.00 | 0.08 |
| 231 | 300068 | 南都电源 | 12,700 | 245,872.00 | 0.08 |
| 232 | 300468 | 四方精创 | 22,649 | 242,570.79 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 233 | 300017 | 网宿科技 | 33,700 | 239,607.00 | 0.08 |
| 234 | 605286 | 同力日升 | 8,200 | 237,144.00 | 0.08 |
| 235 | 600436 | 片仔癀 | 800 | 229,088.00 | 0.08 |
| 236 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 20,500 | 224,475.00 | 0.07 |
| 237 | 300770 | 新媒股份 | 4,888 | 224,163.68 | 0.07 |
| 238 | 688271 | 联影医疗 | 1,620 | 223,576.20 | 0.07 |
| 239 | 601989 | 中国重工 | 46,100 | 222,202.00 | 0.07 |
| 240 | 300406 | 九强生物 | 9,411 | 219,558.63 | 0.07 |
| 241 | 301327 | 华宝新能 | 2,768 | 218,976.48 | 0.07 |
| 242 | 600409 | 三友化工 | 39,800 | 216,910.00 | 0.07 |
| 243 | 601555 | 东吴证券 | 31,011 | 215,216.34 | 0.07 |
| 244 | 002405 | 四维图新 | 18,196 | 210,709.68 | 0.07 |
| 245 | 688779 | 长远锂科 | 18,311 | 206,364.97 | 0.07 |
| 246 | 688361 | 中科飞测 | 2,524 | 204,877.22 | 0.07 |
| 247 | 300113 | 顺网科技 | 11,787 | 202,854.27 | 0.07 |
| 248 | 600826 | 兰生股份 | 19,504 | 200,306.08 | 0.07 |
| 249 | 300957 | 贝泰妮 | 2,238 | 198,913.44 | 0.07 |
| 250 | 002035 | 华帝股份 | 27,802 | 197,394.20 | 0.07 |
| 251 | 688083 | 中望软件 | 1,362 | 197,340.18 | 0.07 |
| 252 | 002624 | 完美世界 | 11,550 | 195,079.50 | 0.06 |
| 253 | 300979 | 华利集团 | 3,991 | 194,521.34 | 0.06 |
| 254 | 603596 | 伯特利 | 2,400 | 190,224.00 | 0.06 |
| 255 | 603583 | 捷昌驱动 | 8,800 | 189,552.00 | 0.06 |
| 256 | 600580 | 卧龙电驱 | 12,969 | 189,477.09 | 0.06 |
| 257 | 688472 | 阿特斯 | 10,364 | 188,914.20 | 0.06 |
| 258 | 002036 | 联创电子 | 19,437 | 188,733.27 | 0.06 |
| 259 | 300502 | 新易盛 | 2,758 | 187,461.26 | 0.06 |
| 260 | 300122 | 智飞生物 | 4,200 | 185,640.00 | 0.06 |
| 261 | 300628 | 亿联网络 | 5,292 | 185,590.44 | 0.06 |
| 262 | 002027 | 分众传媒 | 27,142 | 184,837.02 | 0.06 |
| 263 | 300607 | 拓斯达 | 12,056 | 181,201.68 | 0.06 |
| 264 | 688197 | 首药控股 | 3,801 | 181,155.66 | 0.06 |
| 265 | 300100 | 双林股份 | 19,490 | 180,867.20 | 0.06 |
| 266 | 603496 | 恒为科技 | 9,398 | 176,494.44 | 0.06 |
| 267 | 002279 | 久其软件 | 27,300 | 175,539.00 | 0.06 |
| 268 | 601318 | 中国平安 | 3,779 | 175,345.60 | 0.06 |
| 269 | 600273 | 嘉化能源 | 18,611 | 175,315.62 | 0.06 |
| 270 | 600031 | 三一重工 | 10,500 | 174,615.00 | 0.06 |
| 271 | 002110 | 三钢闽光 | 41,134 | 173,585.48 | 0.06 |
| 272 | 603283 | 赛腾股份 | 3,900 | 173,550.00 | 0.06 |
| 273 | 002044 | 美年健康 | 24,313 | 172,865.43 | 0.06 |
| 274 | 000725 | 京东方 A | 42,244 | 172,777.96 | 0.06 |
| 275 | 000786 | 北新建材 | 7,000 | 171,570.00 | 0.06 |
| 276 | 688180 | 君实生物 | 4,411 | 169,999.94 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 277 | 603929 | 亚翔集成 | 10,100 | 169,680.00 | 0.06 |
| 278 | 002075 | 沙钢股份 | 42,300 | 169,623.00 | 0.06 |
| 279 | 600352 | 浙江龙盛 | 18,100 | 169,235.00 | 0.06 |
| 280 | 600808 | 马钢股份 | 65,300 | 167,821.00 | 0.06 |
| 281 | 000967 | 盈峰环境 | 33,100 | 167,155.00 | 0.06 |
| 282 | 688362 | 甬矽电子 | 4,979 | 165,750.91 | 0.05 |
| 283 | 688011 | 新光光电 | 6,376 | 164,628.32 | 0.05 |
| 284 | 603839 | 安正时尚 | 21,580 | 162,281.60 | 0.05 |
| 285 | 600071 | 凤凰光学 | 7,500 | 157,425.00 | 0.05 |
| 286 | 688332 | 中科蓝讯 | 1,878 | 157,151.04 | 0.05 |
| 287 | 000877 | 天山股份 | 19,100 | 155,474.00 | 0.05 |
| 288 | 688166 | 博瑞医药 | 6,970 | 153,270.30 | 0.05 |
| 289 | 600673 | 东阳光 | 21,200 | 152,852.00 | 0.05 |
| 290 | 002007 | 华兰生物 | 6,800 | 152,388.00 | 0.05 |
| 291 | 601995 | 中金公司 | 4,251 | 150,995.52 | 0.05 |
| 292 | 300140 | 中环装备 | 16,400 | 149,240.00 | 0.05 |
| 293 | 300385 | 雪浪环境 | 23,800 | 145,656.00 | 0.05 |
| 294 | 688099 | 晶晨股份 | 1,724 | 145,367.68 | 0.05 |
| 295 | 000636 | 风华高科 | 9,400 | 144,196.00 | 0.05 |
| 296 | 300595 | 欧普康视 | 4,760 | 143,704.40 | 0.05 |
| 297 | 688443 | 智翔金泰 | 4,592 | 141,285.52 | 0.05 |
| 298 | 600869 | 远东股份 | 25,295 | 139,628.40 | 0.05 |
| 299 | 601717 | 郑煤机 | 11,100 | 138,195.00 | 0.05 |
| 300 | 601233 | 桐昆股份 | 10,360 | 137,270.00 | 0.05 |
| 301 | 000910 | 大亚圣象 | 17,500 | 136,675.00 | 0.05 |
| 302 | 603195 | 公牛集团 | 1,419 | 136,309.14 | 0.04 |
| 303 | 300390 | 天华新能 | 3,770 | 134,966.00 | 0.04 |
| 304 | 688183 | 生益电子 | 11,077 | 134,031.70 | 0.04 |
| 305 | 688582 | 芯动联科 | 2,897 | 133,935.15 | 0.04 |
| 306 | 603626 | 科森科技 | 19,047 | 133,709.94 | 0.04 |
| 307 | 300137 | 先河环保 | 23,320 | 131,991.20 | 0.04 |
| 308 | 002955 | 鸿合科技 | 5,600 | 131,880.00 | 0.04 |
| 309 | 002196 | 方正电机 | 18,565 | 130,697.60 | 0.04 |
| 310 | 002074 | 国轩高科 | 4,660 | 128,709.20 | 0.04 |
| 311 | 603558 | 健盛集团 | 15,500 | 128,030.00 | 0.04 |
| 312 | 603968 | 醋化股份 | 7,200 | 127,872.00 | 0.04 |
| 313 | 300769 | 德方纳米 | 1,152 | 126,984.96 | 0.04 |
| 314 | 600114 | 东睦股份 | 16,436 | 125,242.32 | 0.04 |
| 315 | 603197 | 保隆科技 | 2,300 | 124,775.00 | 0.04 |
| 316 | 000876 | 新希望 | 10,600 | 123,808.00 | 0.04 |
| 317 | 600183 | 生益科技 | 8,714 | 123,738.80 | 0.04 |
| 318 | 300973 | 立高食品 | 1,795 | 122,813.90 | 0.04 |
| 319 | 688330 | 宏力达 | 3,287 | 115,307.96 | 0.04 |
| 320 | 300866 | 安克创新 | 1,299 | 113,662.50 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 321 | 688229 | 博睿数据 | 2,185 | 109,118.90 | 0.04 |
| 322 | 600380 | 健康元 | 8,500 | 108,035.00 | 0.04 |
| 323 | 688286 | 敏芯股份 | 1,681 | 105,869.38 | 0.03 |
| 324 | 301395 | 仁信新材 | 3,897 | 103,971.96 | 0.03 |
| 325 | 301210 | 金杨股份 | 2,007 | 102,585.15 | 0.03 |
| 326 | 301280 | 珠城科技 | 2,838 | 101,486.88 | 0.03 |
| 327 | 000825 | 太钢不锈 | 25,800 | 99,846.00 | 0.03 |
| 328 | 300463 | 迈克生物 | 6,600 | 99,792.00 | 0.03 |
| 329 | 000898 | 鞍钢股份 | 34,700 | 96,466.00 | 0.03 |
| 330 | 600690 | 海尔智家 | 4,100 | 96,268.00 | 0.03 |
| 331 | 688289 | 圣湘生物 | 5,654 | 95,213.36 | 0.03 |
| 332 | 688127 | 蓝特光学 | 5,322 | 93,826.86 | 0.03 |
| 333 | 688061 | 灿瑞科技 | 1,775 | 93,773.25 | 0.03 |
| 334 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,356 | 93,721.68 | 0.03 |
| 335 | 688459 | 哈铁科技 | 9,349 | 90,124.36 | 0.03 |
| 336 | 301200 | 大族数控 | 2,227 | 88,812.76 | 0.03 |
| 337 | 688114 | 华大智造 | 1,013 | 87,685.28 | 0.03 |
| 338 | 688439 | 振华风光 | 778 | 85,439.96 | 0.03 |
| 339 | 002127 | 南极电商 | 22,292 | 85,378.36 | 0.03 |
| 340 | 601825 | 沪农商行 | 15,480 | 84,366.00 | 0.03 |
| 341 | 301206 | 三元生物 | 2,359 | 82,541.41 | 0.03 |
| 342 | 301376 | 致欧科技 | 3,494 | 82,391.30 | 0.03 |
| 343 | 301356 | 天振股份 | 3,753 | 82,190.70 | 0.03 |
| 344 | 301189 | 奥尼电子 | 2,462 | 75,312.58 | 0.02 |
| 345 | 301355 | 南王科技 | 4,247 | 75,118.85 | 0.02 |
| 346 | 301232 | 飞沃科技 | 1,232 | 74,488.60 | 0.02 |
| 347 | 301115 | 建科股份 | 3,250 | 74,295.00 | 0.02 |
| 348 | 002009 | 天奇股份 | 4,898 | 73,861.84 | 0.02 |
| 349 | 688603 | 天承科技 | 1,321 | 72,655.00 | 0.02 |
| 350 | 688275 | 万润新能 | 802 | 72,444.66 | 0.02 |
| 351 | 301386 | 未来电器 | 2,884 | 72,217.41 | 0.02 |
| 352 | 301281 | 科源制药 | 2,683 | 70,433.22 | 0.02 |
| 353 | 301261 | 恒工精密 | 1,889 | 69,704.10 | 0.02 |
| 354 | 603529 | 爱玛科技 | 2,141 | 68,983.02 | 0.02 |
| 355 | 301176 | 逸豪新材 | 4,011 | 68,908.98 | 0.02 |
| 356 | 301203 | 国泰环保 | 1,906 | 67,950.25 | 0.02 |
| 357 | 301202 | 朗威股份 | 2,608 | 67,338.56 | 0.02 |
| 358 | 301108 | 洁雅股份 | 1,848 | 66,897.60 | 0.02 |
| 359 | 688131 | 皓元医药 | 1,173 | 66,837.54 | 0.02 |
| 360 | 001301 | 尚太科技 | 1,164 | 65,544.84 | 0.02 |
| 361 | 688429 | 时创能源 | 2,268 | 64,540.26 | 0.02 |
| 362 | 688576 | 西山科技 | 489 | 63,902.54 | 0.02 |
| 363 | 688623 | 双元科技 | 671 | 61,299.33 | 0.02 |
| 364 | 002123 | 梦网科技 | 4,600 | 61,134.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 365 | 688391 | 钜泉科技 | 854 | 58,635.64 | 0.02 |
| 366 | 688234 | 天岳先进 | 774 | 57,229.56 | 0.02 |
| 367 | 688192 | 迪哲医药 | 1,605 | 55,693.50 | 0.02 |
| 368 | 600925 | 苏能股份 | 8,960 | 55,283.20 | 0.02 |
| 369 | 002349 | 精华制药 | 5,914 | 53,403.42 | 0.02 |
| 370 | 688334 | 西高院 | 2,986 | 52,569.81 | 0.02 |
| 371 | 301345 | 涛涛车业 | 1,094 | 52,077.04 | 0.02 |
| 372 | 301337 | 亚华电子 | 1,528 | 51,745.11 | 0.02 |
| 373 | 688105 | 诺唯赞 | 1,635 | 49,851.15 | 0.02 |
| 374 | 688570 | 天玛智控 | 1,809 | 47,773.87 | 0.02 |
| 375 | 688228 | 开普云 | 902 | 46,326.72 | 0.02 |
| 376 | 301170 | 锡南科技 | 953 | 34,961.28 | 0.01 |
| 377 | 300570 | 太辰光 | 600 | 32,826.00 | 0.01 |
| 378 | 688620 | 安凯微 | 2,281 | 29,767.54 | 0.01 |
| 379 | 688767 | 博拓生物 | 1,033 | 29,399.18 | 0.01 |
| 380 | 301265 | 华新环保 | 2,489 | 28,922.18 | 0.01 |
| 381 | 601065 | 江盐集团 | 1,907 | 25,100.62 | 0.01 |
| 382 | 001324 | 长青科技 | 1,131 | 23,764.29 | 0.01 |
| 383 | 301368 | 丰立智能 | 337 | 23,317.03 | 0.01 |
| 384 | 301293 | 三博脑科 | 286 | 20,426.12 | 0.01 |
| 385 | 603235 | 天新药业 | 572 | 17,937.92 | 0.01 |
| 386 | 301399 | 英特科技 | 321 | 17,346.97 | 0.01 |
| 387 | 301325 | 曼恩斯特 | 150 | 16,192.50 | 0.01 |
| 388 | 605296 | 神农集团 | 740 | 15,850.80 | 0.01 |
| 389 | 301358 | 湖南裕能 | 363 | 15,569.07 | 0.01 |
| 390 | 688469 | 中芯集成 | 2,753 | 14,893.73 | 0.00 |
| 391 | 603095 | 越剑智能 | 882 | 13,626.90 | 0.00 |
| 392 | 603162 | 海通发展 | 774 | 13,196.70 | 0.00 |
| 393 | 301121 | 紫建电子 | 227 | 11,495.28 | 0.00 |
| 394 | 301296 | 新巨丰 | 681 | 11,495.28 | 0.00 |
| 395 | 603836 | 海程邦达 | 733 | 11,266.21 | 0.00 |
| 396 | 301171 | 易点天下 | 509 | 11,248.90 | 0.00 |
| 397 | 301328 | 维峰电子 | 194 | 11,046.36 | 0.00 |
| 398 | 300868 | 杰美特 | 593 | 10,792.60 | 0.00 |
| 399 | 301141 | 中科磁业 | 246 | 10,501.74 | 0.00 |
| 400 | 301377 | 鼎泰高科 | 453 | 10,419.00 | 0.00 |
| 401 | 301303 | 真兰仪表 | 450 | 10,044.00 | 0.00 |
| 402 | 300877 | 金春股份 | 569 | 10,037.16 | 0.00 |
| 403 | 301277 | 新天地 | 509 | 9,930.59 | 0.00 |
| 404 | 001287 | 中电港 | 470 | 9,879.40 | 0.00 |
| 405 | 301382 | 蜂助手 | 294 | 9,654.96 | 0.00 |
| 406 | 301398 | 星源卓镁 | 255 | 9,562.50 | 0.00 |
| 407 | 001206 | 依依股份 | 629 | 9,309.20 | 0.00 |
| 408 | 001222 | 源飞宠物 | 608 | 9,199.04 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 409 | 001368 | 通达创智 | 351 | 8,922.42 | 0.00 |
| 410 | 688507 | 索辰科技 | 73 | 8,914.03 | 0.00 |
| 411 | 301307 | 美利信 | 275 | 8,761.50 | 0.00 |
| 412 | 301207 | 华兰疫苗 | 258 | 8,581.08 | 0.00 |
| 413 | 688552 | 航天南湖 | 362 | 8,507.00 | 0.00 |
| 414 | 301118 | 恒光股份 | 315 | 8,419.95 | 0.00 |
| 415 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 416 | 301373 | 凌玮科技 | 253 | 8,058.05 | 0.00 |
| 417 | 301305 | 朗坤环境 | 406 | 7,994.14 | 0.00 |
| 418 | 603408 | 建霖家居 | 762 | 7,917.18 | 0.00 |
| 419 | 301290 | 东星医疗 | 242 | 7,756.10 | 0.00 |
| 420 | 688512 | 慧智微 | 390 | 7,472.40 | 0.00 |
| 421 | 301338 | 凯格精机 | 190 | 7,391.00 | 0.00 |
| 422 | 301323 | 新莱福 | 185 | 7,281.60 | 0.00 |
| 423 | 300889 | 爱克股份 | 479 | 7,170.63 | 0.00 |
| 424 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 425 | 688631 | 莱斯信息 | 233 | 6,959.71 | 0.00 |
| 426 | 301319 | 唯特偶 | 115 | 6,882.75 | 0.00 |
| 427 | 301318 | 维海德 | 205 | 6,877.75 | 0.00 |
| 428 | 601061 | 中信金属 | 895 | 6,784.10 | 0.00 |
| 429 | 301439 | 泓淋电力 | 351 | 5,931.90 | 0.00 |
| 430 | 688479 | 友车科技 | 194 | 5,721.06 | 0.00 |
| 431 | 601121 | 宝地矿业 | 732 | 5,592.48 | 0.00 |
| 432 | 301219 | 腾远钴业 | 131 | 4,894.16 | 0.00 |
| 433 | 601133 | 柏诚股份 | 295 | 3,616.70 | 0.00 |
| 434 | 001328 | 登康口腔 | 135 | 3,441.15 | 0.00 |
| 435 | 001282 | 三联锻造 | 104 | 3,435.12 | 0.00 |
| 436 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 437 | 603125 | 常青科技 | 100 | 2,453.00 | 0.00 |
| 438 | 001367 | 海森药业 | 54 | 2,131.92 | 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 | 688036 | 传音控股 | 3,167,109.15 | 1.07 |
| 2 | 000063 | 中兴通讯 | 2,743,713.00 | 0.93 |
| 3 | 600633 | 浙数文化 | 2,238,539.43 | 0.76 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 2,235,578.00 | 0.76 |
| 5 | 688111 | 金山办公 | 1,975,786.52 | 0.67 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6 | 002984 | 森麒麟 | 1,827,293.00 | 0.62 |
| 7 | 000938 | 紫光股份 | 1,769,996.00 | 0.60 |
| 8 | 601689 | 拓普集团 | 1,526,748.11 | 0.52 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 1,503,344.00 | 0.51 |
| 10 | 300820 | 英杰电气 | 1,463,676.00 | 0.49 |
| 11 | 300533 | 冰川网络 | 1,265,057.50 | 0.43 |
| 12 | 688008 | 澜起科技 | 1,229,538.26 | 0.42 |
| 13 | 600372 | 中航电子 | 1,218,140.00 | 0.41 |
| 14 | 002230 | 科大讯飞 | 1,208,309.00 | 0.41 |
| 15 | 002373 | 千方科技 | 1,089,062.00 | 0.37 |
| 16 | 600570 | 恒生电子 | 945,284.00 | 0.32 |
| 17 | 300378 | 鼎捷软件 | 904,106.00 | 0.31 |
| 18 | 688153 | 唯捷创芯 | 874,603.24 | 0.30 |
| 19 | 601333 | 广深铁路 | 804,554.00 | 0.27 |
| 20 | 601601 | 中国太保 | 786,539.00 | 0.27 |

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 | 000977 | 浪潮信息 | 8,487,517.99 | 2.87 |
| 2 | 600760 | 中航沈飞 | 5,686,029.00 | 1.92 |
| 3 | 002025 | 航天电器 | 3,927,700.00 | 1.33 |
| 4 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,556,217.00 | 0.86 |
| 5 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,142,219.00 | 0.72 |
| 6 | 300450 | 先导智能 | 1,838,906.00 | 0.62 |
| 7 | 688349 | 三一重能 | 1,394,640.13 | 0.47 |
| 8 | 002013 | 中航机电 | 1,363,905.46 | 0.46 |
| 9 | 600071 | 凤凰光学 | 1,324,762.00 | 0.45 |
| 10 | 300502 | 新易盛 | 1,156,496.20 | 0.39 |
| 11 | 601728 | 中国电信 | 1,109,487.00 | 0.37 |
| 12 | 600988 | 赤峰黄金 | 1,093,526.96 | 0.37 |
| 13 | 600038 | 中直股份 | 1,023,886.00 | 0.35 |
| 14 | 600803 | 新奥股份 | 1,003,022.00 | 0.34 |
| 15 | 000776 | 广发证券 | 998,961.00 | 0.34 |
| 16 | 300308 | 中际旭创 | 818,636.33 | 0.28 |
| 17 | 600372 | 中航电子 | 783,899.66 | 0.26 |
| 18 | 688229 | 博睿数据 | 678,904.29 | 0.23 |
| 19 | 300570 | 太辰光 | 575,185.00 | 0.19 |
| 20 | 601238 | 广汽集团 | 519,751.00 | 0.18 |

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

单位：人民币元

| | |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 45,796,207.06 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 58,654,337.02 |

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） | 269,458.20 | 0.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 269,458.20 | 0.09 |

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 | 113641 | 华友转债 | 1,370 | 149,427.74 | 0.05 |
| 2 | 123176 | 精测转 2 | 347 | 61,073.06 | 0.02 |
| 3 | 118034 | 晶能转债 | 370 | 46,938.78 | 0.02 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----|-----------|------|
| 4 | 123179 | 立高转债 | 101 | 12,018.62 | 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 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），并根据风险资产投资（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，以对冲风险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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

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 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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 | 11,221.34 |
| 2 | 应收清算款 | 485,305.89 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 69,823.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 566,350.40 |

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 | 113641 | 华友转债 | 149,427.74 | 0.05 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | | |
|------|----------|-----------|-------|--------|-------|--------|--|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 | |
| | | | | | | | |

| | | | | | | |
|-------------|--------|-----------|------|-------|----------------|---------|
| 华安物联网主题股票 A | 10,929 | 23,071.81 | 0.00 | 0.00% | 252,151,796.18 | 100.00% |
| 华安物联网主题股票 C | 105 | 3,333.21 | 0.00 | 0.00% | 349,986.95 | 100.00% |
| 合计 | 11,034 | 22,883.98 | 0.00 | 0.00% | 252,501,783.13 | 100.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华安物联网主题股票 A | 519,533.65 | 0.21% |
| | 华安物联网主题股票 C | 28,583.21 | 8.17% |
| | 合计 | 548,116.86 | 0.22% |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 华安物联网主题股票 A | 50~100 |
| | 华安物联网主题股票 C | - |
| | 合计 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华安物联网主题股票 A | 50~100 |
| | 华安物联网主题股票 C | - |
| | 合计 | 50~100 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安物联网主题股票 A | 华安物联网主题股票 C |
|--------------------------------|------------------|-------------|
| 基金合同生效日（2015 年 3 月 17 日）基金份额总额 | 4,787,382,240.64 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 261,296,096.13 | 50,015.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,197,762.96 | 531,156.03 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 15,342,062.91 | 231,184.79 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 252,151,796.18 | 349,986.95 |

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：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理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及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中泰证券 | 1 | 26,993,263.13 | 27.82% | 24,868.77 | 27.68% | - |
| 国泰君安证券 | 2 | 20,721,494.72 | 21.36% | 19,091.11 | 21.25% | - |
| 华安证券 | 1 | 13,695,054.82 | 14.12% | 12,754.40 | 14.20% | - |
| 国盛证券 | 1 | 11,628,909.93 | 11.99% | 10,830.20 | 12.05% | - |
| 华泰证券 | 1 | 11,544,610.63 | 11.90% | 10,750.86 | 11.97% | - |
| 中信建投 | 2 | 6,893,611.59 | 7.11% | 6,419.85 | 7.15% | - |
| 方正证券 | 3 | 2,339,392.00 | 2.41% | 2,155.23 | 2.40% | - |
| 兴业证券 | 1 | 1,511,242.71 | 1.56% | 1,407.51 | 1.57% | - |
| 天风证券 | 2 | 989,730.85 | 1.02% | 911.83 | 1.01% | - |
| 长江证券 | 2 | 698,915.90 | 0.72% | 650.94 | 0.72% | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 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，最大限度地调动物体资源，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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|-----------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 44,800.00 | 33.87% | - | - | - | - |
| 华安证券 | 50,480.18 | 38.16% | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 37,000.00 | 27.97% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中山证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 财信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|------------------------------------|-------------------------|------------|
| 1 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中直股份”股票估值调整的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-01-06 |
| 2 | 华安物联网主题股票型证券投资基金 2022 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 | 2023-01-20 |
| 3 | 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（亿道信息） | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-02-03 |
| 4 | 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（多利科技） | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-02-17 |
| 5 | 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（宿迁联盛） | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-03-15 |
| 6 | 华安物联网主题股票型证券投资基金 2022 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 | 2023-03-30 |
| 7 | 华安物联网主题股票型证券投资基金 2023 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 | 2023-04-21 |
| 8 | 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（友车科技） | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-05-05 |
| 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(中科飞测) | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指 | 2023-05-13 |

| | | | |
|----|--|-------------------------|------------|
| | | 定媒介 | |
| 10 | 华安物联网主题股票型证券投资基金更新的招募说明书(2023 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 | 2023-05-29 |
| 11 | 华安物联网主题股票型证券投资基金(华安物联网主题股票 A) 基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-05-29 |
| 12 | 华安物联网主题股票型证券投资基金(华安物联网主题股票 C) 基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2023-05-29 |

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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安物联网主题股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安物联网主题股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安物联网主题股票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

12.2 存放地点

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

12.3 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

二〇二三年八月三十日