

华安中小盘成长混合型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	36
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	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
9	开放式基金份额变动	43
10	重大事件揭示	44
10.1	基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4	基金投资策略的改变	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
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	46
10.8	其他重大事件	47
11	备查文件目录	48
11.1	备查文件目录	48
11.2	存放地点	49
11.3	查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中小盘成长混合型证券投资基金	
基金简称	华安中小盘成长混合	
基金主代码	040007	
交易代码	040007(前端)	041007(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 4 月 10 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	997,307,750.63 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	主要依靠基金管理人的研究优势，将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中，在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上，积极把握备选股票的投资机会，为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
业绩比较基准	$40\% \times \text{天相中盘成长指数} + 40\% \times \text{天相小盘成长指数} + 20\% \times \text{中债-国债总指数}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	service@huanan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市西城区复兴门内大街55

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	299,645,348.39
本期利润	499,179,944.95
加权平均基金份额本期利润	0.4598
本期加权平均净值利润率	22.65%
本期基金份额净值增长率	26.14%
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	1,459,636,532.83
期末可供分配基金份额利润	1.4636
期末基金资产净值	2,315,093,115.00
期末基金份额净值	2.3213
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	153.36%

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	12.25%	1.13%	8.85%	0.74%	3.40%	0.39%
过去三个月	24.47%	1.18%	15.43%	0.93%	9.04%	0.25%
过去六个月	26.14%	1.83%	14.95%	1.42%	11.19%	0.41%
过去一年	59.27%	1.52%	24.83%	1.15%	34.44%	0.37%
过去三年	55.40%	1.35%	4.63%	1.14%	50.77%	0.21%
自基金合同生效起至今	153.36%	1.66%	58.41%	1.50%	94.95%	0.16%

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

华安中小盘成长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007 年 4 月 10 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型。

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		
李欣	本基金的基金 经理	2018-06-11	-	10 年	硕士研究生，10 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 11 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11

					月起,同时担任华安科技动力混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起,同时担任华安科技创新混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内各行业走势分化较为显著，医药生物、休闲服务、电子、食品饮料、计算机涨幅居前，大部分行业录得正收益；采掘、银行、非银金融、交通运输、钢铁行业跌幅居前。报告期内，新冠疫情的发生、进展、控制的进程，全球经济受到疫情的影响以及恢复过程，各国货币、财政的应对措施，各个行业和公司受到疫情影响的程度，构成了报告期内资本市场波动的最主要动因。全球经济普遍受到疫情影响，但各国的受影响程度和恢复进度差异较大；各国普遍施以货币和财政的救助措施，但各国差异同样显著，美国等国的大水漫灌对全球货币体系造成长期影响，而我国因为疫情防控得当、经济恢复有效，保持了较强的政策定力和明确的施助方向。

报告期内，疫情催化和加速了各行业之间、行业内部龙头与一般企业之间的差距的拉大。疫情

期间涨幅居前的行业均与疫情有较大的关联度。涨幅最高的医药生物行业直接受到疫情对其需求的拉动，包括检测设备和试剂、治疗设备、疫苗等生物医药产品需求大增，同时原料药等行业的全球供应链在疫情的影响下加速向国内转移。对于科技产业而言，进口替代和云计算是两个长期的主轴，而疫情导致的全球供应链重构加速了进口替代的进程，疫情下的远程办公也推进了云计算的普及。疫情同样加速了食品工业化的进程，头部企业市占率提升明显。疫情期间项目建设、差旅、集中式文娱活动等受到影响较大，采掘、交通运输、钢铁、电影等行业受到较显著影响。

在报告期内，本基金结合对市场的分析判断、对行业和上市公司的跟踪，同时基于本基金合同中所指出的投资范围与投资理念，进行资产配置。新兴消费中的免税行业、食品工业化相关公司、地产物业等受益于消费领域的政策、科技、消费习惯升级等产业红利，电子产业中的苹果产业链受益于新机创新周期，半导体和集成电路受益于国产替代推进、5G 终端普及、人工智能进入应用期，互联网与云计算产业链受益于疫情期间远程办公和生活的进一步普及，医药健康相关产业受到疫情防控需要、健康消费升级、全球医药供应链重构的推动，新能源车与自动化产业同样受益于技术进步和市场成熟的推动。在全球产业链面临割裂风险的局面下，我国的医药、精细化工、自动化装备等高端制造业，因其具有国内庞大而完善的工业体系支撑，其在全球的竞争力大幅提升。本基金对这些领域重点进行了研究，并在考虑到基金合同对投资方向的约束的基础上，进行了配置。

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 2.3213 元，本报告期份额净值增长率为 26.14%，同期业绩比较基准增长率为 14.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为，疫情之后，中国资产在全球资本市场的相对投资价值进一步凸显。疫情使得我国在社会治理和经济运行方面相对于其他经济大国的制度性和系统性优势得以集中显现，我国经济系统的抗冲击和自我恢复能力显著优于可比各国，这将加速以特斯拉为代表的全球一线产业向我国的产业转移，带动一系列上下游产业链的落地生根。疫情加速产业转移的逻辑，在电子元器件、原料药等行业上都有体现。

过去几十年的全球化浪潮惠及了大部分国家和民众，但也有失落群体掀起了反全球化浪潮，集中体现在某些大国对我国的贸易、科技等领域的对抗上，但客观而言，资本的逐利本性使得全球资本必然持续流向相对高收益经济体。因此本基金对外资的持续流入持乐观态度。

管理人认为，二级市场上各行业表现差异较大，正是各行业基本面内在差异的外在体现，在短期内这种差异可能被过于放大，但其内在逻辑值得长期检验。各个产业受到科技进步和社会财富增

长带来的推动弹性是天差地别的，但货币和信用政策却无法做到精准的将货币和信用恰如其分的投放到能够最大化创造价值的领域，即使 ROE 等指标也只是更多的反应静态与过去的价值创造能力，在这种情况下，市场资金会选择向“成长速度快、空间大、持续久、收现好、确定性高”的产业聚集，会青睐那些受到科技、产业政策、消费习惯这些变动（进步）较快的正面变量影响最深的行业，例如科技、医疗健康、消费等。

科技产业不仅仅正在实现进口替代，而且实现在全球产业链上向高价值产业的升级跃迁。近几年来一些严峻的外部环境，给局部带来压力，但在全局而言更多的是机会。夯实基础研究、技术结合市场、加大直接融资，资本市场和科技产业的相互正反馈在加速进行，形成投资者、企业、国家和产业多方共赢的局面。科创板日趋成熟，创业板改革加速进行，科技产业投资进入新的时代。集成电路、生物医药、新能源、高新材料、节能环保等领域都有重要的投资机会。

5G 建设进入终端普及阶段，行业应用逐渐形成规模。人工智能（AI）将是下一个重要的科技领域，通过 5G 传输的大量数据将通过人工智能进行处理以实现整个信息链路的高效使用。以深度学习为代表的人工智能技术正在快速成熟，其应用领域向社会治理、个人娱乐、医药健康、工业运行等社会生活的各个领域全面拓展，势必将渗透到生活的角角落落。人工智能涉及到集成电路、服务器、算法平台、软件应用、系统集成等领域，都正在发生深远变化，将有一批人工智能产业公司登陆资本市场，带动资本市场对该领域投资机会的挖掘，管理人将努力发掘其中投资机会。

消费具有稳健性，但同时也面临着消费升级的重要机遇期。食品产业正在快速工业化，其上游的养殖产业近几年显著的向工业化程度较高的龙头企业集中，冷链、快递、外卖平台等物流配送网络的成熟化，使得食品工业化进一步推进。直播、网红带货、团购等网络方式加速重构了营销和渠道这两个消费品最重要的要素，带来产业的变化机遇。国产化妆品产业链的崛起，是产业链研发、品控等硬实力与国内文化软实力同时进步的必然结果，带来很好的投资机会。免税等制度性红利也带来相关投资标的的机遇。

健康始终是最基本需要，生物医药领域也是重要的投资方向。创新药、原料药、疫苗、CDMO、CRO、医疗服务、设备与耗材等领域，背靠我国在生物医药领域的工程师红利和生化领域的产业链优势，依托庞大市场，为龙头企业快速成长创造了很好的条件。随着越来越多的药品进行一致性评价和带量采购，行业份额将日趋向研发和产品型公司集中，进口替代也将加速进行。随着我国社会经济的发展，进入老年阶段人群及其子女对于医疗健康的重视程度、财富水平、支付能力都在持续提升，对医疗健康行业的高质量需求增加。从市场估值体系角度来看，疫情加深了二级市场对于具有盈利确定性的行业与公司的偏好，而医药行业高度符合这一特性，因此将长期享受估值溢价。

本基金在投资中注重投资方向与基金合同的契合。基金合同中指出，本基金的投资理念是：中

小盘股票投资为主，投资最具成长潜力的公司，集中投资和组合投资相结合。本报告上文述及的科技、医疗健康、消费等相关领域看好的方向，绝大部分符合本基金的投资范围，但管理人也会在投资时，考虑所投资标的与基金投资范围的契合度，在必要时对本报告所述及的看好领域内的上市公司有所取舍。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安中小盘成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安中小盘成长混合型证券投资基金 2020 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

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
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	132,602,159.36	227,757,330.34
结算备付金		1,875,220.19	3,368,158.87
存出保证金		727,092.78	724,939.15
交易性金融资产	6.4.7.2	2,147,218,798.26	1,771,205,190.27
其中：股票投资		2,143,608,142.26	1,763,612,354.19
基金投资		-	-
债券投资		3,610,656.00	7,592,836.08
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	49,260,464.63	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	23,012.32	85,662.10
应收股利		-	-
应收申购款		539,079.05	206,373.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		2,332,245,826.59	2,003,347,653.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
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		111.01	-
应付赎回款		8,830,740.65	4,273,506.17
应付管理人报酬		2,780,163.79	2,483,807.65
应付托管费		463,360.63	413,967.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	4,465,577.32	4,266,665.06
应交税费		30.71	72.69
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	612,727.48	717,693.13
负债合计		17,152,711.59	12,155,712.66
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.8	430,818,240.14	467,411,841.16
未分配利润	6.4.7.9	1,884,274,874.86	1,523,780,100.12
所有者权益合计		2,315,093,115.00	1,991,191,941.28
负债和所有者权益总计		2,332,245,826.59	2,003,347,653.94

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3213 元，基金份额总额 997,307,750.63 份。

6.2 利润表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

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
一、收入		525,952,342.04	362,645,615.36
1.利息收入		1,041,030.86	1,646,310.41
其中：存款利息收入	6.4.7.10	1,028,267.04	906,202.88
债券利息收入		10,162.42	740,107.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,601.40	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		325,120,033.96	188,627,610.40
其中：股票投资收益	6.4.7.11	313,051,735.89	179,363,264.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,039,930.28	-185,190.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.13	10,028,367.79	9,449,535.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	199,534,596.56	172,339,036.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	256,680.66	32,658.41
减：二、费用		26,772,397.09	22,225,256.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,438,943.56	11,905,030.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,739,823.94	1,984,171.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.16	7,464,933.06	8,202,637.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		24.15	25.64
7. 其他费用	6.4.7.17	128,672.38	133,390.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		499,179,944.95	340,420,359.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		499,179,944.95	340,420,359.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

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）	467,411,841.16	1,523,780,100.12	1,991,191,941.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	499,179,944.95	499,179,944.95
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）	-36,593,601.02	-138,685,170.21	-175,278,771.23
其中：1.基金申购款	55,268,417.44	207,160,388.73	262,428,806.17

2.基金赎回款	-91,862,018.46	-345,845,558.94	-437,707,577.40
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）	430,818,240.14	1,884,274,874.86	2,315,093,115.00
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）	500,889,781.40	853,695,246.55	1,354,585,027.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	340,420,359.11	340,420,359.11
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）	-10,942,392.63	-30,946,345.92	-41,888,738.55
其中：1.基金申购款	18,561,251.76	40,066,534.40	58,627,786.16
2.基金赎回款	-29,503,644.39	-71,012,880.32	-100,516,524.71
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）	489,947,388.77	1,163,169,259.74	1,653,116,648.51

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

华安中小盘成长混合型证券投资基金(原名为华安中小盘成长股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字

[2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》，原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 4 月 10 日起，原基金安瑞终止上市，更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。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为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,060,436,162.37 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.314909165，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购，共募集人民币 9,883,484,414.21 元，业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金

信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资

产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	132,602,159.36
定期存款	-

其他存款	-
合计	132,602,159.36

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		1,685,309,578.38	2,143,608,142.26	458,298,563.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,582,000.00	3,610,656.00	28,656.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,582,000.00	3,610,656.00	28,656.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,688,891,578.38	2,147,218,798.26	458,327,219.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	49,260,464.63	-
合计	49,260,464.63	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	15,776.89
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	759.51
应收债券利息	3,580.04
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,601.40
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	294.48
合计	23,012.32

6.4.7.6 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	4,465,112.69
银行间市场应付交易费用	464.63
合计	4,465,577.32

6.4.7.7 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	3,329.10
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
其他	500,000.00
合计	612,727.48

6.4.7.8 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	1,082,019,536.40	467,411,841.16
本期申购	127,940,615.46	55,268,417.44

本期赎回（以“-”号填列）	-212,652,401.23	-91,862,018.46
本期末	997,307,750.63	430,818,240.14

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	1,288,507,606.73	235,272,493.39	1,523,780,100.12
本期利润	299,645,348.39	199,534,596.56	499,179,944.95
本期基金份额交易产生的变动数	-128,516,422.29	-10,168,747.92	-138,685,170.21
其中：基金申购款	161,020,261.30	46,140,127.43	207,160,388.73
基金赎回款	-289,536,683.59	-56,308,875.35	-345,845,558.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,459,636,532.83	424,638,342.03	1,884,274,874.86

6.4.7.10 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	992,989.53
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	29,286.16
其他	5,991.35
合计	1,028,267.04

6.4.7.11 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	2,508,272,048.40
减：卖出股票成本总额	2,195,220,312.51
买卖股票差价收入	313,051,735.89

6.4.7.12 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	7,986,695.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,934,600.00
减：应收利息总额	12,164.86
买卖债券差价收入	2,039,930.28

6.4.7.13 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	10,028,367.79
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	10,028,367.79

6.4.7.14 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	199,534,596.56
——股票投资	201,164,176.64
——债券投资	-1,629,580.08
——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	199,534,596.56

6.4.7.15 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	240,415.19
转换费收入	16,265.47
合计	256,680.66

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

6.4.7.16 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	7,464,933.06
银行间市场交易费用	-
合计	7,464,933.06

6.4.7.17 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	674.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	128,672.38

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

注：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	580,510,855.16	11.94%	611,515,538.00	11.25%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 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	529,020.75	11.85%	529,020.75	11.85%
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	557,272.89	11.16%	-	-
------------------	------------	--------	---	---

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	16,438,943.56	11,905,030.74
其中：支付销售机构的客户维护费	2,681,658.94	2,186,465.02

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	2,739,823.94	1,984,171.81

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国工商银行	132,602,159. 36	992,989.53	349,439,164. 32	858,802.73
--------	--------------------	------------	--------------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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。

6.4.11 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
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	-
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	-
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	-
688051	佳华科技	2020-03-12	2020-09-21	处于锁定期	50.81	120.27	4,053.00	205,932.93	487,454.31	-
688186	广大特材	2020-01-23	2020-08-11	处于锁定期	17.16	34.15	8,033.00	137,846.28	274,326.95	-
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	-

688365	光云科技	2020-04-22	2020-10-29	处于锁定期	10.80	43.22	8,249.00	89,089.20	356,521.78	-
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	-
688396	华润微	2020-02-14	2020-08-27	处于锁定期	12.80	41.45	81,911.00	1,048,460.80	3,395,210.95	-
688398	赛特新材	2020-02-03	2020-08-11	处于锁定期	24.12	54.47	3,246.00	78,293.52	176,809.62	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600185	格力地产	2020-06-30	重大事项停牌	11.61	2020-07-01	12.77	4,553,180.00	54,231,937.06	52,862,419.80	-

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

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。

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。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管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	132,602,159.36	-	-	-	132,602,159.36
结算备付金	1,875,220.19	-	-	-	1,875,220.19
存出保证金	727,092.78	-	-	-	727,092.78
交易性金融资产	3,610,656.00	-	-	2,143,608,142.26	2,147,218,798.26
买入返售金融资产	49,260,464.63	-	-	-	49,260,464.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	23,012.32	23,012.32
应收申购款	-	-	-	539,079.05	539,079.05
资产总计	188,075,592.96	-	-	2,144,170,233.63	2,332,245,826.59
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	-	-	-	111.01	111.01
应付赎回款	-	-	-	8,830,740.65	8,830,740.65
应付管理人报酬	-	-	-	2,780,163.79	2,780,163.79
应付托管费	-	-	-	463,360.63	463,360.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,465,577.32	4,465,577.32
应交税费	-	-	-	30.71	30.71
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	612,727.48	612,727.48
负债总计	-	-	-	17,152,711.59	17,152,711.59
利率敏感度缺口	188,075,592.96	-	-	2,127,017,522.04	2,315,093,115.00
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	227,757,330.34	-	-	-	227,757,330.34
结算备付金	3,368,158.87	-	-	-	3,368,158.87
存出保证金	724,939.15	-	-	-	724,939.15
交易性金融资产	1,803,565.50	5,517,770.58	271,500.00	1,763,612,354.19	1,771,205,190.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	85,662.10	85,662.10
应收申购款	-	-	-	206,373.21	206,373.21
资产总计	233,653,993.86	5,517,770.58	271,500.00	1,763,904,389.50	2,003,347,653.94
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	-	-	-	4,273,506.17	4,273,506.17
应付管理人报酬	-	-	-	2,483,807.65	2,483,807.65
应付托管费	-	-	-	413,967.96	413,967.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,266,665.06	4,266,665.06
应交税费	-	-	-	72.69	72.69
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	717,693.13	717,693.13
负债总计	-	-	-	12,155,712.66	12,155,712.66
利率敏感度缺口	233,653,993.86	5,517,770.58	271,500.00	1,751,748,676.84	1,991,191,941.28

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。

6.4.13.4.2 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定合适的资产配置比例。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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资

产净值的比例在 5%以上。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	2,143,608,142.26	92.59	1,763,612,354.19	88.57
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	2,143,608,142.26	92.59	1,763,612,354.19	88.57

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
	业绩比较基准上升 5%	增加约 28,939	增加约 11,835
	业绩比较基准下降 5%	减少约 28,939	减少约 11,835

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,143,608,142.26	91.91
	其中：股票	2,143,608,142.26	91.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,610,656.00	0.15
	其中：债券	3,610,656.00	0.15
	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	49,260,464.63	2.11
	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	134,477,379.55	5.77
8	其他各项资产	1,289,184.15	0.06
9	合计	2,332,245,826.59	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,657,834,993.30	71.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	37,209,487.57	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,583,538.45	6.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	105,185,987.80	4.54
L	租赁和商务服务业	193,794,135.14	8.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,143,608,142.26	92.59

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	000661	长春高新	324,746	141,361,933.80	6.11
2	601888	中国中免	810,060	124,773,541.80	5.39
3	002475	立讯精密	1,960,281	100,660,429.35	4.35
4	300037	新宙邦	1,418,800	78,119,128.00	3.37
5	603345	安井食品	651,180	76,839,240.00	3.32
6	601231	环旭电子	3,440,815	75,147,399.60	3.25
7	002127	南极电商	3,260,302	69,020,593.34	2.98
8	300760	迈瑞医疗	219,700	67,162,290.00	2.90
9	600882	妙可蓝多	1,814,463	65,846,862.27	2.84
10	300327	中颖电子	1,997,127	64,706,914.80	2.80
11	300113	顺网科技	2,478,384	62,950,953.60	2.72
12	000063	中兴通讯	1,336,045	53,615,485.85	2.32
13	600185	格力地产	4,553,180	52,862,419.80	2.28
14	600872	中炬高新	902,300	52,811,619.00	2.28
15	600276	恒瑞医药	563,126	51,976,529.80	2.25
16	000725	京东方 A	10,673,900	49,847,113.00	2.15
17	300595	欧普康视	667,174	46,261,845.16	2.00
18	300474	景嘉微	687,100	46,241,830.00	2.00
19	000910	大亚圣象	2,854,504	44,358,992.16	1.92
20	000902	新洋丰	4,960,200	43,848,168.00	1.89
21	002600	领益智造	4,007,500	42,599,725.00	1.84

22	600419	天润乳业	2,821,620	41,167,435.80	1.78
23	000011	深物业 A	2,458,951	39,343,216.00	1.70
24	300657	弘信电子	1,879,663	37,724,836.41	1.63
25	000977	浪潮信息	943,986	36,985,371.48	1.60
26	603456	九洲药业	1,322,324	35,834,980.40	1.55
27	600529	山东药玻	614,628	35,648,424.00	1.54
28	300188	美亚柏科	1,756,800	34,837,344.00	1.50
29	002292	奥飞娱乐	4,129,146	34,767,409.32	1.50
30	300782	卓胜微	83,329	33,812,408.33	1.46
31	603129	春风动力	453,330	30,921,639.30	1.34
32	600233	圆通速递	2,005,200	29,195,712.00	1.26
33	300628	亿联网络	378,900	25,863,714.00	1.12
34	300785	值得买	201,939	25,385,751.69	1.10
35	300613	富瀚微	223,961	25,374,781.30	1.10
36	002236	大华股份	1,301,535	25,002,487.35	1.08
37	002415	海康威视	795,953	24,157,173.55	1.04
38	300497	富祥药业	1,184,640	23,183,404.80	1.00
39	000768	中航飞机	1,229,700	21,814,878.00	0.94
40	002301	齐心集团	1,304,808	21,424,947.36	0.93
41	300316	晶盛机电	746,308	18,463,659.92	0.80
42	300232	洲明科技	2,109,542	17,066,194.78	0.74
43	002568	百润股份	336,260	15,239,303.20	0.66
44	300420	五洋停车	2,474,900	14,280,173.00	0.62
45	603068	博通集成	161,300	12,997,554.00	0.56
46	001914	招商积余	422,400	12,980,352.00	0.56
47	603556	海兴电力	798,500	11,530,340.00	0.50
48	603501	韦尔股份	52,397	10,581,574.15	0.46
49	002152	广电运通	718,766	9,300,832.04	0.40
50	601816	京沪高铁	1,295,051	8,013,775.57	0.35
51	601012	隆基股份	150,400	6,125,792.00	0.26
52	002851	麦格米特	194,626	5,044,705.92	0.22
53	688396	华润微	81,911	3,395,210.95	0.15
54	688036	传音控股	23,066	1,637,686.00	0.07
55	688106	金宏气体	26,075	1,355,378.50	0.06
56	688051	佳华科技	4,053	487,454.31	0.02
57	688365	光云科技	8,249	356,521.78	0.02
58	688186	广大特材	8,033	274,326.95	0.01
59	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
60	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.01
61	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
62	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
63	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
64	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
65	002985	北摩高科	782	97,335.54	0.00

66	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
67	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
68	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
69	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
70	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
71	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
72	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
73	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
74	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	002236	大华股份	164,273,768.07	8.25
2	300782	卓胜微	124,961,381.22	6.28
3	300037	新宙邦	87,648,590.33	4.40
4	601888	中国中免	86,892,053.11	4.36
5	600872	中炬高新	78,481,940.82	3.94
6	603345	安井食品	74,472,026.35	3.74
7	300188	美亚柏科	69,982,993.57	3.51
8	601231	环旭电子	67,669,969.28	3.40
9	000938	紫光股份	67,579,128.69	3.39
10	002127	南极电商	66,973,538.20	3.36
11	600185	格力地产	66,120,089.16	3.32
12	600673	东阳光	65,718,556.55	3.30
13	300168	万达信息	64,349,824.00	3.23
14	002709	天赐材料	63,683,082.08	3.20
15	600882	妙可蓝多	59,603,009.82	2.99
16	002507	涪陵榨菜	56,147,684.16	2.82
17	300113	顺网科技	45,616,579.31	2.29
18	600233	圆通速递	45,204,824.84	2.27
19	000910	大亚圣象	44,892,953.32	2.25
20	300474	景嘉微	44,870,386.82	2.25
21	002600	领益智造	44,749,103.76	2.25
22	000725	京东方 A	44,737,300.60	2.25
23	603131	上海沪工	44,187,761.97	2.22
24	600419	天润乳业	43,275,232.83	2.17
25	600529	山东药玻	43,184,815.04	2.17
26	600276	恒瑞医药	42,832,209.80	2.15

27	002301	齐心集团	42,561,185.66	2.14
28	002385	大北农	42,204,445.39	2.12
29	000661	长春高新	41,909,429.79	2.10
30	002292	奥飞娱乐	41,801,689.28	2.10
31	002389	航天彩虹	40,013,115.24	2.01

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	000636	风华高科	161,730,087.28	8.12
2	002236	大华股份	150,069,050.35	7.54
3	601138	工业富联	121,384,058.29	6.10
4	300782	卓胜微	112,033,567.64	5.63
5	002371	北方华创	98,120,231.50	4.93
6	603799	华友钴业	70,153,954.89	3.52
7	002709	天赐材料	68,725,409.85	3.45
8	000725	京东方 A	68,477,228.61	3.44
9	000938	紫光股份	66,754,301.21	3.35
10	603160	汇顶科技	66,508,369.86	3.34
11	300168	万达信息	61,404,142.97	3.08
12	002507	涪陵榨菜	60,699,776.52	3.05
13	000977	浪潮信息	60,423,752.88	3.03
14	002400	省广集团	55,472,767.49	2.79
15	600760	中航沈飞	47,100,911.23	2.37
16	600673	东阳光	45,835,269.75	2.30
17	600872	中炬高新	44,938,269.55	2.26
18	000063	中兴通讯	43,901,243.54	2.20
19	300433	蓝思科技	43,880,401.52	2.20
20	000001	平安银行	41,206,147.82	2.07
21	601166	兴业银行	39,863,089.70	2.00

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	2,374,051,923.94
卖出股票的收入（成交）总额	2,508,272,048.40

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）	3,610,656.00	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,610,656.00	0.16

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	113569	科达转债	35,820	3,610,656.00	0.16

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。

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

无。

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	727,092.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,012.32
5	应收申购款	539,079.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,289,184.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
73,204	13,623.68	124,472,204.87	12.48%	872,835,545.76	87.52%

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	16,826.55	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（2007 年 4 月 10 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,082,019,536.40

本报告期基金总申购份额	127,940,615.46
减：本报告期基金总赎回份额	212,652,401.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	997,307,750.63

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

华融证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	819,130,348.24	16.85%	762,857.22	17.08%	-
东吴证券	1	685,700,890.60	14.11%	624,881.63	13.99%	-
国泰君安证券	1	580,510,855.16	11.94%	529,020.75	11.85%	-
国金证券	2	549,620,313.82	11.30%	501,756.87	11.24%	-
红塔证券	1	435,942,902.99	8.97%	405,993.80	9.09%	-
华泰证券	1	399,819,889.05	8.23%	364,356.52	8.16%	-
瑞银证券	1	387,241,100.61	7.97%	352,892.68	7.90%	-
兴业证券	1	362,307,845.58	7.45%	337,412.00	7.56%	-
中泰证券	2	323,328,979.11	6.65%	294,649.44	6.60%	-
广发证券	1	160,004,509.21	3.29%	145,812.37	3.27%	-
华西证券	1	74,103,111.67	1.52%	69,014.56	1.55%	-
东方财富	1	41,909,429.79	0.86%	38,192.23	0.86%	-
华创证券	1	41,096,077.91	0.85%	38,272.62	0.86%	-

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：

2020 年 1 月完成托管在工商银行的华西证券上海交易单元 45727 租用

2020 年 6 月完成托管在工商银行的开源证券深圳交易单元 010273 租用

2020 年 6 月完成托管在工商银行的长城证券上海交易单元 20267 退租

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

上海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	6,947,198.21	86.98%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,039,496.93	13.02%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、中国证	2020-02-04

	资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	监会基金电子披露网站和公司网站	
3	华安中小盘成长混合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
4	华安中小盘成长混合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
5	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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
10	关于旗下基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-16
11	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	《中国证券报》、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	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
13	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	《中国证券报》、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《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安中小盘成长混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中小盘成长混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中小盘成长混合型证券投资基金托管协议》

- 4、中国证监会批准华安中小盘成长混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，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。

华安基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日