

# 华安中小盘成长混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

### 2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	65
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	65
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	65
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	66
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.12	投资组合报告附注 .....	66
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>67</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	67
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>68</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>68</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4	基金投资策略的改变 .....	69
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	69
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.9	其他重大事件 .....	72
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
12.1	备查文件目录 .....	77
12.2	存放地点 .....	77
12.3	查阅方式 .....	77

## §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	861,726,996.14 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%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×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	姓名	朱学华	郭明

负责人	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	768,874,061.65	457,431,110.91	-582,783,144.30
本期利润	951,704,779.59	766,656,929.32	-433,975,935.50
加权平均基金份额本期利润	0.9576	0.6803	-0.3667
本期加权平均净值利润率	42.00%	44.69%	-26.39%
本期基金份额净值增长率	52.62%	57.53%	-24.10%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,705,369,530.25	1,288,507,606.73	853,695,246.55
期末可供分配基金份额利润	1.9790	1.1908	0.7362
期末基金资产净值	2,420,370,964.08	1,991,191,941.28	1,354,585,027.95
期末基金份额净值	2.8087	1.8403	1.1682
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	206.56%	100.86%	27.51%

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
过去三个月	14.31%	1.38%	6.16%	1.00%	8.15%	0.38%
过去六个月	21.00%	1.60%	11.59%	1.25%	9.41%	0.35%
过去一年	52.62%	1.71%	28.28%	1.33%	24.34%	0.38%
过去三年	82.48%	1.46%	18.43%	1.22%	64.05%	0.24%
过去五年	57.19%	1.44%	-9.13%	1.20%	66.32%	0.24%
自基金合同生	206.56%	1.66%	76.78%	1.49%	129.78%	0.17%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2007 年 4 月 10 日至 2020 年 12 月 31 日)



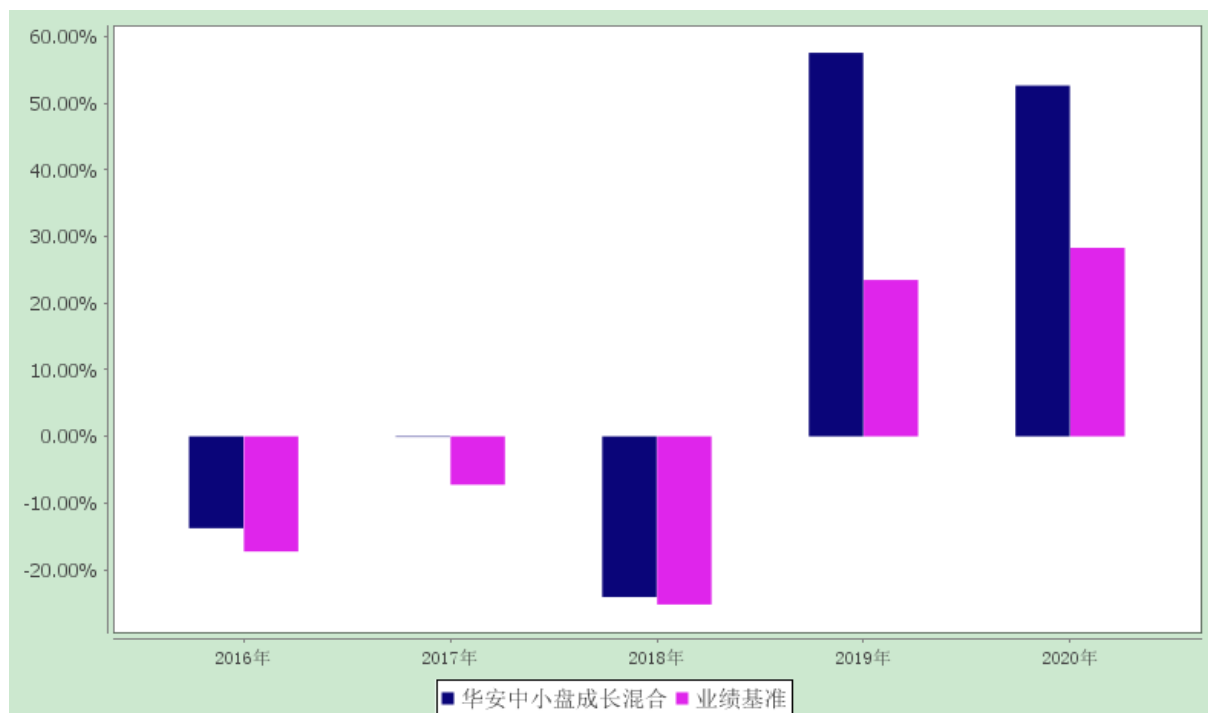
注：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安中小盘成长混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、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 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 149 只开放式基金，管理资产规模达到 4,701.62 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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
李欣	本基金的基金经理	2018-06-11	-	11 年	硕士研究生，11 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合

经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 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，大部分行业录得正收益，食品饮料、消费者服务、电力设备及新能源、国防军工、汽车等行业涨幅居前；综合金融、通信、房地产、石油石化、建筑等行业跌幅居前。报告期内，疫情的影响以及疫情后各行业的恢复与发展，构成了年内市场走势的主要驱动力。各个行业，尤其是生物医药、高端白酒、新能源车、新能源发电、新型消费、工业自动化产业获得了快速的恢复和发展，在全球的市场份额快速上升，行业利润分配进一步向龙头集中。相对于国内在疫情防控上的高效率，海外的疫情防控和经济恢复过程较为曲折，对经济活动造成极大影响，但在开始接种疫苗后局势大为改观。面对疫情，海外主要经济体尤其是美国采取了较为激进的货币宽松、财政刺激政策，在未来一段时间内仍将持续。

2020 年下半年，以欧美为代表的海外发达经济体在后疫情时期出现了消费的强劲复苏，库存降至较低水平；而海外主要经济体在生产端的恢复较慢，从而“海外消费+中国制造”为中国制造业提升全球市场份额提供了重大机遇。一些成长性行业在多方因素的共同作用下，出现行业拐点，业绩、估值双双提升，股价表现亮眼。以新能源汽车、光伏等行业为代表，需求层面从上半年的疫情影响下快速恢复，供给层面经过之前几年的淘汰落后产能和产能集中化，行业各产业环节的龙头大都表现出色。

本基金在各个重点领域内，对行业发展逻辑和主要动态指标进行跟踪，对龙头公司和处于追赶态势、份额提升空间大、发展潜力显著的追赶型公司同时进行研究和投资，希望不仅通过投资龙头公司获得行业红利，也通过投资追赶型公司获取回报。本基金在考虑基金合同对投资方向约束的基础上，确定投资标的和投资比例。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.8087 元，本报告期份额净值增长率为 52.62%，同期业绩比较基准增长率为 28.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人对 2021 年中国宏观经济是乐观的，原因主要有：第一、2020 年 2 季度启动的中国制造

业复苏周期将走出持续增长的曲线，虽然增长率由于基期原因将有所放缓，但我们应当看到增长的内在品质在提高。直观来看，2020 年 2 季度以来，我国制造业受益于全球主要经济体需求转单，2021 年随着疫苗普及，海外制造业将逐渐恢复，转单需求可能会受到影响。我们的看法是，由于产能利用率的限制，之前需求并没有被充分满足，换言之，需求释放将有较好的持续性；同时，一年左右的时间对于技术和产品更新迭代速度很快的高科技制造业而言，已经对企业的相对竞争力造成了显著的改变。

第二，海外主要经济体的货币和财政政策预计不会在短时间内转向，持续对我国出口形成需求拉动。虽然股市、大宗商品、全球一线城市地产、数字货币等资产价格都超过甚至显著高于疫情前水平，显示存在流动性泡沫的强烈迹象，但海外主要经济体货币政策整体上是就就业、消费品通胀水平为调控目标，政策转向的条件并未成就。

但不同的行业和公司面对这一次疫情和随之而来的复苏的过程中，受到的影响和抓住的机遇又是千差万别的，总体上体现出“K”型复苏曲线。就行业而言，利用疫情提升自身全球竞争力、提升自身商业模式的成熟度和渗透率的产业将持续获得加速发展的机遇。

信息科技产业是典型的全球竞争行业，许多子行业和公司 2020 年内都获得了相对于海外竞争对手的竞争力提升。在需求和技术两端的推动下，我国在许多领域开始超越和引领全球产业，起初体现在性价比方面，逐渐过渡到性能方面；起初是细微的“点”上的突破，最终成为“线”和“面”上的突破。5G 射频通信的模组化集成化、手机快充需求对应的电源管理芯片、AI（人工智能）发展对图像传感器和处理芯片的推动等。展望 2021 年和今后，我们在信息科技领域的投资框架和选股标准是，选择市场应用面不断拓宽、性能要求不断提高的子行业，以保证行业容量和壁垒的持续巩固与提升；首选轻资产模式，除非重资产是构成竞争力的必要条件且能够形成持续差异化产品竞争力；选择市场和研发两端都能够敏锐抓住变化的公司；选择对海外龙头能够通过本土化差异化的产品开发和技术服务建立竞争力，对国内追赶者保持技术、规模、新品开发速度优势的公司。以上各方面标准的成立，都有赖于核心团队的进取心、专业度、执行力。

能源科技产业相对于信息科技产业，我国实现弯道超车的难度更低，速度更快。新能源发电和新能源汽车产业，有碳中和长期目标作为产业指引，从总量角度看长期的确定性很强；技术发展路径较为清晰，因此产业竞争格局也较为稳固，“强者恒强”的局面将持续。新能源产业的发展，也带动相关电子产品的快速放量，如功率半导体、被动器件、PCB、连接器等。新能源汽车具有向智能网联化发展的天然便利条件，整车的车辆控制和信息交互统一于 IT 和电子架构。因此我们亦看好后续汽车智能化带来的产业机遇，包括 IT 应用方案服务商、电子器件和系统提供商等细分领域。

工业自动化产业受益于成长性和周期性的双重推动。2020 年 2 季度开始，我国工业产能利用率

持续升高，资本开支也进入到上行周期；而与以往工业投资周期不同的是，各个行业的投资力度差异变大，对自动化产品的性能精度、信息化程度、服务支持都有更高的要求，这也将使得自动化设备厂商出现更大的分化。我们在工业自动化领域的选股标准是：第一，一般而言，长期角度更倾向于选择通用自动化公司，特定行业的自动化需求有较强的周期性，且行业空间不够大容易受到新增供给方的价格竞争压力，但在新能源等快速成长行业具有技术领先能力的专用自动化公司也符合我们的标准；第二，我们非常看重自动化公司对客户所在领域生产流程的理解深度，自动化提供的不仅是设备和系统，更是一种站在客户角度持续改进生产流程的能力。

互联网领域，我们看到依然有许多创新正在蓬勃发展。在社交和知识分享的赛道上，clubhouse 异军突起，国内也有互联网厂商快速推出了相似的产品，我们认为，这类产品可以根据兴趣等要素将人群加以聚类，通过交流互动增加产品的使用频率和粘性，是一种非常值得期待的产品形态。在电商、本地服务、游戏等既有赛道上，我们继续看好行业龙头的业务拓展和定价权的持续增强。

云和企业服务是接下来数年需要重点关注的赛道，我国已经进入到企业通过科技手段提升效率的关键产业节点，IBM 等公司就是在美国的类似时间点开始快速发展的。目前云和企业服务赛道上公司的成熟度还不高，大量的投资案例出现在一级市场，为二级市场提供大量投资标的还需要时间，目前主要关注 ERP、办公、专业工具、电商 SAAS 等细分领域。

消费升级和新消费是我们关注的重要方向。即使在白酒等传统消费品领域，消费升级的空间也是巨大的。消费主力人群的世代交替，加速了白酒消费高端化的进程。同时新一代人群对自身的外在形象、内在体验都有相较于以往时代人群更高、更细致化的要求，对医美、盲盒等新消费形成快速拉动。在软饮料等较传统领域，通过洞悉消费人群的心理诉求，也出现了很多黑马消费品牌。消费品渠道创新不断推进，如免税本质上是对海外高端消费品渠道的进口替代，是一种有利于各方的商业模式。同时，消费品包括消费服务业的工业化、品牌化、标准化也在帮助一批品牌崛起。我国中产阶层的快速崛起，恰好与移动互联网浪潮在时间上重合，新消费理念、新品牌的传播速度大大加快。

医药大健康领域，我们看好三大方向：第一、我国具有供给端优势的 CRO、CDMO 和原料药行业，这些领域的竞争力得益于我国的生物医药工程师红利，以及完整而高效的化工产业链；第二、医疗服务业，通过服务流程的标准化、服务效果的可预见性，连锁品牌效应得以放大；第三、医药消费品，不受医保控费的影响，并且拥有更大的渗透率提升空间。

我们也看好军工等行业的发展空间，限于篇幅原因，就不一一展开了。

本基金在投资标的选择上，首选具有长期成长能力的成长股，重点考核衡量成长空间的“渗透率”因素，包括行业渗透率和公司在行业的渗透率（市占率），以及衡量公司持续盈利能力的“定价权”因

素。

“渗透率”表征行业所处的生命周期，其绝对值对应新业务收入，其斜率对应增速。相对于基本面和估值体系都充满变数的“成长早期”和估值下滑的“成熟期”，处于“高速成长期”的公司是我们重点投资的对象，其新业务的规模、增速、竞争力达到均衡。优秀公司有能力和持续跨越多个新产品周期。

而“定价权”不仅是消费股的重要考量因素，也是研究科技等各类成长股的重要指标。“定价权”表征了公司对供应链的议价能力、对客户的产品定义能力、相对于竞争对手的护城河宽度，科技成长股的定价权往往来自于这几个方面：经营生态系统、引领行业标准、规模成本优势。财务报表质量往往是企业定价权的体现。

关于投资方向，管理人注重对基金合同的全面、深入的理解和把握。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、消费、医疗健康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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 积极落实新《证券法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法规要求，督促各项工作稳妥、有序开展。

(3) 强化内控建设，推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

(4) 构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

(5) 对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

(6) 定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，对公司前中后各业务环节开展自查

自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 24862 号

华安中小盘成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了华安中小盘成长混合型证券投资基金(以下简称“华安中小盘成长基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了华安中小盘成长基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充

分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安中小盘成长基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华安中小盘成长基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安中小盘成长基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安中小盘成长基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安中小盘成长基金的财务报告过程。

### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安中小盘成长基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安中小盘成长基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师  
 许康玮 楼茜蓉  
 上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼  
 2021 年 3 月 24 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	282,719,030.09	227,757,330.34
结算备付金		7,352,794.36	3,368,158.87
存出保证金		608,332.87	724,939.15
交易性金融资产	7.4.7.2	2,178,783,797.73	1,771,205,190.27
其中：股票投资		2,175,369,013.39	1,763,612,354.19
基金投资		-	-
债券投资		3,414,784.34	7,592,836.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	29,976.79	85,662.10
应收股利		-	-
应收申购款		157,512.15	206,373.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,469,651,443.99</b>	<b>2,003,347,653.94</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,547,921.48	-
应付赎回款		5,171,461.00	4,273,506.17
应付管理人报酬		2,937,608.93	2,483,807.65

应付托管费		489,601.49	413,967.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,413,786.99	4,266,665.06
应交税费		38.88	72.69
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	720,061.14	717,693.13
<b>负债合计</b>		<b>49,280,479.91</b>	<b>12,155,712.66</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	372,249,803.40	467,411,841.16
未分配利润	7.4.7.10	2,048,121,160.68	1,523,780,100.12
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,420,370,964.08</b>	<b>1,991,191,941.28</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,469,651,443.99</b>	<b>2,003,347,653.94</b>

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.8087 元，基金份额总额 861,726,996.14 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>1,009,820,185.34</b>	<b>812,138,630.71</b>
1.利息收入		1,456,358.48	2,886,489.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,437,147.58	2,123,031.71
债券利息收入		16,609.50	763,457.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,601.40	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		825,171,328.16	499,877,792.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	808,797,283.74	485,794,233.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,859,611.41	-41,980.85
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	12,514,433.01	14,125,539.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	182,830,717.94	309,225,818.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	361,780.76	148,530.30
<b>减：二、费用</b>		<b>58,115,405.75</b>	<b>45,481,701.39</b>
1. 管理人报酬		33,908,635.42	25,653,398.40
2. 托管费		5,651,439.32	4,275,566.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	18,300,015.61	15,298,594.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		47.40	75.04
7. 其他费用	7.4.7.19	255,268.00	254,066.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>951,704,779.59</b>	<b>766,656,929.32</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>951,704,779.59</b>	<b>766,656,929.32</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	951,704,779.59	951,704,779.59
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）	-95,162,037.76	-427,363,719.03	-522,525,756.79
其中：1.基金申购款	65,004,759.29	255,241,021.81	320,245,781.10
2.基金赎回款	-160,166,797.05	-682,604,740.84	-842,771,537.89
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）	372,249,803.40	2,048,121,160.68	2,420,370,964.08
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	-	766,656,929.32	766,656,929.32
三、本期基金份额交易	-33,477,940.24	-96,572,075.75	-130,050,015.99

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	59,760,036.89	161,718,761.95	221,478,798.84
2.基金赎回款	-93,237,977.13	-258,290,837.70	-351,528,814.83
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)	467,411,841.16	1,523,780,100.12	1,991,191,941.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 朱学华, 主管会计工作负责人: 朱学华, 会计机构负责人: 陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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“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“中小盘成长股票基金”),《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,已于中小盘成长股票基金基金合同生效日全部转为中小盘成长股票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,中小盘成长股票基金于 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。

中小盘成长股票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 号审计报告予以验证。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 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》,华安中小盘成长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安中小盘成长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《华安中小盘成长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国内依法公开发行、上市的股票(含存托凭证)、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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2021 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《华安中小盘成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款

项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务

的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

活期存款	282,719,030.09	227,757,330.34
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	282,719,030.09	227,757,330.34

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,733,768,156.47	2,175,369,013.39	441,600,856.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,392,300.00	3,414,784.34
	银行间市场	-	-
	合计	3,392,300.00	3,414,784.34
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,737,160,456.47	2,178,783,797.73	441,623,341.26
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,506,477,966.95	1,763,612,354.19	257,134,387.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-



债券	交易所市场	5,934,600.00	7,592,836.08	1,658,236.08
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,934,600.00	7,592,836.08	1,658,236.08
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,512,412,566.95	1,771,205,190.27	258,792,623.32

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	21,233.43	74,822.02
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	3,308.80	1,515.70
应收债券利息	5,160.86	8,998.08
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	-	-

其他	273.70	326.30
合计	29,976.79	85,662.10

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	6,413,786.99	4,266,665.06
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	6,413,786.99	4,266,665.06

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	3,061.14	1,693.13
预提费用	217,000.00	216,000.00
合计	720,061.14	717,693.13

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	150,479,419.08	65,004,759.29
本期赎回（以“-”号填列）	-370,771,959.34	-160,166,797.05

本期末	861,726,996.14	372,249,803.40
-----	----------------	----------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额

#### 7.4.7.10 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	1,288,507,606.73	235,272,493.39	1,523,780,100.12
本期利润	768,874,061.65	182,830,717.94	951,704,779.59
本期基金份额交易产生的变动数	-352,012,138.13	-75,351,580.90	-427,363,719.03
其中：基金申购款	197,807,534.96	57,433,486.85	255,241,021.81
基金赎回款	-549,819,673.09	-132,785,067.75	-682,604,740.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,705,369,530.25	342,751,630.43	2,048,121,160.68

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	1,363,374.15	2,039,893.55
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	62,875.68	66,840.63
其他	10,897.75	16,297.53
合计	1,437,147.58	2,123,031.71

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	808,797,283.74	485,794,233.96
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	808,797,283.74	485,794,233.96

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,229,393,732.31	5,059,549,801.71
减：卖出股票成本总额	5,420,596,448.57	4,573,755,567.75
买卖股票差价收入	808,797,283.74	485,794,233.96

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,859,611.41	-41,980.85
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,859,611.41	-41,980.85

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,943,936.29	42,233,355.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,067,100.00	40,781,740.00
减：应收利息总额	17,224.88	1,493,596.24
买卖债券差价收入	3,859,611.41	-41,980.85

**7.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,514,433.01	14,125,539.62
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,514,433.01	14,125,539.62

**7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	182,830,717.94	309,225,818.41
——股票投资	184,466,469.68	307,605,166.17
——债券投资	-1,635,751.74	1,620,652.24
——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	182,830,717.94	309,225,818.41

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	331,744.39	112,304.48
其他	408.87	-
基金转换费收入	29,627.50	36,225.82
合计	361,780.76	148,530.30

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	18,300,015.61	15,298,594.72
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	18,300,015.61	15,298,594.72

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	97,000.00	96,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
账户维护费	36,000.00	36,600.00
其他费用	1,200.00	600.00
银行汇划费用	1,068.00	866.75
合计	255,268.00	254,066.75

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2021]669 号文核准，华安基金管理有限公司股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“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
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例

国泰君安	580,510,855.16	4.91%	652,886,457.50	6.48%
------	----------------	-------	----------------	-------

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	529,020.75	4.86%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	594,974.25	6.42%	37,701.36	0.88%

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,908,635.42	25,653,398.40
其中：支付销售机构的客户维护费	5,861,313.67	4,665,412.71

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,651,439.32	4,275,566.48

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	282,719,030.09	1,363,374.15	227,757,330.34	2,039,893.55

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688286	敏芯股份	网下申购	1,681.00	105,875.01
国泰君安证券股份有限公司	605066	天正电气	网下申购	1,278.00	12,805.56
国泰君安证券股份有限公司	688339	亿华通	网下申购	2,761.00	212,688.80
国泰君安证券股份有限公司	688229	博睿数据	网下申购	1,643.00	108,682.97
国泰君安证券股份有限公司	605388	均瑶健康	网下申购	1,230.00	16,518.90
国泰君安证券股份有限公司	688017	绿的谐波	网下申购	4,138.00	145,803.67
国泰君安证券股份有限公司	688095	福昕软件	网下申购	1,981.00	474,890.57
国泰君安证券股份有限公司	603112	华翔股份	网下申购	920.00	7,194.40
国泰君安证券股份有限公司	688698	伟创电气	网下申购	4,751.00	51,328.62

国泰君安证券股份有限公司	003003	天元股份	网下申购	756.00	7,930.44
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	603267	鸿远电子	网下申购	1,651.00	33,416.24
国泰君安证券股份有限公司	603915	国茂股份	网下申购	2,523.00	26,113.05

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	新股限售	28.78	68.71	24,951.00	718,089.78	1,714,383.21	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股限售	138.02	126.67	381.00	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股限售	43.76	51.10	895.00	39,165.20	45,734.50	-

300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股限售	71.71	90.85	166.00	11,903.86	15,081.10	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	41.26	43.28	593.00	24,467.18	25,665.04	-
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	10.16	110.88	862.00	8,757.92	95,578.56	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	新股限售	33.61	38.70	618.00	20,770.98	23,916.60	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股限售	21.34	37.84	871.00	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股限售	30.72	41.32	484.00	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	30.54	50.85	569.00	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	41.34	48.72	401.00	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股限售	10.58	27.12	466.00	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股限售	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股限售	24.87	33.51	499.00	12,410.13	16,721.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股限售	44.47	74.52	210.00	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股限售	27.97	30.12	479.00	13,397.63	14,427.48	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股限售	3.64	16.40	1,143.00	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	新股限售	26.66	60.01	272.00	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股限售	13.47	35.08	276.00	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-06-30	新股限售	14.07	36.97	628.00	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股限售	12.65	45.30	283.00	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股限售	118.27	603.36	473.00	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股限售	10.78	33.03	496.00	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	新股限售	17.87	33.16	879.00	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新股限售	15.38	24.26	551.00	8,474.38	13,367.26	-

300907	康平科技	2020-11-11	2021-05-18	新股限售	14.30	26.85	473.00	6,763.90	12,700.05	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股限售	39.74	60.44	285.00	11,325.90	17,225.40	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股限售	30.26	47.87	474.00	14,343.24	22,690.38	-
300913	兆龙互连	2020-11-27	2021-06-07	新股限售	13.21	23.94	630.00	8,322.30	15,082.20	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新股限售	4.97	8.94	1,063.00	5,283.11	9,503.22	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股限售	16.05	31.58	287.00	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新股限售	20.08	37.33	353.00	7,088.24	13,177.49	-
688060	云涌科技	2020-07-03	2021-01-11	新股限售	44.47	81.69	2,400.00	106,728.00	196,056.00	-
688165	埃夫特	2020-07-07	2021-01-15	新股限售	6.35	13.10	28,728.00	182,422.80	376,336.80	-
688221	前沿生物	2020-10-20	2021-04-28	新股限售	20.50	17.15	16,148.00	331,034.00	276,938.20	-
688229	博睿数据	2020-08-07	2021-02-18	新股限售	65.82	101.25	1,643.00	108,142.26	166,353.75	-
688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	新股限售	14.56	30.97	5,924.00	86,253.44	183,466.28	-
688608	恒玄科技	2020-12-07	2021-06-16	新股限售	162.07	272.00	4,179.00	677,290.53	1,136,688.00	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225.00	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	10.76	10.76	359.00	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946.00	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	13.39	217.00	2,905.63	2,905.63	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上	16.95	16.95	507.00	8,593.65	8,593.65	-

				市						
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673.00	124,571.58	124,571.58	-
<b>7.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
113616	韦尔转债	2020-12-29	2021-01-22	配债未上市	100.00	100.00	8,090.00	809,000.00	809,000.00	-

注： 1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 7.4.13.1 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管理委员会，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；在管理层层面设立风险控制委员会，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总经理负责，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.14%(2019 年 12 月 31 日：0.38%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流



动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.25%。

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。于 2020 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 2,455,638,210.62 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。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、存出保证金和债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	282,719,030.09	-	-	-	282,719,030.09
结算备付金	7,352,794.36	-	-	-	7,352,794.36
存出保证金	608,332.87	-	-	-	608,332.87
交易性金融资产	3,414,784.34	-	-	2,175,369,013.39	2,178,783,797.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	29,976.79	29,976.79
应收申购款	-	-	-	157,512.15	157,512.15
资产总计	294,094,941.66	-	-	2,175,556,502.33	2,469,651,443.99
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	-	-	-	33,547,921.48	33,547,921.48
应付赎回款	-	-	-	5,171,461.00	5,171,461.00
应付管理人报酬	-	-	-	2,937,608.93	2,937,608.93
应付托管费	-	-	-	489,601.49	489,601.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,413,786.99	6,413,786.99
应交税费	-	-	-	38.88	38.88
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	720,061.14	720,061.14
负债总计	-	-	-	49,280,479.91	49,280,479.91
利率敏感度缺口	294,094,941.66	-	-	2,126,276,022.42	2,420,370,964.08
上年度末 2019 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
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账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 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 0.14%（2019 年 12 月 31 日：0.38%）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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票(含存托凭证)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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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为基金总资产的 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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,175,369,013.39	89.88	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	-	-	-	-
合计	2,175,369,013.39	89.88	1,763,612,354.19	88.57

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 147,210,000.00	增加约 118,350,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 147,210,000.00	减少约 118,350,000.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,172,761,668.38 元，属于第二层次的余额为 6,022,129.35 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 1,709,846,686.78 元，第二层次 61,358,503.49 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,175,369,013.39	88.08
	其中：股票	2,175,369,013.39	88.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,414,784.34	0.14
	其中：债券	3,414,784.34	0.14
	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	290,071,824.45	11.75
8	其他各项资产	795,821.81	0.03
9	合计	2,469,651,443.99	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,743,895,964.24	72.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,465.06	0.00
E	建筑业	13,344.48	0.00
F	批发和零售业	68,338.97	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	41,861,642.95	1.73
H	住宿和餐饮业	23,405.23	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	151,109,290.34	6.24
J	金融业	14,699,786.01	0.61
K	房地产业	6,490,050.00	0.27
L	租赁和商务服务业	191,319,202.20	7.90
M	科学研究和技术服务业	25,440,760.17	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	380,502.47	0.02
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	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,175,369,013.39	89.88

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601888	中国中免	677,356	191,319,202.20	7.90
2	600460	士兰微	3,849,597	96,239,925.00	3.98
3	002475	立讯精密	1,638,681	91,962,777.72	3.80
4	002460	赣锋锂业	761,300	77,043,560.00	3.18
5	688567	孚能科技	1,654,930	75,713,047.50	3.13
6	000661	长春高新	159,164	71,450,311.24	2.95
7	600882	妙可蓝多	1,183,363	67,570,027.30	2.79
8	603501	韦尔股份	287,697	66,486,776.70	2.75
9	603068	博通集成	690,600	58,894,368.00	2.43
10	002214	大立科技	1,990,100	54,767,552.00	2.26
11	300613	富瀚微	428,881	51,688,738.12	2.14
12	002202	金风科技	3,591,000	51,171,750.00	2.11
13	603345	安井食品	260,480	50,238,777.60	2.08
14	300113	顺网科技	2,825,684	48,460,480.60	2.00
15	688036	传音控股	314,962	47,918,318.68	1.98
16	300750	宁德时代	134,900	47,364,739.00	1.96
17	300782	卓胜微	81,300	46,384,902.00	1.92
18	002241	歌尔股份	1,162,717	43,392,598.44	1.79
19	300073	当升科技	653,518	42,380,642.30	1.75
20	601111	中国国航	5,580,800	41,800,192.00	1.73
21	300316	晶盛机电	1,382,608	41,588,848.64	1.72
22	002236	大华股份	2,077,635	41,324,160.15	1.71
23	002531	天顺风能	4,625,000	38,942,500.00	1.61
24	000902	新洋丰	2,430,500	38,888,000.00	1.61
25	002415	海康威视	765,453	37,132,125.03	1.53
26	000910	大亚圣象	2,545,904	35,540,819.84	1.47
27	688396	华润微	556,192	34,756,438.08	1.44
28	300001	特锐德	1,089,000	31,973,040.00	1.32
29	300274	阳光电源	441,790	31,932,581.20	1.32



30	002371	北方华创	169,900	30,707,726.00	1.27
31	002080	中材科技	1,159,766	28,043,141.88	1.16
32	600176	中国巨石	1,404,398	28,031,784.08	1.16
33	601012	隆基股份	300,400	27,696,880.00	1.14
34	688008	澜起科技	321,516	26,647,246.08	1.10
35	300327	中颖电子	770,600	25,106,148.00	1.04
36	300825	阿尔特	896,700	24,748,920.00	1.02
37	601615	明阳智能	1,236,200	23,463,076.00	0.97
38	300593	新雷能	696,040	20,929,922.80	0.86
39	688536	思瑞浦	47,461	20,503,152.00	0.85
40	000913	钱江摩托	772,700	19,773,393.00	0.82
41	688200	华峰测控	46,261	17,279,871.33	0.71
42	300760	迈瑞医疗	39,400	16,784,400.00	0.69
43	000049	德赛电池	239,100	16,163,160.00	0.67
44	603290	斯达半导	65,100	15,682,590.00	0.65
45	300054	鼎龙股份	795,800	15,048,578.00	0.62
46	300562	乐心医疗	680,340	14,892,642.60	0.62
47	002600	领益智造	1,226,100	14,700,939.00	0.61
48	688099	晶晨股份	178,673	14,066,925.29	0.58
49	300059	东方财富	416,700	12,917,700.00	0.53
50	002129	中环股份	458,900	11,701,950.00	0.48
51	002139	拓邦股份	1,302,800	10,565,708.00	0.44
52	600316	洪都航空	170,600	9,702,022.00	0.40
53	300474	景嘉微	123,100	8,605,921.00	0.36
54	688111	金山办公	18,860	7,751,460.00	0.32
55	002152	广电运通	718,766	7,676,420.88	0.32
56	002851	麦格米特	194,626	6,628,961.56	0.27
57	600817	ST 宏盛	441,500	6,490,050.00	0.27
58	688508	芯朋微	65,687	6,207,421.50	0.26
59	688981	中芯国际	93,966	5,426,536.50	0.22
60	600690	海尔智家	163,000	4,761,230.00	0.20
61	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.07
62	688003	天准科技	54,652	1,648,304.32	0.07
63	688063	派能科技	5,499	1,422,151.38	0.06
64	688608	恒玄科技	4,179	1,136,688.00	0.05
65	002749	国光股份	98,200	1,072,344.00	0.04
66	300785	值得买	8,839	803,288.32	0.03
67	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.02
68	688301	奕瑞科技	2,427	416,691.63	0.02
69	688658	悦康药业	16,580	404,054.60	0.02
70	688165	埃夫特	28,728	376,336.80	0.02
71	688051	佳华科技	4,053	329,022.54	0.01
72	688179	阿拉丁	3,944	314,731.20	0.01
73	688578	艾力斯	10,734	305,704.32	0.01

74	300894	火星人	6,279	300,116.16	0.01
75	300910	瑞丰新材	4,736	293,327.38	0.01
76	688186	广大特材	8,033	291,437.24	0.01
77	688330	宏力达	3,573	289,234.35	0.01
78	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
79	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.01
80	688135	利扬芯片	5,658	242,784.78	0.01
81	300898	熊猫乳品	4,953	227,377.26	0.01
82	688550	瑞联新材	2,539	218,633.29	0.01
83	300908	仲景食品	2,847	218,419.26	0.01
84	688365	光云科技	8,249	215,793.84	0.01
85	300884	狄耐克	4,985	212,669.97	0.01
86	688286	敏芯股份	1,681	209,267.69	0.01
87	688136	科兴制药	4,981	203,424.04	0.01
88	300891	惠云钛业	11,425	201,970.44	0.01
89	300901	中胤时尚	9,611	200,966.01	0.01
90	603087	甘李药业	1,506	199,123.32	0.01
91	688386	泛亚微透	3,217	197,974.18	0.01
92	688060	云涌科技	2,400	196,056.00	0.01
93	300912	凯龙高科	5,117	194,701.85	0.01
94	300913	兆龙互连	6,300	192,893.40	0.01
95	688127	蓝特光学	5,322	191,698.44	0.01
96	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.01
97	688398	赛特新材	3,246	179,179.20	0.01
98	300902	国安达	5,510	177,906.88	0.01
99	300907	康平科技	4,724	169,221.87	0.01
100	688155	先惠技术	2,403	168,210.00	0.01
101	688229	博睿数据	1,643	166,353.75	0.01
102	300925	法本信息	3,528	162,719.99	0.01
103	300887	谱尼测试	2,098	162,705.52	0.01
104	688289	圣湘生物	1,378	157,023.10	0.01
105	002985	北摩高科	782	151,160.60	0.01
106	300889	爱克股份	4,786	150,141.05	0.01
107	688069	德林海	2,253	143,696.34	0.01
108	688569	铁科轨道	6,841	140,514.14	0.01
109	300895	铜牛信息	2,829	138,795.98	0.01
110	300880	迦南智能	3,732	137,374.92	0.01
111	688500	慧辰资讯	3,414	133,897.08	0.01
112	688378	奥来德	2,411	133,014.87	0.01
113	300879	大叶股份	4,660	130,908.72	0.01
114	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
115	300918	南山智尚	10,626	123,398.55	0.01
116	688093	世华科技	4,595	114,001.95	0.00
117	688077	大地熊	2,829	109,029.66	0.00

118	300893	松原股份	2,756	106,451.68	0.00
119	688560	明冠新材	3,832	105,226.72	0.00
120	688699	明微电子	1,869	103,112.73	0.00
121	601568	北元集团	11,007	101,154.33	0.00
122	300881	盛德鑫泰	2,906	99,907.36	0.00
123	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
124	605009	豪悦护理	497	94,579.10	0.00
125	688309	恒誉环保	2,880	94,550.40	0.00
126	688678	福立旺	4,198	91,516.40	0.00
127	688013	天臣医疗	3,022	91,294.62	0.00
128	605111	新洁能	435	85,059.90	0.00
129	688698	伟创电气	4,751	84,995.39	0.00
130	605358	立昂微	693	83,437.20	0.00
131	688571	杭华股份	8,200	82,820.00	0.00
132	688590	新致软件	4,171	82,168.70	0.00
133	688557	兰剑智能	1,812	73,331.64	0.00
134	601187	厦门银行	5,129	67,702.80	0.00
135	688308	欧科亿	2,457	66,928.68	0.00
136	605376	博迁新材	1,421	66,787.00	0.00
137	688577	浙海德曼	1,503	65,245.23	0.00
138	688215	瑞晟智能	1,229	58,094.83	0.00
139	300824	北鼎股份	1,954	54,575.22	0.00
140	002991	甘源食品	638	52,284.10	0.00
141	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
142	002993	奥海科技	720	47,779.20	0.00
143	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
144	003009	中天火箭	623	45,416.70	0.00
145	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
146	605338	巴比食品	1,012	38,213.12	0.00
147	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.00
148	601702	华峰铝业	4,166	34,744.44	0.00
149	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
150	003012	东鹏控股	2,278	32,803.20	0.00
151	003021	兆威机电	425	30,226.00	0.00
152	601686	友发集团	2,374	29,390.12	0.00
153	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
154	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
155	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
156	603565	中谷物流	1,250	28,512.50	0.00
157	605388	均瑶健康	1,230	27,527.40	0.00
158	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
159	605136	丽人丽妆	867	24,510.09	0.00
160	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
161	605108	同庆楼	983	23,405.23	0.00

162	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
163	605068	明新旭腾	641	21,095.31	0.00
164	003005	竞业达	412	20,406.36	0.00
165	003006	百亚股份	804	20,220.60	0.00
166	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
167	605336	帅丰电器	701	19,880.36	0.00
168	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
169	605099	共创草坪	624	19,375.20	0.00
170	605366	宏柏新材	1,588	19,373.60	0.00
171	605158	华达新材	1,713	19,117.08	0.00
172	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
173	002992	宝明科技	692	18,559.44	0.00
174	605169	洪通燃气	731	18,465.06	0.00
175	605222	起帆电缆	858	18,438.42	0.00
176	003019	宸展光电	601	18,084.09	0.00
177	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
178	003010	若羽臣	562	17,837.88	0.00
179	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.00
180	603931	格林达	431	17,567.56	0.00
181	605199	葫芦娃	726	17,511.12	0.00
182	003015	日久光电	1,128	16,818.48	0.00
183	605066	天正电气	1,278	16,716.24	0.00
184	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
185	605166	聚合顺	1,641	16,377.18	0.00
186	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
187	003016	欣贺股份	1,681	15,784.59	0.00
188	605177	东亚药业	439	15,584.50	0.00
189	605100	华丰股份	349	15,450.23	0.00
190	605088	冠盛股份	716	15,343.88	0.00
191	605151	西上海	723	15,219.15	0.00
192	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
193	605500	森林包装	762	14,980.92	0.00
194	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
195	002999	天禾股份	1,233	14,648.04	0.00
196	605007	五洲特纸	598	14,465.62	0.00
197	605399	晨光新材	811	14,379.03	0.00
198	003002	壶化股份	921	14,017.62	0.00
199	003027	同兴环保	349	14,008.86	0.00
200	003013	地铁设计	724	13,437.44	0.00
201	605006	山东玻纤	1,618	13,364.68	0.00
202	003001	中岩大地	432	13,344.48	0.00
203	605058	澳弘电子	548	13,168.44	0.00
204	300859	西域旅游	643	13,014.32	0.00
205	605050	福然德	1,197	12,939.57	0.00

206	003020	立方制药	374	12,858.12	0.00
207	003018	金富科技	1,027	12,806.69	0.00
208	605183	确成股份	741	12,567.36	0.00
209	002998	优彩资源	1,353	12,528.78	0.00
210	603408	建霖家居	762	12,428.22	0.00
211	605258	协和电子	340	12,420.20	0.00
212	300839	博汇股份	502	12,228.72	0.00
213	605218	伟时电子	837	11,977.47	0.00
214	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.00
215	003003	天元股份	756	11,256.84	0.00
216	003025	思进智能	305	10,763.45	0.00
217	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
218	603112	华翔股份	920	10,488.00	0.00
219	605018	长华股份	840	10,416.00	0.00
220	003000	华文食品	684	10,047.96	0.00
221	003004	声迅股份	306	9,984.78	0.00
222	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.00
223	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
224	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
225	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
226	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300782	卓胜微	219,736,644.40	11.04
2	002236	大华股份	194,738,088.43	9.78
3	601888	中国中免	132,084,747.22	6.63
4	688396	华润微	124,979,550.63	6.28
5	603501	韦尔股份	99,626,651.67	5.00
6	000063	中兴通讯	99,167,416.43	4.98
7	603290	斯达半导	98,694,056.47	4.96
8	300037	新宙邦	87,648,590.33	4.40
9	688036	传音控股	82,437,051.60	4.14
10	600872	中炬高新	78,481,940.82	3.94
11	688567	孚能科技	76,712,997.17	3.85
12	002709	天赐材料	75,004,307.08	3.77
13	603345	安井食品	74,472,026.35	3.74

14	688008	澜起科技	73,302,108.31	3.68
15	002460	赣锋锂业	73,130,459.89	3.67
16	600460	士兰微	72,748,082.82	3.65
17	000876	新希望	70,852,804.20	3.56
18	300188	美亚柏科	69,982,993.57	3.51
19	601231	环旭电子	67,669,969.28	3.40
20	000938	紫光股份	67,579,128.69	3.39
21	000725	京东方 A	67,262,506.60	3.38
22	002127	南极电商	66,973,538.20	3.36
23	600185	格力地产	66,120,089.16	3.32
24	601111	中国国航	65,791,283.63	3.30
25	600673	东阳光	65,718,556.55	3.30
26	300168	万达信息	64,349,824.00	3.23
27	002600	领益智造	61,278,492.38	3.08
28	300724	捷佳伟创	60,996,502.43	3.06
29	600882	妙可蓝多	59,603,009.82	2.99
30	002241	歌尔股份	58,084,457.72	2.92
31	002507	涪陵榨菜	56,147,684.16	2.82
32	002214	大立科技	54,395,358.37	2.73
33	300316	晶盛机电	54,049,074.67	2.71
34	300113	顺网科技	52,363,923.81	2.63
35	300613	富瀚微	51,826,661.27	2.60
36	000568	泸州老窖	50,919,995.30	2.56
37	688536	思瑞浦	49,141,254.55	2.47
38	600570	恒生电子	48,979,147.99	2.46
39	002459	晶澳科技	48,878,948.92	2.45
40	000977	浪潮信息	48,159,401.50	2.42
41	601012	隆基股份	48,142,566.39	2.42
42	300474	景嘉微	47,225,188.82	2.37
43	603068	博通集成	47,127,001.79	2.37
44	002202	金风科技	46,256,777.07	2.32
45	000988	华工科技	45,699,719.31	2.30
46	600233	圆通速递	45,204,824.84	2.27
47	000910	大亚圣象	44,892,953.32	2.25
48	600031	三一重工	44,354,065.94	2.23
49	603131	上海沪工	44,187,761.97	2.22
50	600419	天润乳业	43,275,232.83	2.17
51	600529	山东药玻	43,184,815.04	2.17
52	600276	恒瑞医药	42,832,209.80	2.15
53	002301	齐心集团	42,561,185.66	2.14
54	002385	大北农	42,204,445.39	2.12
55	000661	长春高新	41,909,429.79	2.10
56	002292	奥飞娱乐	41,801,689.28	2.10
57	002371	北方华创	41,688,275.00	2.09

58	300674	宇信科技	40,712,229.68	2.04
59	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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300782	卓胜微	227,045,441.49	11.40
2	000636	风华高科	161,730,087.28	8.12
3	002236	大华股份	160,915,841.49	8.08
4	000063	中兴通讯	152,345,498.99	7.65
5	000725	京东方 A	141,864,156.61	7.12
6	300037	新宙邦	123,069,621.59	6.18
7	601138	工业富联	121,384,058.29	6.10
8	000977	浪潮信息	115,718,990.91	5.81
9	600872	中炬高新	107,025,512.49	5.37
10	002371	北方华创	98,120,231.50	4.93
11	688396	华润微	96,349,197.57	4.84
12	603290	斯达半导	91,233,752.85	4.58
13	603345	安井食品	89,086,206.72	4.47
14	002709	天赐材料	79,162,108.59	3.98
15	603129	春风动力	78,098,418.82	3.92
16	601888	中国中免	75,996,529.46	3.82
17	600276	恒瑞医药	75,377,053.36	3.79
18	601231	环旭电子	74,587,934.39	3.75
19	300327	中颖电子	72,016,487.53	3.62
20	603799	华友钴业	70,153,954.89	3.52
21	000661	长春高新	67,743,283.80	3.40
22	000938	紫光股份	66,754,301.21	3.35
23	603160	汇顶科技	66,508,369.86	3.34
24	600185	格力地产	65,362,864.85	3.28
25	300657	弘信电子	63,978,738.95	3.21
26	300168	万达信息	61,404,142.97	3.08
27	300760	迈瑞医疗	60,957,015.11	3.06
28	000011	深物业 A	60,861,640.22	3.06
29	002507	涪陵榨菜	60,699,776.52	3.05
30	002459	晶澳科技	60,502,284.04	3.04

31	688036	传音控股	60,443,794.93	3.04
32	300724	捷佳伟创	60,215,716.13	3.02
33	002292	奥飞娱乐	58,981,760.42	2.96
34	002127	南极电商	56,499,196.58	2.84
35	600529	山东药玻	55,709,343.52	2.80
36	002400	省广集团	55,472,767.49	2.79
37	603501	韦尔股份	55,098,857.42	2.77
38	300188	美亚柏科	55,052,194.54	2.76
39	000876	新希望	54,623,664.31	2.74
40	600233	圆通速递	51,896,628.94	2.61
41	002600	领益智造	50,671,990.38	2.54
42	000568	泸州老窖	49,057,789.30	2.46
43	000768	中航西飞	47,985,000.94	2.41
44	600760	中航沈飞	47,100,911.23	2.37
45	600882	妙可蓝多	47,091,511.27	2.36
46	600031	三一重工	47,040,971.42	2.36
47	688008	澜起科技	46,854,814.38	2.35
48	300274	阳光电源	46,354,054.82	2.33
49	002475	立讯精密	46,312,894.23	2.33
50	600419	天润乳业	46,064,308.62	2.31
51	000988	华工科技	45,837,363.50	2.30
52	600673	东阳光	45,835,269.75	2.30
53	002301	齐心集团	45,019,150.33	2.26
54	300433	蓝思科技	43,880,401.52	2.20
55	300316	晶盛机电	43,449,313.91	2.18
56	600372	中航电子	41,353,507.81	2.08
57	000001	平安银行	41,206,147.82	2.07
58	300595	欧普康视	40,601,884.10	2.04
59	002415	海康威视	40,489,070.76	2.03
60	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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,647,886,638.09
卖出股票的收入（成交）总额	6,229,393,732.31

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。



8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,414,784.34	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,414,784.34	0.14

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113569	科达转债	19,380	1,785,091.80	0.07
2	128136	立讯转债	6,453	820,692.54	0.03
3	113616	韦尔转债	8,090	809,000.00	0.03

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	608,332.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,976.79
5	应收申购款	157,512.15

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	795,821.81

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113569	科达转债	1,785,091.80	0.07

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
64,809	13,296.41	124,339,547.02	14.43%	737,387,449.12	85.57%

#### 9.2 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	3,008.23	0.00%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发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。

**§10 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	150,479,419.08
减：本报告期基金总赎回份额	370,771,959.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	861,726,996.14

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2020年8月15日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，童威先生离任本基金管理人的总经理。

(2) 2020年8月22日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，薛珍女士离任本基金管理人的督察长。

(3) 2020年10月17日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生新任本基金管理人的总经理。

(4) 2020年12月18日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》，范伟隽先生新任本基金管理人的首席信息官。

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。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

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

诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

#### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

#### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 97,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

#### 11.7 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。

#### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.8.1 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	
中天证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	1,948,806,881.01	16.47%	1,814,929.94	16.68%	-
国金证券	2	1,544,699,049.37	13.06%	1,410,502.01	12.97%	-
中信证券	1	803,421,336.25	6.79%	748,223.11	6.88%	-
东吴证券	1	708,324,792.54	5.99%	645,498.89	5.93%	-
华泰证券	1	699,656,878.30	5.91%	637,598.93	5.86%	-
瑞银证券	1	655,030,173.61	5.54%	596,928.94	5.49%	-
东方财富	1	651,782,071.80	5.51%	593,970.79	5.46%	-
国泰君安证券	1	580,510,855.16	4.91%	529,020.75	4.86%	-
兴业证券	1	515,549,747.42	4.36%	480,126.64	4.41%	-
广发证券	1	506,368,189.20	4.28%	461,452.88	4.24%	-
中金公司	1	437,545,019.66	3.70%	407,485.54	3.75%	-
中泰证券	2	435,988,291.06	3.69%	397,316.81	3.65%	-
红塔证券	1	435,942,902.99	3.69%	405,993.80	3.73%	-
天风证券	1	396,912,928.71	3.36%	361,705.51	3.32%	-
华西证券	1	353,960,819.73	2.99%	329,642.37	3.03%	-
招商证券	1	289,718,012.95	2.45%	264,020.78	2.43%	-
开源证券	1	224,696,067.97	1.90%	204,765.67	1.88%	-
长江证券	1	193,119,057.30	1.63%	175,989.49	1.62%	-
中金财富证券	2	183,624,784.28	1.55%	171,010.26	1.57%	-
华金证券	1	142,460,965.16	1.20%	129,824.25	1.19%	-
国信证券	1	47,606,959.49	0.40%	44,336.66	0.41%	-
华创证券	1	41,096,077.91	0.35%	38,272.62	0.35%	-
银河证券	1	32,482,744.81	0.27%	30,252.20	0.28%	-
安信证券	1	33,837.80	0.00%	30.84	0.00%	-

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月完成租用托管在工商银行的华西证券上海45727交易单元

2020年6月完成租用托管在工商银行的开源证券深圳010273交易单元

2020年6月托管在工商银行的长城证券上海交易单元20267退租完成

2020年8月托管在工商银行的中天证券深圳交易单元201500退租完成

2020年9月完成租用托管在工商银行的申港证券深圳010530交易单元

11.8.2 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
中天证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发华福证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-

华融证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	3,987,221.60	26.68%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	6,947,198.21	46.49%	-	-	-	-
华泰证券	1,039,496.93	6.96%	-	-	-	-
瑞银证券	949,106.05	6.35%	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,722,158.70	11.52%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	298,754.80	2.00%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-21
2	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-28
3	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2020-02-04



		定媒介	
4	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等指定媒介	2020-03-07
5	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等指定媒介	2020-03-07
6	华安中小盘成长混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
7	华安中小盘成长混合型证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
8	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
9	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-14
10	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-25
11	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-30
12	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-11
13	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-22
14	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-05-21
15	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	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-16
16	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
17	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
18	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交	中国证监会基金电子披	2020-06-30

	通银行费率优惠活动的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
19	关于旗下部分基金增加南京证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-14
20	关于旗下基金参加哈尔滨银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-17
21	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-21
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(亿华通)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-04
23	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(天正电气)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-04
24	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(敏芯股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-04
25	关于旗下基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-08
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(博睿数据)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-11
27	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(均瑶健康)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-12
28	华安基金关于旗下基金参加渤海银行优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-15
29	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-15
30	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-22
31	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(绿的谐波)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-25
32	华安基金管理有限公司关于暂停深圳信诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-25

33	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-28
34	华安中小盘成长混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-31
35	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(福昕软件)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-02
36	华安基金管理有限公司关于暂停中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-02
37	华安基金管理有限公司关于暂停北京辉腾汇富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-02
38	华安基金管理有限公司关于暂停深圳市锦安基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-04
39	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(华翔股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-05
40	华安基金管理有限公司关于暂停上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-08
41	华安基金管理有限公司关于暂停上海有鱼基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-11
42	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(天元股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-12
43	关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-24
44	关于暂停中民财富基金销售(上海)有限公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-24
45	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-28
46	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-28
47	关于旗下基金参加嘉兴银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2020-09-29

		定媒介	
48	关于暂停前海凯恩斯基金销售有限公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-30
49	关于旗下基金参加中国建设银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-09
50	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-17
51	华安中小盘成长混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-27
52	华安基金管理有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-28
53	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等指定媒介	2020-10-29
54	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等指定媒介	2020-10-29
55	华安基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-29
56	华安中小盘成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-11-03
57	华安中小盘成长混合型证券投资基金更新的招募说明书(2020 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-11-03
58	关于旗下部分基金参加上海证券有限责任公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-11-12
59	关于旗下部分基金参加中银国际证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-11-12
60	关于旗下基金参加宁波银行费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-11-26
61	华安基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-18
62	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职	中国证监会基金电子披	2020-12-18

	的公告	露网站和公司网站等指定媒介	
63	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(伟创电气)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
64	华安基金管理有限公司关于终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
65	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28
66	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28
67	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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；

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日