

华安物联网主题股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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

送出日期：2024 年 3 月 27 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。本年度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 2024 年 03 月 22 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59

8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
8.6 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	72
8.7 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	72
8.8 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	72
8.9 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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	73
§ 9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3 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情况	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	82
12.1 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	82
§ 13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§ 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	
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	246,214,927.03 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	245,833,511.02 份	381,416.01 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	1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、固定收益投资策略 4、股指期货投资策略 5、权证投资策略 6、资产支持证券的投资 7、存托凭证投资策略
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）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年	2022 年 8 月 11 日 (基金合同生效日)- 2022 年 12 月 31 日	2021 年	
	华安物联网主题股票 A	华安物联网主题股票 C	华安物联网主题股票 A	华安物联网主题股票 C	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	8,687,671.06	5,697.94	13,147,548.88	295.38	142,213,567.53	-
本期利润	-26,771.97	-67,674.89	-114,087.6	-5,019.12	116,623,972.75	-

	1.82		92.44			
加权平均 基金份额 本期利润	-0.1062	-0.2279	-0.4237	-0.1495	0.3196	-
本期加权 平均净值 利润率	-9.28%	-20.51%	-33.77%	-12.75%	23.56%	-
本期基金 份额净值 增长率	-9.72%	-10.27%	-26.78%	-15.48%	24.58%	-
3.1.2 期 末数据和 指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供 分配利润	5,318,201 .02	5,355.42	34,593,67 2.65	6,523.23	132,358,1 09.10	-
期末可供 分配基金 份额利润	0.0216	0.0140	0.1324	0.1304	0.4649	-
期末基金 资产净值	251,151,7 12.04	386,771.4 3	295,889,7 68.78	56,538.94	440,085,7 95.44	-
期末基金 份额净值	1.022	1.014	1.132	1.130	1.546	-
3.1.3 累 计期末指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额 累计净值 增长率	2.20%	-24.16%	13.20%	-15.48%	54.60%	-

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、本基金自 2022 年 08 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	①—③	②—④
----	--------------	---------------------	--------------------	----------------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-4.13%	1.01%	-4.94%	0.63%	0.81%	0.38%
过去六个月	-14.83%	1.01%	-8.15%	0.66%	-6.68%	0.35%
过去一年	-9.72%	1.00%	-7.97%	0.65%	-1.75%	0.35%
过去三年	-17.65%	1.31%	-23.17%	0.85%	5.52%	0.46%
过去五年	92.11%	1.49%	15.20%	0.95%	76.91%	0.54%
自基金合同生效 起至今	2.20%	1.74%	-6.33%	1.12%	8.53%	0.62%

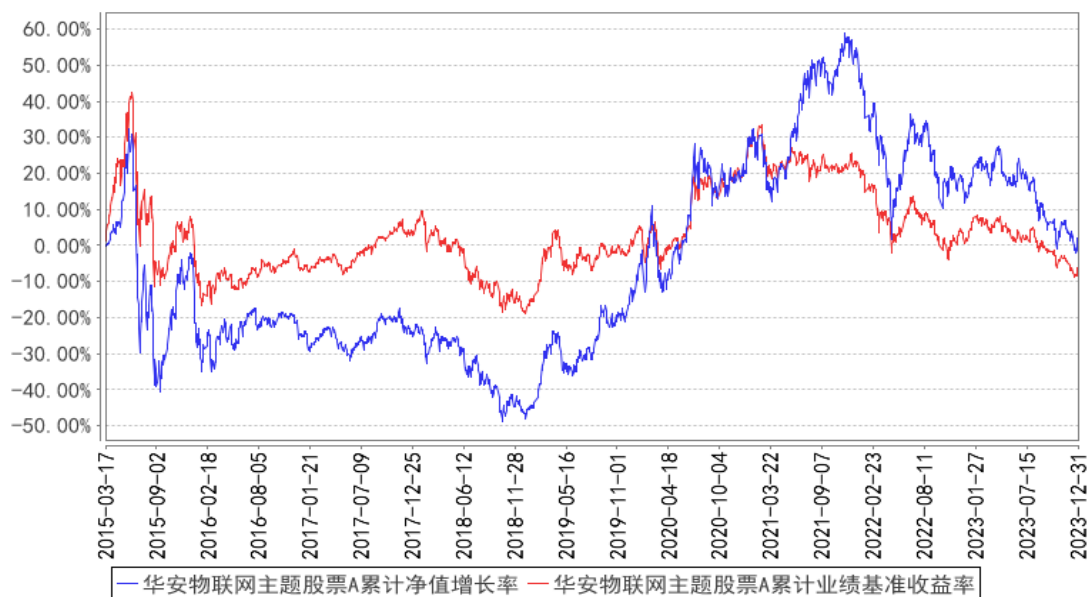
华安物联网主题股票 C

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
过去三个月	-4.34%	1.02%	-4.94%	0.63%	0.60%	0.39%
过去六个月	-15.08%	1.02%	-8.15%	0.66%	-6.93%	0.36%
过去一年	-10.27%	1.00%	-7.97%	0.65%	-2.30%	0.35%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	-24.16%	1.08%	-13.76%	0.72%	- 10.40%	0.36%

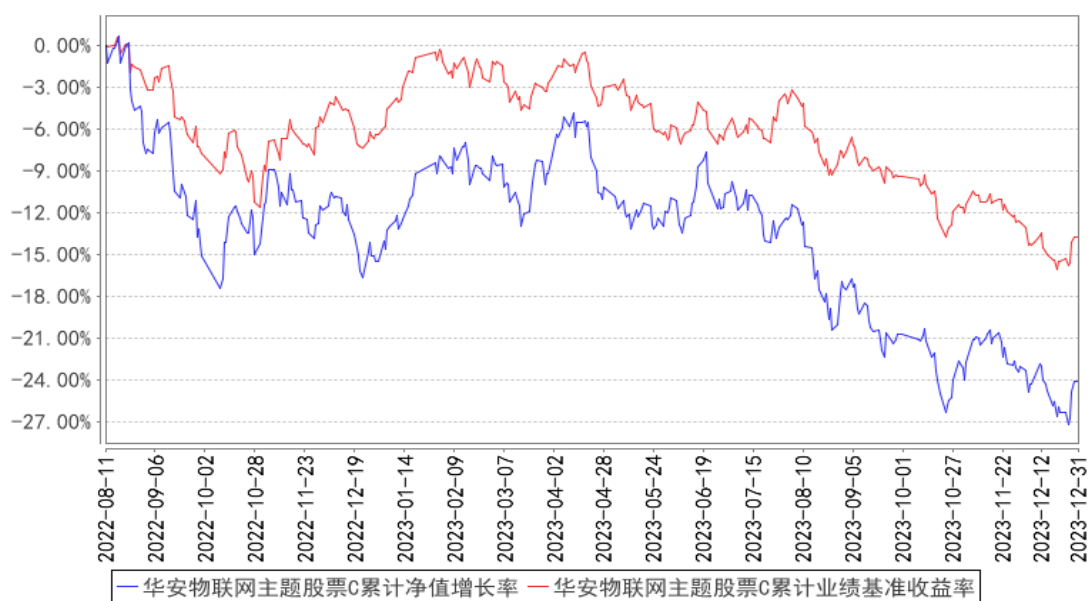
注：本基金自 2022 年 08 月 11 日起新增 C 类基金份额。

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A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



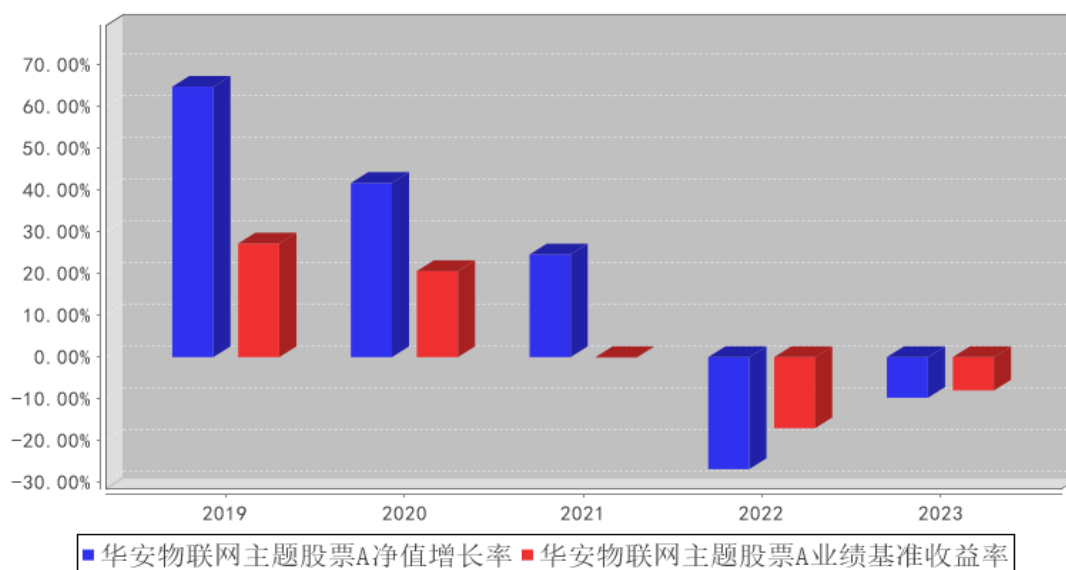
华安物联网主题股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



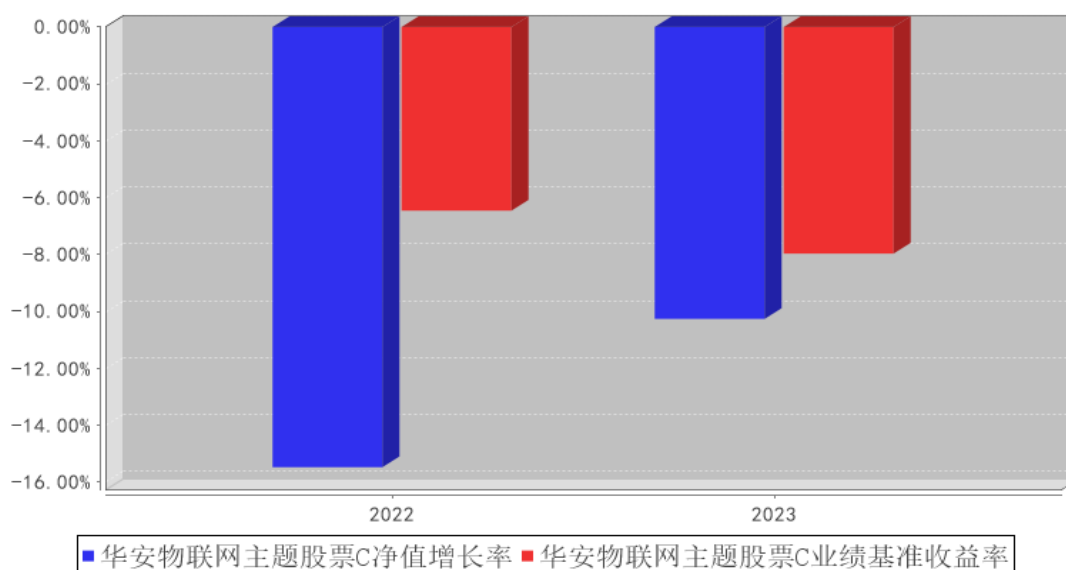
注：华安物联网主题股票型证券投资基金自2022年08月11日起新增C类基金份额。

3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华安物联网主题股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 12 月 31 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 248 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,040.77 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	副总经理、本基金的基金经理	2015 年 3 月 17 日	—	29 年	工业工程学硕士，29 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，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司。2010 年 9 月起担任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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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 8 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 A 股各大指数均有所下跌,且板块分化较为严重。行业方面,通信、传媒、煤炭、家电、石油石化等收益率排名靠前,而消费者服务、房地产、电力设备新能源、建材、化工等行业跌幅较大。报告期内,本基金在契约范围内积极配置科技、高端制造、新能源、医药等板块的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日,本基金 A 类份额净值为 1.022 元,本报告期份额净值增长率为-9.72%,同期业绩比较基准增长率为-7.97%;本基金 C 类份额净值为 1.014 元,本报告期份额净值增长率为-10.27%,同期业绩比较基准增长率为-7.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年国内经济政策定力较强,房地产市场相对疲软,居民消费增速放缓,通胀水平有所回落。展望 2024 年,我们预计总体经济水平稳中有升。海外方面,美国财政政策持续加码,美联储加息超预期,美债收益率高位波动,服务业 PMI 维持强势。欧元区制造业 PMI 低位徘徊,而日本经济则出现了多年未见的通胀持续回升。此外,发展中国家的产业升级持续推进,这也给了国内相关出口型企业不少的发展机会,如智能手机、电表、各种机械设备等领域。

科技创新始终是我们重点关注的方向。2023 年全球科技的最大突破来自于人工智能。以美国的 OpenAI、Google 等公司为代表的企业在 AI 浪潮中取得领先地位,持续发布新版本的 AI 大模型,从文生文到文生图直到文生视频,AI 的应用边界不断拓展。在此过程中,算力网络的建设成

为各大企业的首要任务之一，拉动了算力芯片、服务器、交换机等硬件需求的爆发。以英伟达、微软等公司为代表的美国科技企业营收、股价持续创新高。国内方面，为海外服务器、交换机配套的光模块企业率先收益，充分参与全球分工，实现了较快增长。此外，国内各地算力中心也在加快建设过程中，将进一步拉动算力需求。同时，国内的算力芯片也在加大研发，有望在国内市场占有一席之地。我们在此方向做了重点布局。

高端制造方面，电子行业已经经历了一轮去库存周期，随着手机终端销售的恢复以及 AI 手机、折叠屏手机等新产品的推出，预计部分具有创新能力的消费电子零部件企业和半导体企业有望率先恢复。新能源方面，新能源汽车一直是我们持续关注的行业。中国新能源汽车产业无论在技术、成本还是规模上，都处于世界领先低位，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，汽车智能化可能成为汽车销售的重要推动力量，智能驾驶板块的相关机会同样值得重视。

医药是我们逐步加大配置的一个重要领域。随着医疗反腐逐步进入尾声，医药的正常需求有望得到释放。创新药、医疗器械以及部分化药企业的基本面仍然不错，且经过前期的调整，估值水平来到了较低位置。我们将加大医药行业的布局力度。

此外，低估值高股息板块持续走出超额收益。煤炭、石油、高速公路、电信运营商等是符合这一特征的主要行业，我们对此也进行了重点研究。

展望 2024 年，我们对市场保持谨慎乐观态度，努力寻找结构性机会。我们将密切跟踪科技、高端制造、新能源、医药、高股息等板块的投资机会，选择风险收益比合适的标的进行投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作：

在合规风控方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在内审稽核方面，定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、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。

4.8 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。

4.9 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

责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015772_B11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安物联网主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华安物联网主题股票型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华安物联网主题股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安物联网主题股票型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安物联网主题股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	—
其他信息	华安物联网主题股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

	我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估华安物联网主题股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华安物联网主题股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安物联网主题股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华

	安物联网主题股票型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	费泽旭
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 22 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	14,789,354.41	16,501,541.00
结算备付金		—	54,111.55
存出保证金		8,580.64	17,559.51
交易性金融资产	7.4.7.2	237,307,457.81	280,010,309.32
其中：股票投资		237,071,757.38	279,414,938.32
基金投资		—	—
债券投资		235,700.43	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券 投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		—	1,182,203.54
应收股利		—	—
应收申购款		32,116.90	26,093.95

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		252,137,509.76	297,791,818.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,104,047.81
应付赎回款		95,750.70	28,105.72
应付管理人报酬		254,358.88	387,462.76
应付托管费		42,393.13	64,577.14
应付销售服务费		199.02	26.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.51	1.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	206,323.05	261,289.61
负债合计		599,026.29	1,845,511.15
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	246,214,927.03	261,346,111.84
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	5,323,556.44	34,600,195.88
净资产合计		251,538,483.47	295,946,307.72
负债和净资产总计		252,137,509.76	297,791,818.87

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.022 元，基金份额总额 246,214,927.03 份。其中 A 类基金份额净值 1.022 元，份额总额 245,833,511.02 份；C 类基金份额净值 1.014 元，份额总额 381,416.01 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-22,025,356.70	-107,974,976.15
1. 利息收入		60,004.80	55,339.36
其中：存款利息收入	7.4.7.9	60,004.80	55,339.36
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,422,561.56	19,140,214.68
其中：股票投资收益	7.4.7.10	9,887,845.87	15,448,416.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	53,475.60	537,941.09
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	3,481,240.09	3,153,857.22
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-35,533,015.71	-127,240,555.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	25,092.65	70,025.63
减：二、营业总支出		4,814,290.01	6,117,735.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,954,710.62	5,073,505.56
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	659,118.43	845,584.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,953.88	91.36
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		2.08	4.20
8. 其他费用	7.4.7.17	198,505.00	198,550.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-26,839,646.71	-114,092,711.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-26,839,646.71	-114,092,711.56

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-26,839,646.71	-114,092,711.56

7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	261,346,111.84	-	34,600,195.88	295,946,307.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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)	-15,131,184.81	-	-29,276,639.44	-44,407,824.25
(一)、综合收益总额	-	-	-26,839,646.71	-26,839,646.71
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-15,131,184.81	-	-2,436,992.73	-17,568,177.54
其中：1. 基金申购款	12,479,574.97	-	1,862,143.67	14,341,718.64
2. 基金赎回款	-27,610,759.78	-	-4,299,136.40	-31,909,896.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	246,214,927.03	-	5,323,556.44	251,538,483.47
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	284,720,339.18	-	155,365,456.26	440,085,795.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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)	-23,374,227.34	-	- 120,765,260.38	-144,139,487.72
(一)、综合收益总额	-	-	- 114,092,711.56	-114,092,711.56
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-23,374,227.34	-	-6,672,548.82	-30,046,776.16
其中：1. 基金申购款	20,504,144.85	-	5,523,201.03	26,027,345.88
2. 基金赎回款	-43,878,372.19	-	-12,195,749.85	-56,074,122.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	261,346,111.84	-	34,600,195.88	295,946,307.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

基金管理人负责人

朱学华

主管会计工作负责人

陈松一

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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： $80\% \times \text{中证800指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最底层输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并

在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效

(2) 不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,789,354.41	16,501,541.00
等于：本金	14,787,946.68	16,499,924.99
加：应计利息	1,407.73	1,616.01
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	14,789,354.41	16,501,541.00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	257,282,708.92	-	237,071,757.38	-20,210,951.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	229,600.00	399.43	235,700.43	5,701.00
交易所市场				

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	229,600.00	399.43	235,700.43	5,701.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		257,512,308.92	399.43	237,307,457.81	-20,205,250.54
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		264,105,290.85	-	279,414,938.32	15,309,647.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	570,245.00	7,008.30	595,371.00	18,117.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	570,245.00	7,008.30	595,371.00	18,117.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		264,675,535.85	7,008.30	280,010,309.32	15,327,765.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	70.35	46.24

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	26,252.70	81,243.37
其中：交易所市场	26,252.70	81,243.37
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	206,323.05	261,289.61

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安物联网主题股票 A

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	261,296,096.13	261,296,096.13
本期申购	11,631,138.85	11,631,138.85
本期赎回（以“-”号填列）	-27,093,723.96	-27,093,723.96
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	245,833,511.02	245,833,511.02

华安物联网主题股票 C

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,015.71	50,015.71
本期申购	848,436.12	848,436.12
本期赎回（以“-”号填列）	-517,035.82	-517,035.82
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	381,416.01	381,416.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安物联网主题股票 A

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	134,148,478.67	-99,554,806.02	34,593,672.65
本期利润	8,687,671.06	-35,459,642.88	-26,771,971.82
本期基金份额交易产生的变动数	-8,260,516.55	5,757,016.74	-2,503,499.81
其中：基金申购款	6,279,818.83	-4,550,821.48	1,728,997.35
基金赎回款	-14,540,335.38	10,307,838.22	-4,232,497.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	134,575,633.18	-129,257,432.16	5,318,201.02

华安物联网主题股票 C

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	25,579.79	-19,056.56	6,523.23
本期利润	5,697.94	-73,372.83	-67,674.89
本期基金份额交易产生的变动数	174,268.01	-107,760.93	66,507.08
其中：基金申购款	454,275.10	-321,128.78	133,146.32
基金赎回款	-280,007.09	213,367.85	-66,639.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	205,545.74	-200,190.32	5,355.42

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	59,166.33	54,267.22
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	625.75	771.09
其他	212.72	301.05
合计	60,004.80	55,339.36

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	9,887,845.87	15,448,416.37

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	9,887,845.87	15,448,416.37

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总 额	76,733,932.48	109,671,619.54
减：卖出股票成本 总额	66,648,260.95	93,904,837.25
减：交易费用	197,825.66	318,365.92
买卖股票差价收 入	9,887,845.87	15,448,416.37

7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利 息收入	3,577.13	84,359.41
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	49,898.47	453,581.68
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	53,475.60	537,941.09

7.4.7.11.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	652,682.16	16,886,168.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	592,845.00	16,128,479.73
减：应计利息总额	9,928.96	304,042.33
减：交易费用	9.73	64.83
买卖债券差价收入	49,898.47	453,581.68

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	3,481,240.09	3,153,857.22
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	3,481,240.09	3,153,857.22

7.4.7.14 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
------	---------------------------------	--------------------------------------

1. 交易性金融资产	-35,533,015.71	-127,240,555.82
股票投资	-35,520,599.01	-127,043,764.55
债券投资	-12,416.70	-196,791.27
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	-35,533,015.71	-127,240,555.82

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	23,370.03	64,872.99
基金转换费收入	1,722.62	5,152.64
合计	25,092.65	70,025.63

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	505.00	550.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	198,505.00	198,550.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东、基金代销机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	27,357,320.21	21.84	16,756,174.37	9.24

7.4.10.1.2 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	366,877.18	74.11	459,725.28	2.47

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	25,194.98	21.70	6,103.87	23.25
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	15,330.01	9.16	3,567.85	4.39

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,954,710.62	5,073,505.56
其中：应支付销售机构的客户维 护费	1,668,754.09	2,125,275.44
应支付基金管理人的净管理费	2,285,956.53	2,948,230.12

注：2023年7月10日前，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；2023年7月10日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。计算方法如下：

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

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	659,118.43	845,584.29

注：2023 年 7 月 10 日前，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；2023 年 7 月 10 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	104.58	104.58
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	104.58	104.58
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 12 月 31 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	-	4.30	4.30
合计	-	4.30	4.30

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：

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

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	14,789,354.41	59,166.33	16,501,541.00	54,267.22

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。

7.4.10.7 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 12 月 31 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	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13

股份有限公司					
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	1,935	65,770.65
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	2,524	59,566.40
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	2,436	92,470.56
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688347	华虹公司	网下申购	9,441	490,932.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	3,645	102,060.00
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,136	29,229.28
国泰君安证券股份有限公司	123225	翔丰转债	老股东配售	829	82,900.00
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	1,786	57,062.70
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	3,536	39,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	603170	宝立食品	网下申购	542	5,447.10
国泰君安证券股份有限公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368	75,207.44
国泰君安证券股份有限公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920	75,569.60
国泰君安证券股份有限公司	688031	星环科技	网下申购	5,433	258,484.21
国泰君安证券股份有限公司	688459	哈铁科技	网下申购	9,349	127,594.22
国泰君安证券股份有限公司	603182	嘉华股份	网下申购	546	5,760.30
国泰君安证券	301263	泰恩康	网下申购	5,178	103,197.54

股份有限公司					
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	1,980	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	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	001238	浙江正特	网下申购	374	6,002.70

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	1-6 个月（含）	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	1-6 个月（含）	新股限售	53.63	75.36	48	2,574.24	3,617.28	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	1-6 个月（含）	新股限售	41.18	48.64	92	3,788.56	4,474.88	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	1-6 个月（含）	新股限售	41.00	44.16	60	2,460.00	2,649.60	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1-6 个月（含）	新股限售	25.82	31.80	261	6,739.02	8,299.80	-
301210	金杨股	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月（含）	新股限售	57.88	45.48	201	11,633.88	9,141.48	-

	份	日		售						
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	新股限售	28.88	34.59	244	7,046.72	8,439.96	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6个月(含)	新股限售	36.90	50.85	189	6,974.10	9,610.65	-
301329	信音电子	2023年7月5日	1-6个月(含)	新股限售	21.00	22.23	383	8,043.00	8,514.09	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	1-6个月(含)	新股限售	55.68	37.58	162	9,020.16	6,087.96	-
301372	科净源	2023年8月3日	1-6个月(含)	新股限售	45.00	43.59	208	9,360.00	9,066.72	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	26.68	18.69	390	10,405.20	7,289.10	-
301413	安培龙	2023年12月11日	1-6个月(含)	新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	1-6个月(含)	新股限售	51.88	50.20	151	7,833.88	7,580.20	-
301421	波长光电	2023年8月16日	1-6个月(含)	新股限售	29.38	59.37	284	8,343.92	16,861.08	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	1-6个月(含)	新股限售	37.96	30.39	244	9,262.24	7,415.16	-
301459	丰茂股	2023年12月6日	1-6个月(含)	新股限售	31.90	39.84	173	5,518.70	6,892.32	-

	份	日		售						
301468	博盈特焊	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股限售	47.58	30.22	261	12,418.38	7,887.42	-
301469	恒达新材	2023年8月10日	1-6个月(含)	新股限售	36.58	33.09	267	9,766.86	8,835.03	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	1-6个月(含)	新股限售	39.78	69.09	236	9,388.08	16,305.24	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	1-6个月(含)	新股限售	41.66	64.11	123	5,124.18	7,885.53	-
301499	维科精密	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	1-6个月(含)	新股限售	10.00	15.85	684	6,840.00	10,841.40	-
301508	中机认检	2023年11月23日	1-6个月(含)	新股限售	16.82	26.68	360	6,055.20	9,604.80	-
301511	德福科技	2023年8月8日	1-6个月(含)	新股限售	28.00	22.67	365	10,220.00	8,274.55	-
301516	中远通	2023年12月1日	1-6个月(含)	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股限售	26.87	43.69	132	3,546.84	5,767.08	-

	达	日		售						
301519	舜禹股份	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股限售	20.93	20.21	390	8,162.70	7,881.90	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股限售	67.88	52.74	96	6,516.48	5,063.04	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	1-6个月(含)	新股限售	99.57	81.46	82	8,164.74	6,679.72	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	1-6个月(含)	新股限售	36.60	37.88	151	5,526.60	5,719.88	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	1-6个月(含)	新股限售	66.80	58.99	86	5,744.80	5,073.14	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	1-6个月(含)	新股限售	37.56	43.57	136	5,108.16	5,925.52	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	1-6个月(含)	新股限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023年9月21日	1-6个月(含)	新股限售	7.33	13.40	992	7,271.36	13,292.80	-
301559	中集环科	2023年9月26日	1-6个月(含)	新股限售	24.22	18.24	271	6,563.62	4,943.04	-
301568	思泰克	2023年11月21日	1-6个月(含)	新股限售	23.23	35.58	217	5,040.91	7,720.86	-
301578	辰奕智	2023年12月21日	1-6个月(含)	新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-

	能	日		售						
601083	锦江 航运	2023 年 11 月 28 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	11.25	11.07	354	3,982.50	3,918.78	-
601096	宏盛 华源	2023 年 12 月 15 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	1.70	4.06	1,850	3,145.00	7,511.00	-
603075	热威 股份	2023 年 9 月 1 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	23.10	23.31	107	2,471.70	2,494.17	-
603107	上海 汽配	2023 年 10 月 25 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	14.23	18.19	150	2,134.50	2,728.50	-
603119	浙江 荣泰	2023 年 7 月 21 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	15.32	23.87	162	2,481.84	3,866.94	-
603193	润本 股份	2023 年 10 月 9 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	17.38	16.66	162	2,815.56	2,698.92	-
603231	索宝 蛋白	2023 年 12 月 6 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	21.29	21.53	109	2,320.61	2,346.77	-
603276	恒兴 新材	2023 年 9 月 18 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.73	24.88	114	2,933.22	2,836.32	-
603296	华勤 技术	2023 年 8 月 1 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	80.80	77.75	99	7,999.20	7,697.25	-
603373	安邦 护卫	2023 年 12 月 13 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	19.10	34.75	87	1,661.70	3,023.25	-
688347	华虹 公	2023 年 7 月 27	1-6 个 月 (含)	新股 限	52.00	42.06	6,609	343,668.00	277,974.54	-

	司	日		售						
688548	广钢气体	2023年8月8日	1-6个月(含)	新股限售	9.87	12.75	945	9,327.15	12,048.75	-
688563	航材股份	2023年7月12日	1-6个月(含)	新股限售	78.99	60.49	183	14,455.17	11,069.67	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	26.74	38.67	290	7,754.60	11,214.30	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股限售	8.66	11.06	832	7,205.12	9,201.92	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	新股限售	55.00	74.14	133	7,315.00	9,860.62	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股限售	47.29	37.97	157	7,424.53	5,961.29	-
688627	精智达	2023年7月11日	1-6个月(含)	新股限售	46.77	87.72	149	6,968.73	13,070.28	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	1-6个月(含)	新股限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	1-6个月(含)	新股限售	31.95	52.25	179	5,719.05	9,352.75	-
688653	康希通信	2023年11月10日	1-6个月(含)	新股限售	10.50	15.99	566	5,943.00	9,050.34	-
688657	浩辰软	2023年9月25日	1-6个月(含)	新股限售	103.40	78.23	62	6,410.80	4,850.26	-

	件	日		售						
688702	盛科通信	2023年9月6日	1-6个月(含)	新股限售	42.66	48.18	151	6,441.66	7,275.18	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	1-6个月(含)	新股限售	69.98	60.10	88	6,158.24	5,288.80	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	1-6个月(含)	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
123235	亿田转债	2023年12月21日	1个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	604	60,400.00	60,404.37	-
127100	神码转债	2023年12月21日	1个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	221	22,100.00	22,101.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 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，力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

7.4.13.1 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，将风险控制在可承受的范围之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、清算备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,789,354.41	-	-	-	14,789,354.41
存出保证金	8,580.64	-	-	-	8,580.64
交易性金融资产	235,700.43	-	-	237,071,757.38	237,307,457.81
应收申购款	-	-	-	32,116.90	32,116.90
资产总计	15,033,635.48	-	-	237,103,874.28	252,137,509.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	95,750.70	95,750.70
应付管理人报酬	-	-	-	254,358.88	254,358.88
应付托管费	-	-	-	42,393.13	42,393.13
应付销售服务费	-	-	-	199.02	199.02
应交税费	-	-	-	1.51	1.51
其他负债	-	-	-	206,323.05	206,323.05
负债总计	-	-	-	599,026.29	599,026.29
利率敏感度缺口	15,033,635.48	-	-	236,504,847.99	251,538,483.47
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					
货币资金	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					
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
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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.09%(2022 年 12 月 31 日：0.20%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。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。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	237,071,757.38	94.25	279,414,938.32	94.41
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	235,700.43	0.09	188,096.18	0.06
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	237,307,457.81	94.34	279,603,034.50	94.47

注：本表中交易性金融资产—债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	16,585,955.46	19,360,879.58
	业绩比较基准下降	-16,585,955.46	-19,360,879.58

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	236,475,568.55	276,844,663.57
第二层次	102,861.75	2,420,169.34
第三层次	729,027.51	745,476.41
合计	237,307,457.81	280,010,309.32

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	745,476.41	745,476.41

当期购买	-	1,114,888.64	1,114,888.64
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	0.00	0.00
转出第三层次	-	1,375,372.03	1,375,372.03
当期利得或损失总额	-	244,034.49	244,034.49
其中：计入损益的利得或损失	-	244,034.49	244,034.49
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00
期末余额	-	729,027.51	729,027.51
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	6,865.72	6,865.72
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,675,862.51	3,675,862.51
当期购买	-	798,651.03	798,651.03
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,400,239.27	3,400,239.27
当期利得或损失总额	-	-328,797.86	-328,797.86
其中：计入损益的利得或损失	-	-328,797.86	-328,797.86
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	745,476.41	745,476.41
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-53,174.62	-53,174.62

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	729,027.51	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1462-2.1775	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	745,476.41	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2319-2.4756	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	237,071,757.38	94.02
	其中：股票	237,071,757.38	94.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	235,700.43	0.09
	其中：债券	235,700.43	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	14,789,354.41	5.87
8	其他各项资产	40,697.54	0.02
9	合计	252,137,509.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,077,930.52	0.83
B	采矿业	2,654,560.10	1.06
C	制造业	170,402,109.90	67.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,238,229.81	0.49
E	建筑业	769,590.35	0.31
F	批发和零售业	1,312,147.80	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	3,252,690.52	1.29
H	住宿和餐饮业	242,110.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,343,065.79	14.05
J	金融业	12,812,200.67	5.09
K	房地产业	202,989.00	0.08
L	租赁和商务服务业	762,859.17	0.30
M	科学研究和技术服务业	212,370.59	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,192,087.75	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	146,121.13	0.06
R	文化、体育和娱乐业	3,883,269.48	1.54
S	综合	567,424.80	0.23
	合计	237,071,757.38	94.25

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002179	中航光电	162,630	6,342,570.00	2.52
2	000977	浪潮信息	175,547	5,828,160.40	2.32
3	300750	宁德时代	33,480	5,465,944.80	2.17
4	002415	海康威视	136,500	4,739,280.00	1.88
5	600030	中信证券	219,430	4,469,789.10	1.78
6	002709	天赐材料	167,964	4,212,537.12	1.67
7	688036	传音控股	30,228	4,183,555.20	1.66
8	301269	华大九天	38,539	4,079,353.15	1.62
9	688041	海光信息	52,785	3,746,679.30	1.49
10	300316	晶盛机电	83,430	3,678,428.70	1.46
11	688008	澜起科技	58,043	3,410,606.68	1.36
12	300613	富瀚微	73,198	3,106,523.12	1.24
13	688111	金山办公	9,690	3,063,978.00	1.22
14	002230	科大讯飞	65,341	3,030,515.58	1.20
15	603799	华友钴业	91,508	3,013,358.44	1.20
16	600438	通威股份	117,500	2,941,025.00	1.17
17	300014	亿纬锂能	63,700	2,688,140.00	1.07
18	000063	中兴通讯	97,228	2,574,597.44	1.02
19	002371	北方华创	10,303	2,531,550.13	1.01
20	002812	恩捷股份	43,500	2,471,670.00	0.98
21	600845	宝信软件	49,980	2,439,024.00	0.97
22	002466	天齐锂业	43,620	2,433,559.80	0.97
23	600977	中国电影	155,200	1,899,648.00	0.76
24	600584	长电科技	63,400	1,893,124.00	0.75
25	300760	迈瑞医疗	6,400	1,859,840.00	0.74
26	601689	拓普集团	24,900	1,830,150.00	0.73
27	002984	森麒麟	59,100	1,705,035.00	0.68
28	002594	比亚迪	8,300	1,643,400.00	0.65
29	601111	中国国航	222,400	1,632,416.00	0.65
30	300054	鼎龙股份	67,400	1,631,080.00	0.65
31	688981	中芯国际	29,985	1,589,804.70	0.63
32	600633	浙数文化	138,200	1,528,492.00	0.61
33	688385	复旦微电	38,100	1,471,803.00	0.59
34	600536	中国软件	40,170	1,456,564.20	0.58
35	300059	东方财富	101,904	1,430,732.16	0.57
36	300820	英杰电气	23,400	1,340,352.00	0.53
37	000661	长春高新	8,900	1,297,620.00	0.52
38	600486	扬农化工	20,368	1,285,628.16	0.51
39	300223	北京君正	19,808	1,280,587.20	0.51
40	601601	中国太保	53,800	1,279,364.00	0.51
41	002138	顺络电子	47,200	1,274,872.00	0.51
42	603290	斯达半导	6,800	1,230,800.00	0.49

43	600036	招商银行	43,500	1,210,170.00	0.48
44	601012	隆基绿能	52,320	1,198,128.00	0.48
45	002318	久立特材	59,650	1,185,842.00	0.47
46	601688	华泰证券	82,799	1,155,046.05	0.46
47	600111	北方稀土	59,600	1,152,664.00	0.46
48	600563	法拉电子	12,403	1,148,517.80	0.46
49	688187	时代电气	30,880	1,121,870.40	0.45
50	601238	广汽集团	124,500	1,089,375.00	0.43
51	002050	三花智控	37,048	1,089,211.20	0.43
52	603297	永新光学	10,800	1,072,980.00	0.43
53	300533	冰川网络	38,400	1,063,680.00	0.42
54	000938	紫光股份	54,600	1,056,510.00	0.42
55	300308	中际旭创	9,037	1,020,367.67	0.41
56	688177	百奥泰	24,543	1,012,153.32	0.40
57	300661	圣邦股份	11,310	1,006,703.10	0.40
58	002273	水晶光电	72,441	980,851.14	0.39
59	688278	特宝生物	17,433	912,617.55	0.36
60	000999	华润三九	18,300	910,059.00	0.36
61	300438	鹏辉能源	32,100	908,109.00	0.36
62	002555	三七互娱	47,900	900,999.00	0.36
63	688376	美埃科技	22,836	867,539.64	0.34
64	300378	鼎捷软件	40,700	867,317.00	0.34
65	300598	诚迈科技	20,200	867,186.00	0.34
66	300383	光环新网	88,504	860,258.88	0.34
67	002156	通富微电	37,200	860,064.00	0.34
68	002129	TCL 中环	54,875	858,245.00	0.34
69	002460	赣锋锂业	19,996	855,828.80	0.34
70	000513	丽珠集团	24,400	854,244.00	0.34
71	000970	中科三环	82,486	853,730.10	0.34
72	601058	赛轮轮胎	72,600	853,050.00	0.34
73	002965	祥鑫科技	20,600	848,102.00	0.34
74	300033	同花顺	5,400	847,098.00	0.34
75	600905	三峡能源	193,763	846,744.31	0.34
76	688153	唯捷创芯	12,581	824,055.50	0.33
77	688702	盛科通信	16,147	822,271.38	0.33
78	000998	隆平高科	57,600	812,160.00	0.32
79	600259	广晟有色	22,850	810,032.50	0.32
80	000915	华特达因	27,906	808,157.76	0.32
81	603338	浙江鼎力	15,772	807,053.24	0.32
82	601231	环旭电子	53,077	801,993.47	0.32
83	601728	中国电信	147,586	798,440.26	0.32
84	000333	美的集团	14,300	781,209.00	0.31
85	601126	四方股份	55,100	780,216.00	0.31

86	002311	海大集团	17,200	772,452.00	0.31
87	002385	大北农	129,000	768,840.00	0.31
88	688029	南微医学	7,939	768,495.20	0.31
89	300037	新宙邦	16,200	766,260.00	0.30
90	688249	晶合集成	42,726	737,023.50	0.29
91	600285	羚锐制药	43,047	736,534.17	0.29
92	600760	中航沈飞	17,272	728,532.96	0.29
93	688392	骄成超声	8,680	723,998.80	0.29
94	688233	神工股份	20,034	706,999.86	0.28
95	600150	中国船舶	23,900	703,616.00	0.28
96	002215	诺普信	82,563	681,970.38	0.27
97	002850	科达利	8,000	675,680.00	0.27
98	600938	中国海油	32,200	675,234.00	0.27
99	600217	中再资环	154,100	674,958.00	0.27
100	301028	东亚机械	56,729	665,431.17	0.26
101	301095	广立微	8,842	660,762.66	0.26
102	300236	上海新阳	18,716	659,177.52	0.26
103	600837	海通证券	70,262	658,354.94	0.26
104	688012	中微公司	4,273	656,332.80	0.26
105	300567	精测电子	7,398	648,212.76	0.26
106	688141	杰华特	23,345	645,722.70	0.26
107	300433	蓝思科技	48,548	640,833.60	0.25
108	002299	圣农发展	37,300	640,814.00	0.25
109	000762	西藏矿业	22,300	637,780.00	0.25
110	002353	杰瑞股份	22,500	632,475.00	0.25
111	002859	洁美科技	25,300	631,235.00	0.25
112	603068	博通集成	21,405	623,955.75	0.25
113	601877	正泰电器	28,800	619,488.00	0.25
114	000066	中国长城	61,100	618,332.00	0.25
115	300388	节能国祯	95,060	611,235.80	0.24
116	600426	华鲁恒升	22,120	610,290.80	0.24
117	600372	中航机载	45,811	603,788.98	0.24
118	601799	星宇股份	4,602	603,368.22	0.24
119	002714	牧原股份	14,624	602,216.32	0.24
120	002025	航天电器	12,500	600,250.00	0.24
121	002080	中材科技	37,638	599,196.96	0.24
122	688072	拓荆科技	2,587	598,373.10	0.24
123	688167	炬光科技	5,207	593,598.00	0.24
124	002444	巨星科技	26,200	590,024.00	0.23
125	603131	上海沪工	39,800	587,448.00	0.23
126	600038	中直股份	15,172	584,577.16	0.23
127	688235	百济神州	4,083	567,700.32	0.23
128	600887	伊利股份	21,100	564,425.00	0.22

129	601668	中国建筑	116,920	562,385.20	0.22
130	600637	东方明珠	74,600	560,992.00	0.22
131	600029	南方航空	97,328	560,609.28	0.22
132	002236	大华股份	30,200	557,190.00	0.22
133	601138	工业富联	36,800	556,416.00	0.22
134	601166	兴业银行	34,200	554,382.00	0.22
135	002185	华天科技	64,726	551,465.52	0.22
136	688561	奇安信	13,508	541,535.72	0.22
137	600817	宇通重工	56,300	540,480.00	0.21
138	300450	先导智能	21,062	539,187.20	0.21
139	688003	天准科技	14,090	528,656.80	0.21
140	600009	上海机场	16,100	527,758.00	0.21
141	002409	雅克科技	9,400	523,862.00	0.21
142	600570	恒生电子	18,200	523,432.00	0.21
143	002212	天融信	53,376	522,017.28	0.21
144	601600	中国铝业	91,400	515,496.00	0.20
145	002531	天顺风能	44,073	511,246.80	0.20
146	600138	中青旅	47,230	501,582.60	0.20
147	688349	三一重能	17,416	498,445.92	0.20
148	600571	信雅达	36,250	498,437.50	0.20
149	600559	老白干酒	21,800	491,590.00	0.20
150	002195	岩山科技	159,053	488,292.71	0.19
151	000049	德赛电池	17,949	486,776.88	0.19
152	000983	山西焦煤	48,800	482,144.00	0.19
153	002373	千方科技	42,800	479,788.00	0.19
154	300144	宋城演艺	48,420	477,905.40	0.19
155	300911	亿田智能	12,400	466,612.00	0.19
156	300724	捷佳伟创	6,300	466,263.00	0.19
157	002065	东华软件	75,500	465,835.00	0.19
158	600060	海信视像	22,245	464,920.50	0.18
159	603489	八方股份	8,400	461,580.00	0.18
160	300365	恒华科技	67,800	458,328.00	0.18
161	300133	华策影视	77,800	456,686.00	0.18
162	300709	精研科技	14,507	452,473.33	0.18
163	300496	中科创达	5,600	448,336.00	0.18
164	600420	国药现代	44,858	439,159.82	0.17
165	603239	浙江仙通	28,600	436,722.00	0.17
166	002475	立讯精密	12,491	430,314.95	0.17
167	600050	中国联通	97,700	427,926.00	0.17
168	000997	新大陆	21,225	416,222.25	0.17
169	600603	广汇物流	52,960	412,028.80	0.16
170	002938	鹏鼎控股	18,400	410,688.00	0.16
171	301345	涛涛车业	6,594	401,574.60	0.16

172	300207	欣旺达	27,103	400,040.28	0.16
173	002101	广东鸿图	25,900	394,457.00	0.16
174	603136	天目湖	21,335	391,923.95	0.16
175	600803	新奥股份	23,275	391,485.50	0.16
176	300890	翔丰华	11,200	387,296.00	0.15
177	002739	万达电影	29,000	377,580.00	0.15
178	605111	新洁能	9,940	376,030.20	0.15
179	300413	芒果超媒	14,900	375,480.00	0.15
180	600745	闻泰科技	8,500	359,635.00	0.14
181	600196	复星医药	14,300	357,929.00	0.14
182	688031	星环科技	5,433	353,525.31	0.14
183	000792	盐湖股份	22,100	352,495.00	0.14
184	300896	爱美客	1,186	349,075.38	0.14
185	300129	泰胜风能	31,800	342,486.00	0.14
186	002727	一心堂	14,600	338,136.00	0.13
187	600153	建发股份	34,600	333,198.00	0.13
188	600703	三安光电	23,900	331,015.00	0.13
189	301367	怡和嘉业	2,700	328,725.00	0.13
190	688223	晶科能源	36,778	325,853.08	0.13
191	000034	神州数码	10,799	322,998.09	0.13
192	688508	芯朋微	6,491	319,422.11	0.13
193	600109	国金证券	34,277	311,235.16	0.12
194	603197	保隆科技	5,500	310,200.00	0.12
195	688326	经纬恒润	2,659	308,576.95	0.12
196	603885	吉祥航空	25,100	301,200.00	0.12
197	600958	东方证券	34,122	296,861.40	0.12
198	600373	中文传媒	22,456	295,970.08	0.12
199	300168	万达信息	34,600	293,408.00	0.12
200	000963	华东医药	7,051	292,334.46	0.12
201	000538	云南白药	5,920	290,968.00	0.12
202	603496	恒为科技	9,298	289,725.68	0.12
203	605208	永茂泰	30,480	289,560.00	0.12
204	605507	国邦医药	16,402	288,019.12	0.11
205	603345	安井食品	2,730	285,585.30	0.11
206	688267	中触媒	14,801	284,475.22	0.11
207	603605	珀莱雅	2,852	283,488.80	0.11
208	301035	润丰股份	4,038	282,660.00	0.11
209	688365	光云科技	25,910	282,159.90	0.11
210	300346	南大光电	10,173	280,876.53	0.11
211	688347	华虹公司	6,609	277,974.54	0.11
212	603283	赛腾股份	3,800	275,728.00	0.11
213	688049	炬芯科技	7,076	269,383.32	0.11
214	600066	宇通客车	20,300	268,975.00	0.11

215	300017	网宿科技	33,700	264,545.00	0.11
216	002585	双星新材	32,500	263,575.00	0.10
217	603876	鼎胜新材	20,940	262,378.20	0.10
218	600271	航天信息	24,600	261,744.00	0.10
219	600507	方大特钢	56,322	259,644.42	0.10
220	002202	金风科技	32,451	259,608.00	0.10
221	300122	智飞生物	4,200	256,662.00	0.10
222	600114	东睦股份	16,436	254,593.64	0.10
223	002636	金安国纪	28,500	253,935.00	0.10
224	002380	科远智慧	14,900	253,747.00	0.10
225	002405	四维图新	28,096	250,054.40	0.10
226	600585	海螺水泥	10,900	245,904.00	0.10
227	300468	四方精创	22,649	245,741.65	0.10
228	605286	同力日升	8,200	244,852.00	0.10
229	688166	博瑞医药	6,970	243,950.00	0.10
230	000488	晨鸣纸业	62,750	243,470.00	0.10
231	603508	思维列控	15,440	242,408.00	0.10
232	600258	首旅酒店	15,500	242,110.00	0.10
233	603825	华扬联众	19,700	237,976.00	0.09
234	601555	东吴证券	31,011	226,690.41	0.09
235	600332	白云山	7,900	225,940.00	0.09
236	002690	美亚光电	11,380	223,503.20	0.09
237	688271	联影医疗	1,620	221,956.20	0.09
238	002815	崇达技术	22,847	218,874.26	0.09
239	600409	三友化工	39,800	218,502.00	0.09
240	301327	华宝新能	2,768	211,475.20	0.08
241	688232	新点软件	5,826	210,901.20	0.08
242	300979	华利集团	3,991	210,086.24	0.08
243	002468	申通快递	26,900	209,551.00	0.08
244	601766	中国中车	39,700	208,822.00	0.08
245	002559	亚威股份	18,091	208,589.23	0.08
246	603929	亚翔集成	8,500	203,320.00	0.08
247	001979	招商蛇口	21,300	202,989.00	0.08
248	002036	联创电子	19,437	198,451.77	0.08
249	600176	中国巨石	20,116	197,740.28	0.08
250	600436	片仔癀	800	193,592.00	0.08
251	300770	新媒股份	4,888	189,067.84	0.08
252	300607	拓斯达	12,056	188,917.52	0.08
253	688361	中科飞测	2,524	187,861.32	0.07
254	688180	君实生物	4,411	184,512.13	0.07
255	688443	智翔金泰	4,592	183,450.40	0.07
256	002955	鸿合科技	5,600	180,936.00	0.07
257	300406	九强生物	9,411	179,750.10	0.07

258	002279	久其软件	27,300	177,723.00	0.07
259	600808	马钢股份	65,300	177,616.00	0.07
260	603583	捷昌驱动	8,800	176,264.00	0.07
261	002245	蔚蓝锂芯	20,500	174,660.00	0.07
262	002241	歌尔股份	8,200	172,282.00	0.07
263	002027	分众传媒	27,142	171,537.44	0.07
264	002110	三钢闽光	41,134	166,592.70	0.07
265	603596	伯特利	2,400	166,320.00	0.07
266	300113	顺网科技	11,787	165,018.00	0.07
267	000725	京东方 A	42,244	164,751.60	0.07
268	300068	南都电源	12,700	164,338.00	0.07
269	000786	北新建材	7,000	163,520.00	0.07
270	601995	中金公司	4,251	161,750.55	0.06
271	002075	沙钢股份	42,300	161,586.00	0.06
272	600273	嘉化能源	18,611	159,868.49	0.06
273	600183	生益科技	8,714	159,553.34	0.06
274	000967	盈峰环境	33,100	157,225.00	0.06
275	601233	桐昆股份	10,360	156,746.80	0.06
276	300628	亿联网络	5,292	156,378.60	0.06
277	600673	东阳光	21,200	155,396.00	0.06
278	688503	聚和材料	2,848	152,652.80	0.06
279	300957	贝泰妮	2,238	152,564.46	0.06
280	601318	中国平安	3,779	152,293.70	0.06
281	600580	卧龙电驱	12,969	152,126.37	0.06
282	600352	浙江龙盛	18,100	152,040.00	0.06
283	688011	新光光电	6,376	150,792.40	0.06
284	002007	华兰生物	6,800	150,484.00	0.06
285	603558	健盛集团	15,500	150,195.00	0.06
286	002044	美年健康	24,313	146,121.13	0.06
287	600031	三一重工	10,500	144,585.00	0.06
288	688332	中科蓝讯	1,878	141,638.76	0.06
289	601717	郑煤机	11,100	140,415.00	0.06
290	000910	大亚圣象	17,500	140,000.00	0.06
291	002624	完美世界	11,550	136,752.00	0.05
292	300502	新易盛	2,758	136,024.56	0.05
293	603195	公牛集团	1,419	135,727.35	0.05
294	688083	中望软件	1,362	135,573.48	0.05
295	688197	首药控股	2,456	135,546.64	0.05
296	002035	华帝股份	21,502	133,527.42	0.05
297	002196	方正电机	18,565	133,296.70	0.05
298	600071	凤凰光学	5,800	132,878.00	0.05
299	002903	宇环数控	5,200	132,860.00	0.05
300	688627	精智达	1,485	132,214.76	0.05

301	300137	先河环保	23,320	129,659.20	0.05
302	000636	风华高科	9,400	128,404.00	0.05
303	601311	骆驼股份	16,000	128,160.00	0.05
304	000877	天山股份	19,100	127,588.00	0.05
305	301421	波长光电	2,036	126,238.44	0.05
306	688183	生益电子	11,077	125,945.49	0.05
307	688127	蓝特光学	5,322	123,949.38	0.05
308	688548	广钢气体	9,445	123,058.75	0.05
309	300140	节能环境	16,400	120,868.00	0.05
310	688286	敏芯股份	1,681	120,527.70	0.05
311	300866	安克创新	1,299	115,091.40	0.05
312	688582	芯动联科	2,897	112,026.99	0.04
313	688563	航材股份	1,827	111,682.47	0.04
314	688303	大全能源	3,691	109,142.87	0.04
315	688099	晶晨股份	1,724	107,974.12	0.04
316	300595	欧普康视	4,760	107,480.80	0.04
317	600380	健康元	8,500	105,655.00	0.04
318	688229	博睿数据	2,185	105,032.95	0.04
319	603968	醋化股份	7,200	102,312.00	0.04
320	002074	国轩高科	4,660	100,190.00	0.04
321	300463	迈克生物	6,600	99,462.00	0.04
322	000876	新希望	10,600	98,792.00	0.04
323	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.04
324	688779	长远锂科	13,280	96,944.00	0.04
325	000825	太钢不锈	25,800	96,234.00	0.04
326	688330	宏力达	3,287	93,383.67	0.04
327	300973	立高食品	1,795	87,147.25	0.03
328	002127	南极电商	22,292	86,715.88	0.03
329	000898	鞍钢股份	34,700	86,403.00	0.03
330	600690	海尔智家	4,100	86,100.00	0.03
331	301200	大族数控	2,227	84,113.79	0.03
332	688472	阿特斯	6,573	83,016.99	0.03
333	301468	博盈特焊	2,609	79,477.94	0.03
334	603296	华勤技术	987	78,639.57	0.03
335	688192	迪哲医药	1,605	76,799.25	0.03
336	301578	辰奕智能	975	74,222.16	0.03
337	002009	天奇股份	4,898	73,910.82	0.03
338	301568	思泰克	1,667	73,869.86	0.03
339	688061	灿瑞科技	1,775	71,000.00	0.03
340	600869	远东股份	16,095	70,657.05	0.03
341	300769	德方纳米	1,152	70,306.56	0.03
342	688439	振华风光	778	69,327.58	0.03
343	301525	儒竞科技	818	68,783.40	0.03

344	301206	三元生物	2,359	68,127.92	0.03
345	301108	洁雅股份	1,848	63,829.92	0.03
346	301232	飞沃科技	1,232	59,739.68	0.02
347	301511	德福科技	2,545	58,828.75	0.02
348	601825	沪农商行	10,180	58,433.20	0.02
349	301115	建科股份	3,250	58,175.00	0.02
350	601096	宏盛华源	10,797	57,614.20	0.02
351	688719	爱科赛博	872	55,637.28	0.02
352	603529	爱玛科技	2,141	53,610.64	0.02
353	688105	诺唯赞	1,635	52,352.70	0.02
354	301548	崇德科技	854	51,990.26	0.02
355	002123	梦网科技	4,600	51,290.00	0.02
356	688234	天岳先进	774	51,138.18	0.02
357	301559	中集环科	2,704	50,829.42	0.02
358	688657	浩辰软件	611	50,098.84	0.02
359	688275	万润新能	802	49,459.34	0.02
360	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.02
361	688570	天玛智控	1,809	49,222.89	0.02
362	688623	双元科技	671	47,627.58	0.02
363	688576	西山科技	489	47,007.57	0.02
364	688228	开普云	702	45,931.86	0.02
365	688131	皓元医药	824	42,897.44	0.02
366	001301	尚太科技	1,164	42,625.68	0.02
367	688391	钜泉科技	854	42,358.40	0.02
368	688114	华大智造	462	39,741.24	0.02
369	603276	恒兴新材	1,136	29,735.36	0.01
370	603626	科森科技	3,047	27,697.23	0.01
371	688334	西高院	1,479	25,631.07	0.01
372	300570	太辰光	600	23,430.00	0.01
373	605296	神农集团	740	22,740.20	0.01
374	301508	中机认检	700	21,304.20	0.01
375	301516	中远通	1,133	20,588.13	0.01
376	301488	豪恩汽电	236	16,305.24	0.01
377	603095	越剑智能	882	14,306.04	0.01
378	688469	芯联集成	2,753	13,820.06	0.01
379	001358	兴欣新材	292	13,785.60	0.01
380	603162	海通发展	774	13,715.28	0.01
381	688648	中邮科技	574	13,628.72	0.01
382	301558	三态股份	992	13,292.80	0.01
383	300868	杰美特	593	12,879.96	0.01
384	301358	湖南裕能	363	12,323.85	0.00
385	301325	曼恩斯特	150	11,631.00	0.00
386	301141	中科磁业	246	11,448.84	0.00

387	688767	博拓生物	370	11,199.90	0.00
388	301507	民生健康	684	10,841.40	0.00
389	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
390	301382	蜂助手	294	10,472.28	0.00
391	688507	索辰科技	73	9,982.75	0.00
392	001206	依依股份	629	9,925.62	0.00
393	688603	天承科技	133	9,860.62	0.00
394	300877	金春股份	569	9,849.39	0.00
395	301261	恒工精密	189	9,610.65	0.00
396	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
397	301307	美利信	275	9,539.75	0.00
398	688652	京仪装备	179	9,352.75	0.00
399	688620	安凯微	781	9,231.42	0.00
400	688602	康鹏科技	832	9,201.92	0.00
401	301281	科源制药	269	9,156.76	0.00
402	301210	金杨股份	201	9,141.48	0.00
403	301372	科净源	208	9,066.72	0.00
404	688653	康希通信	566	9,050.34	0.00
405	301303	真兰仪表	450	8,860.50	0.00
406	301428	世纪恒通	229	8,850.85	0.00
407	301469	恒达新材	267	8,835.03	0.00
408	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
409	603075	热威股份	361	8,658.75	0.00
410	301329	信音电子	383	8,514.09	0.00
411	688552	航天南湖	362	8,503.38	0.00
412	301399	英特科技	221	8,457.67	0.00
413	301251	威尔高	244	8,439.96	0.00
414	301376	致欧科技	350	8,372.00	0.00
415	301202	朗威股份	261	8,299.80	0.00
416	688631	莱斯信息	233	8,213.25	0.00
417	301489	思泉新材	123	7,885.53	0.00
418	301519	舜禹股份	390	7,881.90	0.00
419	688512	慧智微	390	7,601.10	0.00
420	301418	协昌科技	151	7,580.20	0.00
421	601083	锦江航运	636	7,440.96	0.00
422	301203	国泰环保	191	7,426.08	0.00
423	301456	盘古智能	244	7,415.16	0.00
424	301386	未来电器	289	7,349.27	0.00
425	301305	朗坤环境	406	7,328.30	0.00
426	301395	仁信新材	390	7,289.10	0.00
427	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
428	301318	维海德	205	7,259.05	0.00
429	301207	华兰疫苗	258	7,172.40	0.00

430	301296	新巨丰	681	7,014.30	0.00
431	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
432	688429	时创能源	327	6,929.13	0.00
433	301355	南王科技	455	6,893.25	0.00
434	301459	丰茂股份	173	6,892.32	0.00
435	301323	新莱福	185	6,843.15	0.00
436	301170	锡南科技	216	6,572.88	0.00
437	301337	亚华电子	203	6,213.83	0.00
438	301371	敷尔佳	162	6,087.96	0.00
439	688612	威迈斯	157	5,961.29	0.00
440	301550	斯菱股份	136	5,925.52	0.00
441	301517	陕西华达	132	5,767.08	0.00
442	301529	福赛科技	151	5,719.88	0.00
443	301219	腾远钴业	131	5,157.47	0.00
444	301439	泓淋电力	351	5,131.62	0.00
445	301520	万邦医药	96	5,063.04	0.00
446	001222	源飞宠物	308	4,527.60	0.00
447	688479	友车科技	194	4,524.08	0.00
448	001326	联域股份	92	4,474.88	0.00
449	601133	柏诚股份	295	3,885.15	0.00
450	603119	浙江荣泰	162	3,866.94	0.00
451	001328	登康口腔	135	3,821.85	0.00
452	601061	中信金属	495	3,816.45	0.00
453	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
454	001282	三联锻造	104	3,761.68	0.00
455	601065	江盐集团	321	3,672.24	0.00
456	001306	夏厦精密	48	3,617.28	0.00
457	001360	南矿集团	177	3,078.03	0.00
458	603373	安邦护卫	87	3,023.25	0.00
459	603125	常青科技	100	3,002.00	0.00
460	603107	上海汽配	150	2,728.50	0.00
461	603193	润本股份	162	2,698.92	0.00
462	603231	索宝蛋白	109	2,346.77	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002594	比亚迪	2,360,328.00	0.80
4	600633	浙数文化	2,238,539.43	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	300533	冰川网络	1, 806, 631. 50	0. 61
8	000938	紫光股份	1, 769, 996. 00	0. 60
9	601601	中国太保	1, 552, 371. 00	0. 52
10	601689	拓普集团	1, 526, 748. 11	0. 52
11	300750	宁德时代	1, 503, 344. 00	0. 51
12	300820	英杰电气	1, 463, 676. 00	0. 49
13	688008	澜起科技	1, 229, 538. 26	0. 42
14	600372	中航机载	1, 218, 140. 00	0. 41
15	002230	科大讯飞	1, 208, 309. 00	0. 41
16	002373	千方科技	1, 089, 062. 00	0. 37
17	600570	恒生电子	945, 284. 00	0. 32
18	688702	盛科通信	921, 618. 25	0. 31
19	300378	鼎捷软件	904, 106. 00	0. 31
20	688249	晶合集成	900, 643. 73	0. 30

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。

8.4.2 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, 347, 624. 00	0. 79
6	300450	先导智能	1, 838, 906. 00	0. 62
7	688349	三一重能	1, 641, 583. 72	0. 55
8	600071	凤凰光学	1, 364, 015. 00	0. 46
9	688111	金山办公	1, 233, 483. 90	0. 42
10	002013	中航机电	1, 218, 140. 00	0. 41
11	600038	中直股份	1, 185, 072. 00	0. 40
12	300502	新易盛	1, 156, 496. 20	0. 39
13	601728	中国电信	1, 109, 487. 00	0. 37
14	600988	赤峰黄金	1, 093, 526. 96	0. 37
15	600803	新奥股份	1, 003, 022. 00	0. 34
16	000776	广发证券	998, 961. 00	0. 34
17	300308	中际旭创	818, 636. 33	0. 28
18	600372	中航机载	783, 899. 66	0. 26
19	601333	广深铁路	769, 835. 00	0. 26
20	603358	华达科技	768, 068. 00	0. 26

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

用。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	59,825,679.02
卖出股票收入（成交）总额	76,733,932.48

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。

8.5 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）	235,700.43	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	235,700.43	0.09

8.6 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	142,387.74	0.06
2	123235	亿田转债	604	60,404.37	0.02
3	127100	神码转债	221	22,101.60	0.01
4	123179	立高转债	101	10,806.72	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2023 年 2 月 6 日，中信证券因未按规定履行客户身份识别义务等违法违规事项，被中国人民银行（银罚决字【2023】6 号）给予罚款 1376 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	8,580.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,116.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	40,697.54
---	----	-----------

8.12.4 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	142,387.74	0.06
2	123179	立高转债	10,806.72	0.00

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	10,238	24,011.87	106.39	0.00	245,833,404.63	100.00
华安物联网主题股票 C	119	3,205.18	0.00	0.00	381,416.01	100.00
合计	10,357	23,772.80	106.39	0.00	246,214,820.64	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	1,290,532.26	0.52
	华安物联网主题股票 C	28,583.21	7.49
	合计	1,319,115.47	0.54

9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安物联网主题股票 A	>100
	华安物联网主题股票 C	—
	合计	>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	>100
	华安物联网主题股票 C	—
	合计	>100

§ 10 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	11,631,138.85	848,436.12
减：本报告期基金总赎回份额	27,093,723.96	517,035.82
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	245,833,511.02	381,416.01

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托

管业务部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	27,357,320.21	21.84	25,194.98	21.70	-
中泰证券	1	26,993,263.13	21.55	24,868.77	21.42	-
国盛证券	1	15,521,983.56	12.39	14,466.34	12.46	-
华安证券	1	15,185,190.36	12.12	14,163.93	12.20	-
华泰证券	1	11,544,610.63	9.22	10,750.86	9.26	-
天风证券	2	11,246,880.59	8.98	10,433.01	8.99	-
中信建投	2	7,095,765.8	5.66	6,611.05	5.69	-

		7				
方正证券	3	4,614,151.10	3.68	4,251.02	3.66	-
广发证券	1	2,394,166.04	1.91	2,264.68	1.95	-
兴业证券	1	1,511,242.71	1.21	1,407.51	1.21	-
长江证券	2	698,915.90	0.56	650.94	0.56	-
上海证券	3	567,699.17	0.45	531.35	0.46	-
财通证券	1	427,971.55	0.34	400.67	0.35	-
中信证券	1	103,900.86	0.08	98.29	0.08	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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）财务状况良好，经营行为稳健规范，交易能力较强，近三年无重大违法违规行为，在业内有良好的声誉；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；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰君安	366,877.18	74.11	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	77,714.80	15.70	—	—	—	—
华安证券	50,480.18	10.20	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—

天风证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
财信证 券	-	-	-	-	-	-
诚通证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

粤开证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

11.8 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及基金管理人网站	2023 年 1 月 20 日
2	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及基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
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（多利科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 17 日
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（宿迁联盛）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 15 日
5	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及基金管理人网站	2023 年 3 月 30 日
6	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及基金管理人网站	2023 年 4 月 21 日
7	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及基金管理人网站	2023 年 5 月 5 日
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（中科飞测）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 13 日
9	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及基金管理人网站	2023 年 5 月 29 日
10	华安物联网主题股票型证券投资基金 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 29 日
11	华安物联网主题股票型证券投资基金 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 29 日

		站	
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（盘古智能）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 7 日
13	华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
14	华安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
15	华安物联网主题股票型证券投资基金托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
16	华安物联网主题股票型证券投资基金 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
17	华安物联网主题股票更新的招募说明书(2023 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
18	华安物联网主题股票型证券投资基金 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（维科精密）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 14 日
20	华安物联网主题股票 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
21	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（华虹公司）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 28 日
22	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（德福科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 9 日
23	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 22 日
24	华安物联网主题股票型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 30 日
25	关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 31 日
26	关于终止凤凰金信（海口）基金销	中国证监会基金电子披	2023 年 9 月 1 日

	售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	露网站及基金管理人网站	
27	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（恒兴新材）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 19 日
28	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（翔丰转债）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 12 日
29	华安物联网主题股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 24 日
30	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 10 日
31	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（京仪装备）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 23 日
32	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（锦江航运）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 29 日
33	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（永达股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 5 日
34	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日
35	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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；

13.2 存放地点

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

13.3 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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 3 月 27 日