

华安安信消费服务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合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	11
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	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	35
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	36
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	42
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
9 开放式基金份额变动	45
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
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	47
10.8 其他重大事件	48
11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
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	华安安信消费服务混合型证券投资基金
基金简称	华安安信消费混合
基金主代码	519002
交易代码	519002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 23 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	362,170,911.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于消费服务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。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对消费服务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	中证消费服务领先指数收益率
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@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道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

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 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	中国证券登记结算有限责任公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

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	134,600,758.81
本期利润	271,273,325.65
加权平均基金份额本期利润	1.0290
本期加权平均净值利润率	43.45%
本期基金份额净值增长率	46.74%
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	657,583,691.81
期末可供分配基金份额利润	1.8157
期末基金资产净值	1,058,612,043.47
期末基金份额净值	2.923
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	244.35%

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，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	14.54%	1.18%	12.13%	0.90%	2.41%	0.28%
过去三个月	29.51%	1.35%	23.32%	1.04%	6.19%	0.31%
过去六个月	46.74%	1.76%	19.38%	1.52%	27.36%	0.24%
过去一年	80.21%	1.40%	27.90%	1.25%	52.31%	0.15%
过去三年	124.33%	1.42%	46.59%	1.33%	77.74%	0.09%
自基金合同生效起至今	244.35%	1.77%	122.61%	1.48%	121.74%	0.29%

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

华安安信消费服务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

(2013 年 5 月 23 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：根据《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	2020-05-25	12 年	硕士，12 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月至 2020 年 5 月，同时担任华安安信消费服务混合型证券投资基金及华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安汇智精选两年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安现代生活混合型证券投资基金的基金经理。
王斌	本基金的基金经理	2018-10-31	-	8 年	硕士研究生，8 年基金行业从业经验。2011 年 7 月应届毕业生加入华安基金。历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 10 月起，担任华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华

					安安顺灵活配置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

今年上半年因为疫情的影响导致指数波动较大，在经历了春节后的波动后，指数缓步上行。上半年上证指数下跌 2.15%，创业板综上涨 27.94%。上半年全球央行为了应对疫情，实施了较宽松的货币政策。在国内顺利推进复工复产的背景下，整体市场呈现了较好的局面。

上半年华安安信消费服务基金单位净值上涨 46.74%，同期消费服务指数上涨 19.38%。本基金主要抓住了食品饮料、医药生物、农林牧渔、零售服务、传媒等相关行业的机会。

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 2.923 元，本报告期份额净值增长率为 46.74%，同期业绩比较基准增长率为 19.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前时点，虽然全球疫情还在延续，但是复工复产依然在进行中。国内对疫情的控制较为成功，复工复产的速度也较快，经济的回升较为明显。此次疫情是对很多行业的压力测试，一部分行业的龙头经历住了考验，在疫情中没有较大的影响甚至获得了更大的市场份额，相信这些企业会更加蓬勃的发展。

疫情给人们部分消费习惯带来较大的改变，比如：线上化率的水平在持续提升；农改超的趋势更加明显；餐饮以中央厨房为核心的连锁化趋势等等。华安安信消费基金中长期目标就是在消费服务行业中找出符合这些趋势的有竞争力的公司，并与这些公司共同成长，给投资者带来更好的回报。

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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安安信消费服务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，华安安信消费服务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安信消费服务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。本报告期内华安安信消费服务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安信消费服务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：华安安信消费服务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	75,549,376.74	31,826,521.94
结算备付金		3,762,187.11	1,447,686.37
存出保证金		268,110.77	189,111.90
交易性金融资产	6.4.7.2	992,584,894.46	390,377,678.43
其中：股票投资		990,136,494.46	390,377,678.43
基金投资		-	-
债券投资		2,448,400.00	-
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		6,126,901.86	11,659,537.47
应收利息	6.4.7.5	8,696.12	8,294.21
应收股利		-	-
应收申购款		8,772,155.94	1,092,654.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,087,072,323.00	436,601,485.29
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,392,920.21	-
应付赎回款		11,846,792.73	1,749,389.32
应付管理人报酬		1,154,182.94	523,014.35
应付托管费		192,363.83	87,169.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,101,902.60	1,815,585.12
应交税费		11.06	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,772,106.16	1,821,094.07
负债合计		28,460,279.53	5,996,251.92
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	356,086,615.41	212,507,852.62
未分配利润	6.4.7.10	702,525,428.06	218,097,380.75
所有者权益合计		1,058,612,043.47	430,605,233.37
负债和所有者权益总计		1,087,072,323.00	436,601,485.29

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.923 元，基金份额总额 362,170,911.79 份。

6.2 利润表

会计主体：华安安信消费服务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	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
一、收入		281,774,145.03	116,344,644.30
1.利息收入		195,045.99	143,960.07
其中：存款利息收入	6.4.7.11	194,628.78	143,933.15
债券利息收入		417.21	26.92
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）		144,693,433.32	78,066,151.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	137,517,804.97	75,666,739.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	84,683.00	-4,843.14
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	7,090,945.35	2,404,254.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	136,672,566.84	38,100,946.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	213,098.88	33,586.38
减：二、费用		10,500,819.38	5,726,982.28
1. 管理人报酬		4,650,675.82	2,386,780.13
2. 托管费		775,112.67	397,796.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,966,699.80	2,829,059.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		1.49	0.10
7. 其他费用	6.4.7.19	108,329.60	113,345.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		271,273,325.65	110,617,662.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		271,273,325.65	110,617,662.02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安信消费服务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）	212,507,852.62	218,097,380.75	430,605,233.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	271,273,325.65	271,273,325.65
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）	143,578,762.79	213,154,721.66	356,733,484.45
其中：1.基金申购款	218,311,674.38	315,857,765.53	534,169,439.91
2.基金赎回款	-74,732,911.59	-102,703,043.87	-177,435,955.46
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）	356,086,615.41	702,525,428.06	1,058,612,043.47
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）	222,369,522.61	32,428,827.91	254,798,350.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	110,617,662.02	110,617,662.02
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）	-4,493,366.41	-1,528,440.67	-6,021,807.08
其中：1.基金申购款	27,563,185.23	16,591,086.37	44,154,271.60
2.基金赎回款	-32,056,551.64	-18,119,527.04	-50,176,078.68
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）	217,876,156.20	141,518,049.26	359,394,205.46

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

华安安信消费服务混合型证券投资基金(原名为华安安信消费服务股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)由安信证券投资基金(以下简称“基金安信”)转型而成。依据中国证监会 2013 年 4 月 25 日证监许可[2013]590 号文核准的《安信证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议》,基金安信由封闭式基金转为开放式基金。原基金安信为契约式封闭式基金,存续期限至 2013 年 5 月 22 日止。根据上交所上证基字[2013]120 号《关于终止安信证券投资基金上市的决定》,自 2013 年 5 月 23 日起,原基金安信终止上市,原基金安信更名为华安安信消费服务股票型证券投资基金(以下简称“安信消费服务股票基金”)。《安信证券投资基金基金合同》失效的同时《华安安信消费服务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。

原基金安信于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,085,987,601.95 元,已于安信消费服务股票基金的基金合同生效日全部转为安信消费服务股票基金的基金资产净值。根据《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安信证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定,安信消费服务股票基金于 2013 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:1.016880461,并于 2013 年 6 月 25 日进行了变更登记。

安信消费服务股票基金自 2013 年 5 月 29 日至 2013 年 6 月 19 日期间内开放集中申购,共募集集中申购资金 911,286,695.29 元,其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 459,327.86 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 358 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 6 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 911,286,695.29 份基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的 459,327.86 份基金份额,并于 2013 年 6 月 25 日进行了确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华安安信消费服务股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安安信消费服务混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安信消费服务混合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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的 A 股股票等权益类证券(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)、债券(包括中小企业私募债券等)、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的相关规定。本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%,权证的投资比例不超过基金资产净

值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%，其中，持有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%。本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率。

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<年度报告和半年度报告>》、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》、《华安安信消费服务混合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。

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 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间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 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间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	75,549,376.74
定期存款	-
其他存款	-
合计	75,549,376.74

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		809,490,094.28	990,136,494.46	180,646,400.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,448,400.00	2,448,400.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,448,400.00	2,448,400.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		811,938,494.28	992,584,894.46	180,646,400.18

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

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	6,450.55
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,523.70
应收债券利息	337.45
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	275.88
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	108.54
合计	8,696.12

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	3,101,902.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,101,902.60

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	1,500,000.00
应付赎回费	42,598.56
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	199,672.34

预提审计费	29,835.26
其他	-
合计	1,772,106.16

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	216,134,341.85	212,507,852.62
本期申购	222,047,124.09	218,311,674.38
本期赎回（以“-”号填列）	-76,010,554.15	-74,732,911.59
本期末	362,170,911.79	356,086,615.41

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	282,946,161.33	-64,848,780.58	218,097,380.75
本期利润	134,600,758.81	136,672,566.84	271,273,325.65
本期基金份额交易产生的变动数	240,036,771.67	-26,882,050.01	213,154,721.66
其中：基金申购款	359,636,748.77	-43,778,983.24	315,857,765.53
基金赎回款	-119,599,977.10	16,896,933.23	-102,703,043.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	657,583,691.81	44,941,736.25	702,525,428.06

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	168,407.52
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	19,451.63
其他	6,769.63
合计	194,628.78

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	1,530,315,698.01
减：卖出股票成本总额	1,392,797,893.04
买卖股票差价收入	137,517,804.97

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	431,575.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	346,800.00
减：应收利息总额	92.15
买卖债券差价收入	84,683.00

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 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	7,090,945.35
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	7,090,945.35

6.4.7.16 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	136,672,566.84
——股票投资	136,672,566.84
——债券投资	-
——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	136,672,566.84

6.4.7.17 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	213,098.88
合计	213,098.88

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 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	4,966,699.80
银行间市场交易费用	-
合计	4,966,699.80

6.4.7.19 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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	222.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00

合计	108,329.60
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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	4,650,675.82	2,386,780.13
其中：支付销售机构的客户维护费	415,855.97	107,033.52

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2.基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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	775,112.67	397,796.72

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2.基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,002,334.27	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,002,334.27	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.93%	-

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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	75,549,376.74	168,407.52	40,846,933.85	128,806.90

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。

6.4.10.7 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
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	384,125.00	1,874,530.00	2,370,051.25	-
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	-
688228	开普云	2020-03-19	2020-09-28	处于锁定期	59.26	73.20	2,718.00	161,068.68	198,957.60	-
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	-
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	-
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	2020-07-08	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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

113590	海容转债	2020-06-30	2020-07-27	认购新发证券	100.00	100.00	2,550.00	255,000.00	255,000.00	-
123055	晨光转债	2020-06-17	2020-07-13	认购新发证券	100.00	100.00	17,886.00	1,788,600.00	1,788,600.00	-
128110	永兴转债	2020-06-09	2020-07-08	认购新发证券	100.00	100.00	4,048.00	404,800.00	404,800.00	-

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	378,900.00	4,300,515.00	4,399,029.00	-

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。本基金重点投资于消费服务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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，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	75,549,376.74	-	-	-	75,549,376.74
结算备付金	3,762,187.11	-	-	-	3,762,187.11
存出保证金	268,110.77	-	-	-	268,110.77
交易性金融资产	2,448,400.00	-	-	990,136,494.46	992,584,894.46
应收证券清算款	-	-	-	6,126,901.86	6,126,901.86
应收利息	-	-	-	8,696.12	8,696.12
应收申购款	-	-	-	8,772,155.94	8,772,155.94
资产总计	82,028,074.62	-	-	1,005,044,248.38	1,087,072,323.00
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	-	-	-	10,392,920.21	10,392,920.21
应付赎回款	-	-	-	11,846,792.73	11,846,792.73
应付管理人报酬	-	-	-	1,154,182.94	1,154,182.94
应付托管费	-	-	-	192,363.83	192,363.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,101,902.60	3,101,902.60

应交税费	-	-	-	11.06	11.06
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,772,106.16	1,772,106.16
负债总计	-	-	-	28,460,279.53	28,460,279.53
利率敏感度缺口	82,028,074.62	-	-	976,583,968.85	1,058,612,043.47
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	31,826,521.94	-	-	-	31,826,521.94
结算备付金	1,447,686.37	-	-	-	1,447,686.37
存出保证金	189,111.90	-	-	-	189,111.90
交易性金融资产	-	-	-	390,377,678.43	390,377,678.43
应收证券清算款	-	-	-	11,659,537.47	11,659,537.47
应收利息	-	-	-	8,294.21	8,294.21
应收申购款	570,044.48	-	-	522,610.49	1,092,654.97
资产总计	34,033,364.69	-	-	402,568,120.60	436,601,485.29
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	-	-	-	1,749,389.32	1,749,389.32
应付管理人报酬	-	-	-	523,014.35	523,014.35
应付托管费	-	-	-	87,169.06	87,169.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,815,585.12	1,815,585.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,821,094.07	1,821,094.07
负债总计	-	-	-	5,996,251.92	5,996,251.92
利率敏感度缺口	34,033,364.69	-	-	396,571,868.68	430,605,233.37

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 0.23% (2019 年 12 月 31 日：无)，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，使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。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。本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—40%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	990,136,494.46	93.53	390,377,678.43	90.66
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	990,136,494.46	93.53	390,377,678.43	90.66

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 5,609	增加约 1,884
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,609	减少约 1,884

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	990,136,494.46	91.08
	其中：股票	990,136,494.46	91.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,448,400.00	0.23
	其中：债券	2,448,400.00	0.23
	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	79,311,563.85	7.30
8	其他各项资产	15,175,864.69	1.40
9	合计	1,087,072,323.00	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	67,411,246.00	6.37
B	采矿业	3,969,235.20	0.37
C	制造业	740,342,033.19	69.94
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	10,854,565.00	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,370,051.25	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,937,529.37	3.87
J	金融业	24,823,074.00	2.34
K	房地产业	9,689,584.00	0.92
L	租赁和商务服务业	82,529,887.20	7.80
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	555,000.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,654,289.25	0.63
S	综合	-	-
	合计	990,136,494.46	93.53

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	601888	中国中免	511,400	78,770,942.00	7.44
2	600519	贵州茅台	36,301	53,104,006.88	5.02
3	000739	普洛药业	2,091,440	48,709,637.60	4.60
4	603517	绝味食品	661,735	46,811,133.90	4.42
5	600216	浙江医药	2,227,100	42,893,946.00	4.05
6	603129	春风动力	620,100	42,297,021.00	4.00

7	600600	青岛啤酒	523,100	40,017,150.00	3.78
8	002216	三全食品	1,663,293	39,752,702.70	3.76
9	002299	圣农发展	1,355,758	39,316,982.00	3.71
10	300595	欧普康视	558,792	38,746,637.28	3.66
11	601038	一拖股份	4,172,900	38,557,596.00	3.64
12	002385	大北农	3,358,700	30,597,757.00	2.89
13	603700	宁水集团	1,004,350	29,849,282.00	2.82
14	002714	牧原股份	342,110	28,053,020.00	2.65
15	002475	立讯精密	376,991	19,358,487.85	1.83
16	603755	日辰股份	196,200	17,336,232.00	1.64
17	000910	大亚圣象	1,111,600	17,274,264.00	1.63
18	601066	中信建投	429,300	16,905,834.00	1.60
19	000976	华铁股份	3,008,200	16,785,756.00	1.59
20	300138	晨光生物	1,367,196	16,597,759.44	1.57
21	000661	长春高新	37,700	16,410,810.00	1.55
22	600037	歌华有线	1,000,600	15,209,120.00	1.44
23	002507	涪陵榨菜	410,100	14,767,701.00	1.40
24	600882	妙可蓝多	385,700	13,997,053.00	1.32
25	002600	领益智造	1,310,900	13,934,867.00	1.32
26	000951	中国重汽	445,200	13,916,952.00	1.31
27	002050	三花智控	598,520	13,107,588.00	1.24
28	002950	奥美医疗	461,350	13,093,113.00	1.24
29	603856	东宏股份	888,490	12,794,256.00	1.21
30	601865	福莱特	647,600	12,174,880.00	1.15
31	600859	王府井	238,300	10,854,565.00	1.03
32	603283	赛腾股份	198,900	10,700,820.00	1.01
33	300113	顺网科技	419,500	10,655,300.00	1.01
34	002709	天赐材料	228,519	7,721,657.01	0.73
35	300133	华策影视	917,833	6,654,289.25	0.63
36	002142	宁波银行	251,400	6,604,278.00	0.62
37	002541	鸿路钢构	219,500	6,418,180.00	0.61
38	000977	浪潮信息	153,640	6,019,615.20	0.57
39	600276	恒瑞医药	59,640	5,504,772.00	0.52
40	300132	青松股份	237,800	5,493,180.00	0.52
41	002555	三七互娱	116,700	5,461,560.00	0.52
42	300179	四方达	944,500	5,355,315.00	0.51
43	603506	南都物业	177,100	5,272,267.00	0.50
44	002028	思源电气	238,700	4,883,802.00	0.46
45	600185	格力地产	378,900	4,399,029.00	0.42
46	300682	朗新科技	257,850	4,388,607.00	0.41
47	000975	银泰黄金	253,140	3,969,235.20	0.37
48	002127	南极电商	177,560	3,758,945.20	0.36
49	600419	天润乳业	234,610	3,422,959.90	0.32
50	603187	海容冷链	80,800	2,946,776.00	0.28

51	002425	凯撒文化	158,900	2,790,284.00	0.26
52	601816	京沪高铁	384,125	2,370,051.25	0.22
53	000902	新洋丰	250,100	2,210,884.00	0.21
54	300168	万达信息	92,300	2,037,061.00	0.19
55	002032	苏泊尔	28,400	2,016,400.00	0.19
56	002460	赣锋锂业	36,446	1,952,412.22	0.18
57	002821	凯莱英	7,500	1,822,500.00	0.17
58	688363	华熙生物	9,800	1,449,420.00	0.14
59	002831	裕同科技	51,800	1,425,018.00	0.13
60	688106	金宏气体	26,075	1,355,378.50	0.13
61	600109	国金证券	108,200	1,234,562.00	0.12
62	688520	神州细胞	12,351	932,747.52	0.09
63	300259	新天科技	144,400	834,632.00	0.08
64	688298	东方生物	5,286	762,082.62	0.07
65	300760	迈瑞医疗	2,100	641,970.00	0.06
66	603707	健友股份	8,668	559,692.76	0.05
67	002607	中公教育	20,000	555,000.00	0.05
68	688123	聚辰股份	6,660	512,820.00	0.05
69	688166	博瑞医药	7,041	435,767.49	0.04
70	688085	三友医疗	4,807	381,147.03	0.04
71	688029	南微医学	1,568	380,302.72	0.04
72	300223	北京君正	2,100	211,974.00	0.02
73	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.02
74	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
75	300832	新产业	882	151,871.58	0.01
76	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
77	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.01
78	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
79	603345	安井食品	900	106,200.00	0.01
80	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
81	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
82	601318	中国平安	900	64,260.00	0.01
83	300751	迈为股份	200	59,392.00	0.01
84	000858	五粮液	300	51,336.00	0.00
85	002982	湘佳股份	400	41,244.00	0.00
86	000860	顺鑫农业	700	39,886.00	0.00
87	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
88	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
89	600340	华夏幸福	800	18,288.00	0.00
90	300724	捷佳伟创	200	17,706.00	0.00
91	603369	今世缘	400	15,916.00	0.00
92	300059	东方财富	700	14,140.00	0.00
93	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
94	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00

95	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
96	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
97	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
98	600845	宝信软件	100	5,908.00	0.00
99	603787	新日股份	200	3,894.00	0.00
100	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	600216	浙江医药	60,940,815.57	14.15
2	002385	大北农	57,513,184.11	13.36
3	601888	中国中免	55,850,114.78	12.97
4	002299	圣农发展	53,558,086.51	12.44
5	603517	绝味食品	51,443,864.37	11.95
6	600519	贵州茅台	45,842,792.64	10.65
7	600600	青岛啤酒	45,511,951.74	10.57
8	603700	宁水集团	40,778,452.92	9.47
9	601066	中信建投	37,309,026.00	8.66
10	002216	三全食品	37,066,147.62	8.61
11	601038	一拖股份	36,460,915.20	8.47
12	000739	普洛药业	33,816,647.80	7.85
13	002714	牧原股份	33,069,476.26	7.68
14	603129	春风动力	32,811,508.00	7.62
15	000975	银泰黄金	28,949,931.31	6.72
16	300595	欧普康视	25,808,626.20	5.99
17	600233	圆通速递	23,808,065.48	5.53
18	000976	华铁股份	22,203,616.62	5.16
19	300682	朗新科技	21,763,099.50	5.05
20	000998	隆平高科	20,169,113.06	4.68
21	002709	天赐材料	19,861,078.85	4.61
22	600419	天润乳业	18,944,405.90	4.40
23	002223	鱼跃医疗	18,722,829.83	4.35
24	002600	领益智造	17,548,583.32	4.08
25	000910	大亚圣象	17,397,912.52	4.04
26	000756	新华制药	17,174,198.86	3.99
27	000895	双汇发展	17,013,621.20	3.95
28	603867	新化股份	16,618,459.59	3.86
29	002695	煌上煌	16,580,531.41	3.85

30	300138	晨光生物	16,270,948.56	3.78
31	600201	生物股份	16,031,342.22	3.72
32	002950	奥美医疗	15,315,838.00	3.56
33	600037	歌华有线	15,284,999.99	3.55
34	002142	宁波银行	14,903,023.16	3.46
35	000860	顺鑫农业	14,417,780.65	3.35
36	603707	健友股份	14,306,731.00	3.32
37	002541	鸿路钢构	14,107,085.54	3.28
38	300723	一品红	13,954,870.00	3.24
39	002555	三七互娱	13,858,502.00	3.22
40	600882	妙可蓝多	13,787,030.00	3.20
41	002028	思源电气	13,758,142.65	3.20
42	603856	东宏股份	13,696,346.20	3.18
43	002982	湘佳股份	13,577,089.33	3.15
44	002475	立讯精密	13,430,126.82	3.12
45	002458	益生股份	13,311,547.21	3.09
46	601800	中国交建	13,311,206.99	3.09
47	000661	长春高新	13,293,506.00	3.09
48	603755	日辰股份	13,103,115.00	3.04
49	002557	洽洽食品	12,985,559.25	3.02
50	603566	普莱柯	12,676,805.00	2.94
51	300059	东方财富	12,581,108.40	2.92
52	600108	亚盛集团	12,236,938.92	2.84
53	600802	福建水泥	12,165,830.00	2.83
54	000951	中国重汽	11,948,299.26	2.77
55	002157	正邦科技	11,659,008.00	2.71
56	000876	新希望	11,587,259.30	2.69
57	601865	福莱特	11,556,067.16	2.68
58	002460	赣锋锂业	11,351,901.18	2.64
59	603506	南都物业	11,267,051.84	2.62
60	000967	盈峰环境	11,265,372.58	2.62
61	603195	公牛集团	11,216,252.37	2.60
62	300133	华策影视	11,206,707.00	2.60
63	002234	民和股份	10,908,034.60	2.53
64	000977	浪潮信息	10,449,857.28	2.43
65	000568	泸州老窖	10,302,989.30	2.39
66	002507	涪陵榨菜	10,028,516.00	2.33
67	002212	南洋股份	9,973,405.00	2.32
68	300607	拓斯达	9,840,303.00	2.29
69	600109	国金证券	9,832,210.00	2.28
70	300197	铁汉生态	9,771,013.08	2.27
71	300415	伊之密	9,601,846.92	2.23
72	002032	苏泊尔	9,293,899.00	2.16
73	603283	赛腾股份	9,057,789.00	2.10

74	002925	盈趣科技	9,042,606.00	2.10
75	002425	凯撒文化	9,039,159.60	2.10
76	002050	三花智控	8,964,765.04	2.08
77	000011	深物业 A	8,646,977.30	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	002385	大北农	33,543,537.50	7.79
2	002216	三全食品	32,420,926.96	7.53
3	000977	浪潮信息	32,220,869.52	7.48
4	603129	春风动力	28,570,307.98	6.63
5	002555	三七互娱	28,482,770.25	6.61
6	000858	五粮液	26,825,100.27	6.23
7	000661	长春高新	26,334,498.70	6.12
8	000975	银泰黄金	25,153,389.80	5.84
9	000568	泸州老窖	24,704,050.21	5.74
10	002695	煌上煌	24,126,419.12	5.60
11	600233	圆通速递	24,082,091.04	5.59
12	601066	中信建投	23,665,598.00	5.50
13	002714	牧原股份	23,598,083.00	5.48
14	002557	洽洽食品	23,564,096.02	5.47
15	603517	绝味食品	22,686,090.13	5.27
16	000895	双汇发展	21,057,878.64	4.89
17	603867	新化股份	20,654,699.50	4.80
18	002223	鱼跃医疗	20,437,535.50	4.75
19	000998	隆平高科	20,424,150.76	4.74
20	600216	浙江医药	20,155,766.52	4.68
21	002605	姚记科技	18,984,102.51	4.41
22	002709	天赐材料	18,339,463.44	4.26
23	002299	圣农发展	18,090,035.35	4.20
24	603707	健友股份	17,948,300.13	4.17
25	600690	海尔智家	17,695,847.20	4.11
26	002425	凯撒文化	16,651,262.40	3.87
27	603700	宁水集团	16,283,065.04	3.78
28	000756	新华制药	16,061,194.40	3.73
29	002174	游族网络	15,986,533.00	3.71
30	600201	生物股份	15,776,672.74	3.66
31	603566	普莱柯	15,466,148.00	3.59

32	002982	湘佳股份	15,234,311.83	3.54
33	600419	天润乳业	15,125,898.60	3.51
34	300682	朗新科技	14,896,620.50	3.46
35	300133	华策影视	14,851,356.71	3.45
36	002157	正邦科技	14,613,403.01	3.39
37	002458	益生股份	13,930,629.26	3.24
38	600802	福建水泥	13,469,120.08	3.13
39	603799	华友钴业	13,298,315.98	3.09
40	601800	中国交建	13,170,429.00	3.06
41	000876	新希望	13,037,847.68	3.03
42	300723	一品红	13,000,734.00	3.02
43	300415	伊之密	12,971,482.40	3.01
44	000860	顺鑫农业	12,909,284.00	3.00
45	002541	鸿路钢构	12,811,616.00	2.98
46	002234	民和股份	11,792,170.48	2.74
47	600108	亚盛集团	11,629,523.00	2.70
48	300059	东方财富	11,544,941.00	2.68
49	000967	盈峰环境	11,342,766.51	2.63
50	603195	公牛集团	11,327,472.56	2.63
51	000011	深物业 A	11,210,214.00	2.60
52	000002	万科 A	11,160,539.00	2.59
53	600600	青岛啤酒	10,717,579.02	2.49
54	002212	南洋股份	10,615,160.64	2.47
55	002460	赣锋锂业	10,522,297.50	2.44
56	002028	思源电气	9,994,638.89	2.32
57	300197	铁汉生态	9,782,509.32	2.27
58	002142	宁波银行	9,590,968.00	2.23
59	002487	大金重工	9,460,243.98	2.20
60	300760	迈瑞医疗	9,422,247.00	2.19
61	300607	拓斯达	9,339,909.68	2.17

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,855,884,142.23
卖出股票的收入（成交）总额	1,530,315,698.01

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）	2,448,400.00	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,448,400.00	0.23

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	123055	晨光转债	17,886	1,788,600.00	0.17
2	128110	永兴转债	4,048	404,800.00	0.04
3	113590	海容转债	2,550	255,000.00	0.02

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	268,110.77
2	应收证券清算款	6,126,901.86
3	应收股利	-
4	应收利息	8,696.12
5	应收申购款	8,772,155.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,175,864.69

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流通受限股票。

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
50,829	7,125.28	98,541,351.04	27.21%	263,629,560.75	72.79%

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	311,449.56	0.09%

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（2013 年 5 月 23 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	216,134,341.85

本报告期基金总申购份额	222,047,124.09
减：本报告期基金总赎回份额	76,010,554.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	362,170,911.79

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证券监管部门稽查或处罚等情况。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	1,076,752,544.96	31.90%	989,400.63	31.90%	-
海通证券	1	889,103,094.21	26.34%	828,017.89	26.69%	-
银河证券	1	670,780,532.03	19.87%	611,283.19	19.71%	-
中银国际	1	619,602,616.26	18.36%	564,643.68	18.20%	-

申万宏源	1	119,122,935.28	3.53%	108,557.21	3.50%	-
------	---	----------------	-------	------------	-------	---

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

招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,325,200.00	72.06%	-	-	-	-
海通证券	741,975.00	22.99%	-	-	-	-
银河证券	60,882.05	1.89%	-	-	-	-
中银国际	98,718.10	3.06%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
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	《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
4	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
5	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
6	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
7	华安基金关于旗下部分基金参加招商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	2020-05-19
8	华安安信消费服务混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-23
9	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
10	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方	《中国证券报》、中国证	2020-06-29

	式费率优惠活动的公告	监会基金电子披露网站和公司网站	
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	《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规定媒介上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安信消费服务混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安信消费服务混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安信消费服务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