

# 华安物联网主题股票型证券投资基金

## 2020 年中期报告

### 2020 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：二〇二〇年八月二十八日

## 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 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
<b>8 基金份额持有人信息</b>	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4	基金投资策略的改变 .....	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
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 .....	51
10.8	其他重大事件 .....	52
<b>11</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
11.1	备查文件目录 .....	53
11.2	存放地点 .....	53
11.3	查阅方式 .....	53

## 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	华安物联网主题股票
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	955,401,473.73 份
基金合同存续期	不定期

### 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	薛珍	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼

	-32层	
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（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	132,748,899.48
本期利润	243,251,309.66
加权平均基金份额本期利润	0.2186
本期加权平均净值利润率	22.59%
本期基金份额净值增长率	24.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-97,080,463.51
期末可供分配基金份额利润	-0.1016
期末基金资产净值	1,044,396,935.02
期末基金份额净值	1.093
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.30%

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）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	13.03%	1.26%	6.09%	0.69%	6.94%	0.57%
过去三个月	25.06%	1.50%	10.69%	0.74%	14.37%	0.76%
过去六个月	24.77%	2.12%	3.32%	1.24%	21.45%	0.88%
过去一年	59.10%	1.76%	9.38%	0.99%	49.72%	0.77%
过去三年	49.52%	1.62%	8.19%	1.01%	41.33%	0.61%
自基金合同生效起至今	9.30%	1.96%	5.99%	1.25%	3.31%	0.71%

#### 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2020年6月30日）



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2020 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 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 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	-	25 年	工业工程学硕士，25 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，任全球投资部总监。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 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。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。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。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 月起担任公司总经理助理。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

#### 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 1 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度随着 COVID-19 新冠肺炎疫情的扩散，全球经济受冲击超出预期，风险偏好快速回落，导致全球权益市场巨幅回撤，A 股市场也遭受巨大波动。随着国内外疫情的逐渐控制，中国带领下的全球复工复产是当下市场的主旋律，二季度全球股票市场领先疫情开启反弹修复行情。报告期内，本基金在契约范围内积极配置 5G 及相关产业、半导体、新能源、优质消费等方向的龙头公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.093 元，本报告期份额净值增长率为 24.77%，同期比较基准增长率为 3.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

放眼未来，随着疫情的逐渐控制，全球经济活动也将陆续恢复，同时低利率环境有望较长时间持续，我们认为这个环境比较利好权益类风险资产。横向比较，我们仍然认为中国存在相对优势，一方面中国疫情结束早，复工快，宏观政策空间充足，另一方面 A 股权益资产在全球横向比较中更具吸引力。尽管美国对华的“科技战”可能会长期化，但全球科技周期在 5G 预期的引领下仍然处于上行周期，产业供应链格局正加速发生重构，其实是国内企业取得突破的机遇期。过去一段时间核心消费和科技板块涨幅较大，部分个股存在阶段性超涨现象，我们按照基本面预期和合理估值及时调整组合结构。随着疫情的缓解，经济企稳复苏，下一阶段我们也将关注 PPI 反弹的力道，优质价值龙头个股或许存在受益机会。我们将紧密跟踪未来新冠疫苗的进展、经济走势和货币政策调整。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安物联网主题股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	67,510,764.86	62,380,018.26
结算备付金		238,065.96	173,985.15
存出保证金		114,809.61	111,145.51
交易性金融资产	6.4.7.2	991,153,670.85	1,031,810,063.49
其中：股票投资		989,931,400.08	1,030,241,906.77
基金投资		-	-

债券投资		1,222,270.77	1,568,156.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,326,067.53	593,612.22
应收利息	6.4.7.5	11,869.67	12,043.89
应收股利		-	-
应收申购款		992,256.94	460,373.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,073,347,505.42</b>	<b>1,095,541,242.16</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	656,411.02
应付赎回款		26,657,335.67	3,370,870.00
应付管理人报酬		1,299,089.58	1,353,491.93
应付托管费		216,514.95	225,581.98
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	662,493.95	583,536.11
应交税费		4.77	7.06
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	115,131.48	210,937.05
<b>负债合计</b>		<b>28,950,570.40</b>	<b>6,400,835.15</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	955,401,473.73	1,243,082,494.37
未分配利润	6.4.7.10	88,995,461.29	-153,942,087.36
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,044,396,935.02</b>	<b>1,089,140,407.01</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,073,347,505.42</b>	<b>1,095,541,242.16</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.093 元，基金份额总额 955,401,473.73 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>254,063,997.33</b>	<b>232,555,647.56</b>
1.利息收入		234,385.39	221,402.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	233,544.10	220,102.03
债券利息收入		841.29	1,300.37
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）		142,685,975.49	-34,565,612.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	136,886,501.40	-42,341,216.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	679,445.25	256,957.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	5,120,028.84	7,518,646.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	110,502,410.18	266,802,084.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	641,226.27	97,773.11
<b>减：二、费用</b>		<b>10,812,687.67</b>	<b>9,008,790.84</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	8,049,440.14	6,810,411.98
2. 托管费	6.4.10.2	1,341,573.35	1,135,068.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,301,028.42	947,693.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		3.04	4.25
7. 其他费用	6.4.7.21	120,642.72	115,612.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>243,251,309.66</b>	<b>223,546,856.72</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>243,251,309.66</b>	<b>223,546,856.72</b>

### 6.3 所有者权益（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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,243,082,494.37	-153,942,087.36	1,089,140,407.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	243,251,309.66	243,251,309.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-287,681,020.64	-313,761.01	-287,994,781.65
其中：1.基金申购款	178,476,706.30	-3,420,306.47	175,056,399.83
2.基金赎回款	-466,157,726.94	3,106,545.46	-463,051,181.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	955,401,473.73	88,995,461.29	1,044,396,935.02
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,435,884,212.33	-672,200,879.44	763,683,332.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	223,546,856.72	223,546,856.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-69,752,591.71	21,140,065.59	-48,612,526.12
其中：1.基金申购款	41,028,856.54	-13,290,073.48	27,738,783.06
2.基金赎回款	-110,781,448.25	34,430,139.07	-76,351,309.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,366,131,620.62	-427,513,957.13	938,617,663.49

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安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,由华安基金管理有限公司作为管理人自2015年2月9日至2015年3月13日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第60971571\_B12号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年3月17日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币4,784,476,959.31元,在募集期间产生的存款利息为人民币2,905,281.33元,以上实收基金(本息)合计为人民币4,787,382,240.64元,折合4,787,382,240.64份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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%。本基金业绩比较基准:80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2020年8月25日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 印花税**

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

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

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

##### **6.4.6.2 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定。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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	67,510,764.86
定期存款	-
其他存款	-
合计	67,510,764.86

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		787,812,518.00	989,931,400.08	202,118,882.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,151,700.00	1,222,270.77	70,570.77
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,151,700.00	1,222,270.77	70,570.77
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		788,964,218.00	991,153,670.85	202,189,452.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,375.75
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	96.48
应收债券利息	350.91
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	46.53
合计	11,869.67

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	662,493.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	662,493.95

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,733.10
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	49,726.04
合计	115,131.48

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,243,082,494.37	1,243,082,494.37
本期申购	178,476,706.30	178,476,706.30
本期赎回（以“-”号填列）	-466,157,726.94	-466,157,726.94
本期末	955,401,473.73	955,401,473.73

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-275,013,993.12	121,071,905.76	-153,942,087.36
本期利润	132,748,899.48	110,502,410.18	243,251,309.66
本期基金份额交易产生的变动数	45,184,630.13	-45,498,391.14	-313,761.01
其中：基金申购款	-31,256,328.30	27,836,021.83	-3,420,306.47
基金赎回款	76,440,958.43	-73,334,412.97	3,106,545.46
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-97,080,463.51	186,075,924.80	88,995,461.29
-----	----------------	----------------	---------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	229,991.05
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	2,699.03
其他	854.02
合计	233,544.10

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	515,403,140.93
减：卖出股票成本总额	378,516,639.53
买卖股票差价收入	136,886,501.40

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,572,619.25
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,892,000.00
减：应收利息总额	1,174.00
买卖债券差价收入	679,445.25

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 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。

#### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.15.3 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。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 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。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,120,028.84
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	5,120,028.84

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	110,502,410.18
——股票投资	110,706,496.13
——债券投资	-204,085.95
——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	110,502,410.18
----	----------------

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	563,347.76
转换费收入	77,878.51
合计	641,226.27

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。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,301,028.42
银行间市场交易费用	-
合计	1,301,028.42

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,244.34
账户维护费	9,000.00
合计	120,642.72

**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 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	45,019,552.52	6.22%	123,607,664.89	20.56%

**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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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

		额的比例		额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	1,390,200.00	32.16%	1,114,074.10	22.14%

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	38,322.27	5.78%	38,322.27	5.78%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	112,643.80	20.35%	112,643.80	20.35%

#### 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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,049,440.14	6,810,411.98
其中：支付销售机构的客户维护费	3,432,197.00	2,920,270.92

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,341,573.35	1,135,068.69

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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

无。

##### 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	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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	67,510,764.86	229,991.05	74,796,398.54	215,799.57

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

无。

#### 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（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	处于锁定期	4.88	6.17	906,536.00	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688100	威胜信息	2020-01-09	2020-07-21	处于锁定期	13.78	25.92	11,602.00	159,875.56	300,723.84	-
688177	百奥泰	2020-02-13	2020-08-21	处于锁定期	32.76	57.02	30,158.00	987,976.08	1,719,609.16	-
688178	万德斯	2020-01-06	2020-07-14	处于锁定期	25.20	39.90	3,704.00	93,340.80	147,789.60	-
688298	东方生物	2020-01-20	2020-08-05	处于锁定期	21.25	144.17	5,286.00	112,327.50	762,082.62	-
688505	复旦张江	2020-06-10	2020-12-21	处于锁定期	8.95	24.78	22,688.00	203,057.60	562,208.64	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	网下中签	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	网下中签	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	网下中签	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	网下中签	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688568	中科星图	2020-06-30	2021-01-07	网下中签	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本	期末估值	备注

				限类型				总额	总额	
12811 2	歌尔 转 2	2020-0 6-12	2020-0 7-13	认购 新发 证券	100.00	100.00	6,274. 00	627,40 0.00	627,40 0.00	-
12811 4	正邦 转债	2020-0 6-17	2020-0 7-15	认购 新发 证券	100.00	100.00	1,473. 00	147,30 0.00	147,30 0.00	-
12811 5	巨星 转债	2020-0 6-24	2020-0 7-16	认购 新发 证券	100.00	100.00	407.00	40,700 .00	40,700 .00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2020 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

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总

裁负责，并由督察长分管。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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、存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	67,510,764.86	-	-	-	67,510,764.86
结算备付金	238,065.96	-	-	-	238,065.96
存出保证金	114,809.61	-	-	-	114,809.61
交易性金融资产	1,222,270.77	-	-	989,931,400.08	991,153,670.85
应收证券清算款	-	-	-	13,326,067.53	13,326,067.53
应收利息	-	-	-	11,869.67	11,869.67
应收申购款	-	-	-	992,256.94	992,256.94
资产总计	69,085,911.20	-	-	1,004,261,594.22	1,073,347,505.42
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	26,657,335.67	26,657,335.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,299,089.58	1,299,089.58
应付托管费	-	-	-	216,514.95	216,514.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	662,493.95	662,493.95
应交税费	-	-	-	4.77	4.77
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	115,131.48	115,131.48
负债总计	-	-	-	28,950,570.40	28,950,570.40
利率敏感度缺口	69,085,911.20	-	-	975,311,023.82	1,044,396,935.02
上年度末 2019 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	62,380,018.26	-	-	-	62,380,018.26
结算备付金	173,985.15	-	-	-	173,985.15
存出保证金	111,145.51	-	-	-	111,145.51
交易性金融资产	1,568,156.72	-	-	1,030,241,906.77	1,031,810,063.49
应收证券清算款	-	-	-	593,612.22	593,612.22
应收利息	-	-	-	12,043.89	12,043.89
应收申购款	-	-	-	460,373.64	460,373.64
资产总计	64,233,305.64	-	-	1,031,307,936.52	1,095,541,242.16
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	656,411.02	656,411.02
应付赎回款	-	-	-	3,370,870.00	3,370,870.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,353,491.93	1,353,491.93
应付托管费	-	-	-	225,581.98	225,581.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	583,536.11	583,536.11
应交税费	-	-	-	7.06	7.06
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	210,937.05	210,937.05
负债总计	-	-	-	6,400,835.15	6,400,835.15

利率敏感度缺口	64,233,305.64	-	-	1,024,907,101.37	1,089,140,407.01
---------	---------------	---	---	------------------	------------------

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 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 0.12%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比例

		例 (%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	989,931,400.08	94.78	1,030,241,906 .77	94.59
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	989,931,400.08	94.78	1,030,241,906 .77	94.59

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 8,088	增加约 7,623
	业绩比较基准减少 5%	减少约 8,088	减少约 7,623

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	989,931,400.08	92.23
	其中：股票	989,931,400.08	92.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,222,270.77	0.11
	其中：债券	1,222,270.77	0.11
	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	67,748,830.82	6.31
8	其他各项资产	14,445,003.75	1.35
9	合计	1,073,347,505.42	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	22,748,825.00	2.18
B	采矿业	4,725,432.14	0.45
C	制造业	724,294,578.09	69.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,040,229.82	0.10
E	建筑业	3,322,952.40	0.32
F	批发和零售业	11,324,180.75	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	16,605,433.88	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,697,001.15	11.65
J	金融业	23,024,085.63	2.20

K	房地产业	5,144,561.00	0.49
L	租赁和商务服务业	13,474,195.61	1.29
M	科学研究和技术服务业	5,396,700.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	2,303,817.80	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	637,109.33	0.06
R	文化、体育和娱乐业	29,776,993.88	2.85
S	综合	4,415,303.60	0.42
	合计	989,931,400.08	94.78

### 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	2,142,684	83,950,359.12	8.04
2	300316	晶盛机电	1,272,080	31,471,259.20	3.01
3	300113	顺网科技	1,071,624	27,219,249.60	2.61
4	002709	天赐材料	783,300	26,467,707.00	2.53
5	000063	中兴通讯	651,428	26,141,805.64	2.50
6	601231	环旭电子	958,195	20,926,978.80	2.00
7	000661	长春高新	45,600	19,849,680.00	1.90
8	002129	中环股份	852,800	19,153,888.00	1.83
9	002299	圣农发展	553,300	16,045,700.00	1.54
10	002174	游族网络	566,479	14,773,772.32	1.41
11	300433	蓝思科技	517,948	14,523,261.92	1.39
12	688019	安集科技	37,483	14,418,585.61	1.38
13	002475	立讯精密	274,091	14,074,572.85	1.35
14	600703	三安光电	557,900	13,947,500.00	1.34
15	002555	三七互娱	296,900	13,894,920.00	1.33
16	300054	鼎龙股份	771,100	12,800,260.00	1.23
17	300567	精测电子	186,798	12,748,963.50	1.22
18	300144	宋城演艺	721,220	12,477,106.00	1.19
19	002938	鹏鼎控股	231,100	11,568,866.00	1.11
20	603444	吉比特	20,400	11,199,804.00	1.07

21	300502	新易盛	171,045	10,796,360.40	1.03
22	002138	顺络电子	429,000	10,703,550.00	1.02
23	000636	风华高科	364,700	10,645,593.00	1.02
24	601138	工业富联	690,800	10,465,620.00	1.00
25	002273	水晶光电	578,930	9,922,860.20	0.95
26	300133	华策影视	1,356,600	9,835,350.00	0.94
27	603718	海利生物	517,800	9,455,028.00	0.91
28	603338	浙江鼎力	123,872	9,385,781.44	0.90
29	002511	中顺洁柔	384,510	8,574,573.00	0.82
30	000877	天山股份	561,800	8,483,180.00	0.81
31	002120	韵达股份	338,780	8,283,171.00	0.79
32	002531	天顺风能	1,339,473	8,010,048.54	0.77
33	600882	妙可蓝多	220,500	8,001,945.00	0.77
34	603068	博通集成	97,805	7,881,126.90	0.75
35	000066	中国长城	593,500	7,834,200.00	0.75
36	002185	华天科技	561,926	7,602,858.78	0.73
37	300450	先导智能	156,904	7,250,533.84	0.69
38	002353	杰瑞股份	231,300	7,170,300.00	0.69
39	600030	中信证券	290,900	7,013,599.00	0.67
40	600887	伊利股份	223,900	6,970,007.00	0.67
41	002080	中材科技	439,338	6,809,739.00	0.65
42	002127	南极电商	306,892	6,496,903.64	0.62
43	002241	歌尔股份	211,900	6,221,384.00	0.60
44	002195	二三四五	2,134,053	5,996,688.93	0.57
45	002230	科大讯飞	156,141	5,844,357.63	0.56
46	000997	新大陆	362,325	5,789,953.50	0.55
47	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.54
48	300607	拓斯达	131,220	5,339,341.80	0.51
49	300207	欣旺达	281,303	5,316,626.70	0.51
50	002212	南洋股份	199,200	5,294,736.00	0.51
51	603496	恒为科技	237,955	5,294,498.75	0.51
52	601966	玲珑轮胎	257,475	5,200,995.00	0.50
53	600584	长电科技	165,300	5,168,931.00	0.49
54	603859	能科股份	149,400	5,103,504.00	0.49
55	002415	海康威视	167,000	5,068,450.00	0.49
56	688008	澜起科技	49,795	5,063,155.60	0.48
57	300613	富瀚微	43,380	4,914,954.00	0.47
58	600196	复星医药	135,300	4,579,905.00	0.44
59	600837	海通证券	360,762	4,538,385.96	0.43
60	000963	华东医药	179,051	4,529,990.30	0.43
61	002655	共达电声	357,200	4,522,152.00	0.43
62	600585	海螺水泥	84,000	4,444,440.00	0.43
63	600420	现代制药	454,158	4,373,541.54	0.42
64	600845	宝信软件	73,463	4,340,194.04	0.42

65	300463	迈克生物	73,900	4,303,197.00	0.41
66	600372	中航电子	309,500	4,122,540.00	0.39
67	002876	三利谱	77,370	4,092,873.00	0.39
68	000915	山大华特	124,006	4,061,196.50	0.39
69	002157	正邦科技	230,500	4,029,140.00	0.39
70	600259	广晟有色	134,250	4,027,500.00	0.39
71	000876	新希望	133,000	3,963,400.00	0.38
72	002202	金风科技	396,551	3,953,613.47	0.38
73	300017	网宿科技	455,600	3,868,044.00	0.37
74	300570	太辰光	191,900	3,838,000.00	0.37
75	600109	国金证券	327,277	3,734,230.57	0.36
76	000011	深物业 A	231,800	3,708,800.00	0.36
77	600673	东阳光	533,300	3,685,103.00	0.35
78	300413	芒果超媒	55,400	3,612,080.00	0.35
79	000998	隆平高科	211,700	3,524,805.00	0.34
80	002179	中航光电	85,714	3,515,131.14	0.34
81	300406	九强生物	141,811	3,261,653.00	0.31
82	002567	唐人神	340,800	3,244,416.00	0.31
83	002714	牧原股份	38,760	3,178,320.00	0.30
84	603799	华友钴业	80,368	3,123,100.48	0.30
85	002311	海大集团	65,300	3,107,627.00	0.30
86	002223	鱼跃医疗	82,909	3,017,887.60	0.29
87	000725	京东方 A	636,444	2,972,193.48	0.28
88	300383	光环新网	113,700	2,964,159.00	0.28
89	002624	完美世界	50,800	2,928,112.00	0.28
90	002878	元隆雅图	133,280	2,916,166.40	0.28
91	002812	恩捷股份	43,500	2,862,300.00	0.27
92	002236	大华股份	148,600	2,854,606.00	0.27
93	300223	北京君正	27,808	2,806,939.52	0.27
94	002025	航天电器	76,400	2,794,712.00	0.27
95	002815	崇达技术	136,200	2,755,326.00	0.26
96	300346	南大光电	62,310	2,686,807.20	0.26
97	300760	迈瑞医疗	8,600	2,629,020.00	0.25
98	603283	赛腾股份	47,800	2,571,640.00	0.25
99	688029	南微医学	10,568	2,563,162.72	0.25
100	600760	中航沈飞	77,700	2,550,114.00	0.24
101	000538	云南白药	26,900	2,523,489.00	0.24
102	300196	长海股份	225,506	2,385,853.48	0.23
103	600038	中直股份	57,972	2,380,910.04	0.23
104	300168	万达信息	106,600	2,352,662.00	0.23
105	600217	中再资环	477,800	2,302,996.00	0.22
106	000970	中科三环	234,127	2,289,762.06	0.22
107	603825	华扬联众	71,200	2,289,080.00	0.22
108	002050	三花智控	104,048	2,278,651.20	0.22

109	300750	宁德时代	13,000	2,266,680.00	0.22
110	002035	华帝股份	223,202	2,261,036.26	0.22
111	002013	中航机电	270,400	2,136,160.00	0.20
112	600036	招商银行	63,000	2,124,360.00	0.20
113	603929	亚翔集成	120,000	2,110,800.00	0.20
114	601233	桐昆股份	157,760	2,013,017.60	0.19
115	600285	羚锐制药	214,747	2,007,884.45	0.19
116	300770	新媒股份	8,771	1,961,721.86	0.19
117	600031	三一重工	98,000	1,838,480.00	0.18
118	600050	中国联通	377,700	1,828,068.00	0.18
119	002318	久立特材	250,250	1,826,825.00	0.17
120	600093	易见股份	150,245	1,760,871.40	0.17
121	688177	百奥泰	30,158	1,719,609.16	0.16
122	002955	鸿合科技	56,100	1,705,440.00	0.16
123	601799	星宇股份	13,300	1,689,100.00	0.16
124	600486	扬农化工	20,068	1,655,610.00	0.16
125	000513	丽珠集团	34,400	1,651,544.00	0.16
126	000034	神州数码	67,299	1,638,057.66	0.16
127	002036	联创电子	130,837	1,635,462.50	0.16
128	300595	欧普康视	23,400	1,622,556.00	0.16
129	300709	精研科技	16,574	1,593,590.10	0.15
130	600436	片仔癀	9,300	1,583,325.00	0.15
131	601766	中国中车	281,000	1,565,170.00	0.15
132	002739	万达电影	97,900	1,494,933.00	0.14
133	300059	东方财富	72,600	1,466,520.00	0.14
134	300785	值得买	11,658	1,465,527.18	0.14
135	002371	北方华创	8,503	1,453,247.73	0.14
136	603345	安井食品	12,310	1,452,580.00	0.14
137	300308	中际旭创	22,537	1,419,831.00	0.14
138	300438	鹏辉能源	81,300	1,418,685.00	0.14
139	002215	诺普信	237,163	1,408,748.22	0.13
140	603968	醋化股份	93,900	1,356,855.00	0.13
141	688111	金山办公	3,869	1,321,573.02	0.13
142	603605	珀莱雅	7,155	1,288,043.10	0.12
143	000967	盈峰环境	155,100	1,279,575.00	0.12
144	300140	中环装备	138,400	1,242,832.00	0.12
145	000988	华工科技	49,700	1,214,171.00	0.12
146	601668	中国建筑	254,120	1,212,152.40	0.12
147	600563	法拉电子	19,103	1,180,565.40	0.11
148	002831	裕同科技	42,902	1,180,234.02	0.11
149	600009	上海机场	16,100	1,160,327.00	0.11
150	002466	天齐锂业	49,920	1,145,664.00	0.11
151	002065	东华软件	90,200	1,129,304.00	0.11
152	002570	贝因美	172,500	1,110,900.00	0.11

153	002690	美亚光电	21,100	1,109,860.00	0.11
154	600745	闻泰科技	8,800	1,108,360.00	0.11
155	603214	爱婴室	36,120	1,107,800.40	0.11
156	600332	白云山	33,300	1,076,589.00	0.10
157	300782	卓胜微	2,597	1,053,784.69	0.10
158	603026	石大胜华	39,300	1,048,917.00	0.10
159	601318	中国平安	14,579	1,040,940.60	0.10
160	601166	兴业银行	65,400	1,032,012.00	0.10
161	300468	四方精创	42,008	995,589.60	0.10
162	002075	沙钢股份	76,000	950,000.00	0.09
163	002460	赣锋锂业	17,497	937,314.29	0.09
164	688520	神州细胞	12,351	932,747.52	0.09
165	603508	思维列控	27,300	918,372.00	0.09
166	600153	建发股份	110,500	895,050.00	0.09
167	600803	新奥股份	85,675	885,879.50	0.08
168	300068	南都电源	82,800	882,648.00	0.08
169	300388	国祯环保	95,060	876,453.20	0.08
170	300129	泰胜风能	234,700	861,349.00	0.08
171	600426	华鲁恒升	47,400	838,032.00	0.08
172	600198	大唐电信	51,232	821,761.28	0.08
173	002074	国轩高科	30,160	809,494.40	0.08
174	600271	航天信息	47,000	763,280.00	0.07
175	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.07
176	300603	立昂技术	25,900	759,647.00	0.07
177	002123	梦网集团	38,000	752,400.00	0.07
178	600352	浙江龙盛	56,200	718,798.00	0.07
179	300033	同花顺	5,400	718,632.00	0.07
180	002850	科达利	10,300	712,760.00	0.07
181	002707	众信旅游	98,837	711,626.40	0.07
182	688085	三友医疗	8,807	698,307.03	0.07
183	601699	潞安环能	125,302	697,932.14	0.07
184	000910	大亚圣象	44,800	696,192.00	0.07
185	600136	当代文体	81,995	669,079.20	0.06
186	603708	家家悦	13,230	651,709.80	0.06
187	600977	中国电影	49,200	645,996.00	0.06
188	002727	一心堂	17,200	638,292.00	0.06
189	600895	张江高科	31,300	637,581.00	0.06
190	002044	美年健康	44,213	637,109.33	0.06
191	600183	生益科技	21,614	632,641.78	0.06
192	600138	中青旅	63,130	623,093.10	0.06
193	002640	跨境通	95,588	620,366.12	0.06
194	603989	艾华集团	21,360	619,867.20	0.06
195	002699	美盛文化	100,600	610,642.00	0.06
196	002349	精华制药	112,914	595,056.78	0.06

197	688126	沪硅产业	16,868	578,235.04	0.06
198	300236	上海新阳	9,516	571,530.96	0.05
199	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.05
200	600380	健康元	34,300	557,032.00	0.05
201	002468	申通快递	33,900	556,299.00	0.05
202	600958	东方证券	57,158	542,429.42	0.05
203	600060	海信视像	44,545	541,221.75	0.05
204	003816	中国广核	182,758	540,963.68	0.05
205	600690	海尔智家	30,300	536,310.00	0.05
206	600571	信雅达	58,950	535,855.50	0.05
207	002444	巨星科技	44,500	528,660.00	0.05
208	002405	四维图新	31,896	525,965.04	0.05
209	600580	卧龙电驱	46,469	522,311.56	0.05
210	002024	苏宁易购	59,511	521,911.47	0.05
211	603839	安正时尚	40,980	520,446.00	0.05
212	002400	省广集团	49,277	516,915.73	0.05
213	300365	恒华科技	50,400	514,080.00	0.05
214	002903	宇环数控	37,600	513,616.00	0.05
215	600826	兰生股份	49,100	513,586.00	0.05
216	600662	强生控股	63,800	509,124.00	0.05
217	600029	南方航空	97,328	503,185.76	0.05
218	002479	富春环保	85,199	499,266.14	0.05
219	688166	博瑞医药	8,041	497,657.49	0.05
220	601998	中信银行	96,300	495,945.00	0.05
221	002409	雅克科技	9,400	490,398.00	0.05
222	601555	东吴证券	59,393	484,646.88	0.05
223	600603	广汇物流	98,660	464,688.60	0.04
224	603626	科森科技	38,047	462,271.05	0.04
225	600114	东睦股份	44,236	459,169.68	0.04
226	601688	华泰证券	24,199	454,941.20	0.04
227	002559	亚威股份	76,291	453,168.54	0.04
228	002536	飞龙股份	69,150	450,858.00	0.04
229	002027	分众传媒	80,542	448,618.94	0.04
230	300137	先河环保	66,620	444,355.40	0.04
231	600373	中文传媒	36,656	431,807.68	0.04
232	600409	三友化工	92,500	431,050.00	0.04
233	600273	嘉化能源	48,611	424,860.14	0.04
234	002110	三钢闽光	63,034	419,806.44	0.04
235	002686	亿利达	81,000	413,100.00	0.04
236	002196	方正电机	81,865	412,599.60	0.04
237	600869	智慧能源	102,795	411,180.00	0.04
238	002279	久其软件	56,500	409,625.00	0.04
239	600340	华夏幸福	17,800	406,908.00	0.04
240	001979	招商蛇口	23,800	391,272.00	0.04

241	601989	中国重工	93,700	374,800.00	0.04
242	688189	南新制药	6,833	363,515.60	0.03
243	300385	雪浪环境	56,000	356,720.00	0.03
244	600141	兴发集团	38,100	340,995.00	0.03
245	000488	晨鸣纸业	68,950	340,613.00	0.03
246	600066	宇通客车	27,900	340,380.00	0.03
247	300100	双林股份	56,790	308,937.60	0.03
248	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.03
249	688202	美迪西	2,120	293,196.00	0.03
250	600507	方大特钢	56,322	292,311.18	0.03
251	002009	天奇股份	36,998	283,774.66	0.03
252	000009	中国宝安	31,200	265,512.00	0.03
253	002156	通富微电	9,666	242,133.30	0.02
254	603195	公牛集团	1,359	218,323.35	0.02
255	688300	联瑞新材	3,164	217,619.92	0.02
256	688228	开普云	2,718	212,330.16	0.02
257	600511	国药股份	5,100	207,417.00	0.02
258	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
259	300832	新产业	882	151,871.58	0.01
260	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.01
261	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
262	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.01
263	688310	迈得医疗	3,276	123,144.84	0.01
264	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
265	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
266	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
267	002670	国盛金控	10,500	96,075.00	0.01
268	000525	红太阳	11,900	94,486.00	0.01
269	000049	德赛电池	1,660	81,356.60	0.01
270	300577	开润股份	3,000	80,910.00	0.01
271	605001	威奥股份	1,353	27,709.44	0.00
272	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
273	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.00
274	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
275	603095	越剑智能	630	19,000.80	0.00
276	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
277	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
278	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
279	002422	科伦药业	400	8,400.00	0.00
280	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
281	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
282	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
283	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	300113	顺网科技	20,831,907.00	1.91
2	002709	天赐材料	15,912,294.39	1.46
3	688019	安集科技	14,594,002.93	1.34
4	002299	圣农发展	12,923,872.56	1.19
5	600673	东阳光	12,529,407.00	1.15
6	603718	海利生物	12,094,594.94	1.11
7	300567	精测电子	11,559,018.70	1.06
8	300433	蓝思科技	7,669,238.48	0.70
9	300133	华策影视	7,381,624.00	0.68
10	300059	东方财富	6,699,245.00	0.62
11	300383	光环新网	6,575,705.00	0.60
12	601816	京沪高铁	6,319,848.88	0.58
13	002212	南洋股份	5,679,612.00	0.52
14	688008	澜起科技	5,417,466.83	0.50
15	300570	太辰光	4,967,605.00	0.46
16	600882	妙可蓝多	4,855,024.00	0.45
17	300607	拓斯达	4,777,236.00	0.44
18	002531	天顺风能	3,537,118.00	0.32
19	002955	鸿合科技	3,286,782.00	0.30
20	002223	鱼跃医疗	3,169,481.37	0.29

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	603068	博通集成	40,934,011.16	3.76
2	600745	闻泰科技	32,755,046.35	3.01
3	002531	天顺风能	20,728,328.25	1.90
4	002156	通富微电	20,312,991.78	1.87
5	300316	晶盛机电	19,937,870.86	1.83
6	300498	温氏股份	18,130,773.75	1.66
7	300223	北京君正	17,197,452.97	1.58
8	688019	安集科技	16,233,279.15	1.49

9	603799	华友钴业	16,030,641.88	1.47
10	002065	东华软件	14,981,627.00	1.38
11	002080	中材科技	13,596,649.00	1.25
12	300502	新易盛	11,706,982.00	1.07
13	002236	大华股份	11,646,205.00	1.07
14	300383	光环新网	10,796,900.86	0.99
15	603708	家家悦	9,343,543.50	0.86
16	000066	中国长城	8,983,775.00	0.82
17	601138	工业富联	8,609,159.00	0.79
18	002555	三七互娱	8,586,650.61	0.79
19	601318	中国平安	8,058,862.28	0.74
20	000063	中兴通讯	7,737,931.00	0.71

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	227,499,636.71
卖出股票的收入（成交）总额	515,403,140.93

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）	1,222,270.77	0.12
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,222,270.77	0.12

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128112	歌尔转 2	6,274	627,400.00	0.06
2	128101	联创转债	1,669	192,819.57	0.02
3	128114	正邦转债	1,473	147,300.00	0.01
4	128095	恩捷转债	864	106,358.40	0.01
5	128104	裕同转债	690	88,154.40	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期没有投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

**7.12 投资组合报告附注**

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

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,809.61
2	应收证券清算款	13,326,067.53
3	应收股利	-
4	应收利息	11,869.67
5	应收申购款	992,256.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,445,003.75

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

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
24,113	39,621.84	926,992.31	0.10%	954,474,481.42	99.90%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,597.44	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	1,243,082,494.37
本报告期基金总申购份额	178,476,706.30
减：本报告期基金总赎回份额	466,157,726.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	955,401,473.73

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	127,721,042.07	17.65%	116,392.86	17.57%	-
方正证券	3	97,884,251.57	13.53%	89,202.15	13.46%	-
天风证券	2	92,030,299.74	12.72%	83,868.47	12.66%	-
光大证券	2	72,455,961.44	10.01%	66,029.54	9.97%	-
中信建投	1	59,239,212.63	8.19%	55,171.78	8.33%	-
海通证券	1	59,130,355.26	8.17%	55,067.83	8.31%	-
兴业证券	1	53,928,851.71	7.45%	50,223.71	7.58%	-
国泰君安证券	1	45,019,552.52	6.22%	38,322.27	5.78%	-
国盛证券	1	39,510,722.62	5.46%	36,709.16	5.54%	-
长江证券	2	27,196,893.56	3.76%	25,328.85	3.82%	-
银河证券	1	22,755,786.09	3.14%	21,192.78	3.20%	-
广发证券	1	15,313,699.88	2.12%	14,260.75	2.15%	-
新时代证券	2	8,853,820.32	1.22%	8,245.22	1.24%	-
东北证券	1	2,661,378.75	0.37%	2,478.58	0.37%	-

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；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易

单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

**10.7.2 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
财信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	179,113.53	4.14%	-	-	-	-
方正证券	1,656,434.87	38.32%	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	348,824.25	8.07%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	346,000.00	8.00%	-	-	-	-
兴业证券	402,246.60	9.31%	-	-	-	-
国泰君安证券	1,390,200.00	32.16%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 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调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
3	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
4	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和公司网站	2020-03-07
5	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和公司网站	2020-03-07
6	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
7	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
8	华安基金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	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
9	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21

10	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	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
11	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	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
12	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《证券日报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《证券日报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 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

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

二〇二〇年八月二十八日