

# 华安低碳生活混合型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安低碳生活混合
基金主代码	006122
交易代码	006122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 12 日
报告期末基金份额总额	232,903,284.73 份
投资目标	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	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在具体大类资产配置过程中，本基金将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

	<p>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。</p> <p>本基金所指“低碳生活”投资主线重点关注节能环保、绿色消费、新能源与新材料、新能源汽车等行业和主线。</p> <p>对于低碳生活相关股票，本基金将采用定量与定性相结合的研究方法进行投资。在定性研究方面主要采用 ESG（即环境 Environment、社会 Society 和公司治理 Governance 的简称）投资理念进行筛选，重点关注上市公司在环境友好、社会责任和公司治理等方面的实际履行情况。</p> <p>在定量研究方面，本基金基于公司财务指标分析公司的基本面价值，选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。具体的考察指标包括成长性指标（主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流）、盈利指标（毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率）等指标。结合相关财务模型的分析，形成对标的股票的初步判断。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	989,797.85
2. 本期利润	123,378,452.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.5074
4. 期末基金资产净值	626,535,547.19
5. 期末基金份额净值	2.6901

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	24.04%	1.62%	3.52%	0.67%	20.52%	0.95%
过去六个月	16.01%	1.82%	1.92%	0.93%	14.09%	0.89%
过去一年	54.95%	1.85%	17.93%	0.97%	37.02%	0.88%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	169.01%	1.62%	25.76%	1.00%	143.25%	0.62%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安低碳生活混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2019 年 3 月 12 日至 2021 年 6 月 30 日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李欣	本基金的基金经理	2019-03-12	-	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。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，历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 月至 2021 年 3 月，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。2021 年 3 月起，同时担任华安汇宏精选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 公平交易专项说明

##### 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。

#### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内, 全球经济整体而言进一步从疫情中恢复, 经济活动趋于正常增长, 很多行业

尤其是信息产品消费、新能源车消费、健康消费、食品饮料新消费等呈现出高增长亮点；而同时中美两国长端利率均有所走低，这就给市场出现成长股的结构行情提供了条件。二季度内，以新能源车和新能源发电为主要驱动的电气设备、汽车行业领涨，以 AIOT（人工智能物联网）和新能源智能网联车等新需求驱动的电子行业涨幅次之，以健康消费和医药外包服务等驱动的医药生物行业也涨幅居前。二季度的结构性市场走势体现出我国处于经济结构升级转型期的时代特征，也反映出这些行业在近期的技术进步和商业化进展，当然也和国内和全球的流动性环境有一定关系。

本基金在综合考虑宏观和流动性因素的基础上，重点研究、分析、跟踪了信息、能源、健康等领域的行业和公司的基本面发展变化，同时也考虑了基金合同对配置方向的约束与强调，综合以上因素遴选优质标的进行配置。报告期内我们注意到半导体行业出现了比以往更加显著的投资机会。在需求侧，AIOT 和智能网联车对控制芯片（SOC、MCU 等）、连接与传输芯片（wifi、蓝牙等无线传输以及各类有线连接的接口芯片）、存储芯片、各类传感器的需求大增，新能源车和光伏风电以及消费电子的快充等应用对功率半导体的需求大增；在供给侧，物联网和车载对成熟和特色工艺制程的产能有很大需求，而此类产能扩产所需设备的供应却长期不足，同时先进工艺扩产的进度在一定程度上也受到海外非市场因素的影响。新能源车处于渗透率提升速度快并且空间大的产业甜蜜期，投资价值显著。医药和新兴消费行业也显示出良好的增长态势和投资机会。本基金在确定投资标的和投资比例时，也会参考基金合同中对投资方向的相关表述。

在本基金的操作中，注重以低碳、环保、健康、节能等环境友好与生活健康的标准对投资标的进行衡量和筛选；也注重将 ESG（环境 Environment、社会 Society 和治理 Governance）的投资理念贯彻进投资组合的构建过程中。基金经理注重学习和借鉴各类 ESG 研究和 ESG 指数制定机构对 ESG 概念的全面、深入理解，并用于对投资的指导。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.6901 元，本报告期份额净值增长率为 24.04%，同期业绩比较基准增长率为 3.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为，今后相当长的一段时间内，我国经济发展的主基调是结构升级调整与补短板，体现在几个方面：继续以信息化和自动化带动制造业产业结构调整，提升在全球产业链的价值分配地位，尤其是对半导体、关键材料等短板产业重点攻关；在碳达峰、碳中和的政

策指引下，继续推动发电端的光伏风电、用电端的新能源车等新能源产业的发展，并以新能源产业为契机和抓手，实现我国在汽车、机电、化工等领域相对于全球先进水平的弯道超车；抓住生物创新药、细胞基因疗法等生物医药领域的创新浪潮，实现医药行业全球竞争力的快速提升，满足人民群众对健康和生活品质的需求；以移动互联网、优质高效工业化供应链为基础设施，发展新消费，满足多样化需求，树立中国品牌；等等。

基于对我国当前经济发展主基调是产业结构调整与升级的认知，我们持续在三大赛道上进行长期深入的研究与投资：信息产业，包括半导体、消费电子、互联网等；能源产业，包括新能源车、光伏、风电等；健康产业，包括创新药、医疗器械、医疗服务等。

信息产业方面，我们认为，半导体产业的机遇不仅在于供不应求带来的产业景气以及价格等直观表现形式，更在于为有准备的优秀企业提供了加速弯道超车的机会，使得他们得以在此供需失衡的产业环境下加速导入新客户、新产品、增强产业链掌控能力。从全球半导体供需状况来看，我们认为行业景气的持续时间很有可能比市场预期的更持久。从供给端来看，全球代工龙头公司的主要扩产方向是适用于高性能计算和核心处理器的高端制程，对于 AIOT（人工智能物联网）终端、电源管理、传感器芯片等特色应用的需求存在缺口，中国大陆龙头代工厂的扩产进度受到海外非市场因素的影响，行业供给的相对紧缺在一个时期内都是存在的；从需求端来看，新能源车、智能网联汽车、AIOT 等新应用对于半导体产生了快速而持续的增长推动力，供需对比支持半导体行业景气的持续。

我们认为，当前尤其应当重视 AIOT 对于半导体等产业环节的推动作用。AIOT 相对于智能手机，具有多样、长尾、泛在的特征。我们认为消费电子终端的发展具有“分久必合，合久必分”的规律，从 2007 年 iPhone 发布到 2020 年是智能手机的时代，几乎所有其他电子终端的功能都被聚合进智能手机这一“超级终端”，这是“合”的周期；但当智能手机的承载能力发展到相对饱和的程度以后，各种创新功能逐渐分化成为多样化的智能终端，即 AIOT，包括 VR、AR、MR 等信息交互产品，智能手写本、智能会议硬件等工作辅助产品，智能扫地机器人等家居产品，以及基于人工智能和机器视觉的安全、工业、商业管理系统等，疫情后的 WFH（work from home）催化和加速了这一“分”的进程。历史上看，PC 作为桌面互联网时代的“超级终端”，也曾经承担了聚合世纪之交的诸多电子创新功能的角色，而 PC 成熟之后、智能手机崛起之前的几年，是上一个电子终端产品多样化发展的“合久必分”的时代。

我们认为，中国半导体行业在 AIOT 时代有相对于智能手机时代更好的竞争机会。AIOT 所具有的快速迭代、市场导向、多样化个性化的特点，非常匹配中国供应链的竞争特质和资源禀赋。

能源产业方面，我们关注在电能的产生、传输、利用环节能够满足低碳、零碳要求的产业，目前阶段主要产品形态是新能源汽车、光伏、风电等。新能源车正处于渗透率尚低，但技术、供应链、产品、使用环境都已成熟的关键时间点，产业长期高速增长可期。在新能源车产业链中，我们看好几类产业环节：第一是对下游具有信息不对称，能够为整车提供安全和品质背书的产业环节，如品质控制节点众多的复杂电化学系统—电池；第二是需求弹性大、工艺壁垒高、自身扩产周期和下游增长节奏匹配的电池中上游材料；第三是电控相关的被动器件，能够借助新能源车这一产业机遇实现对欧日竞争对手的弯道超车，后者的竞争力和牌力往往是建立在工控、家电等相对成熟的行业领域之上。

新能源车天然的和智能化、网联化相关联，因为相较于热机驱动，电机驱动可以直接和数字信号控制对接。我们认为，智能汽车产业的生态系统，相较于智能手机更加多样性，两个领域的全球龙头均以软硬件一体、垂直整合的方式保持消费者体验的领先，但智能汽车发展于全球 ICT（信息与通信技术）产业已经相对发达、中国内源性创新层出不穷的时代，将智能化作为重要竞争点是“造车新势力”和传统车厂的产业共识。在系统层面，我们看好 ICT 能力强的 tier1 厂商，他们能够契合汽车控制方案从分布式控制发展到域控制再到中央集中控制的产业趋势；在器件层面，我们看好信息的采集层（摄像头、激光雷达等）、传输层、处理层相关器件的需求放量，尤其是，我们注意到目前的人工智能主要基于深度学习，其精度的提升有赖于模型层数的增多（深度更深）、参数的增加（更加细致的刻画视觉信息特征）、算法的优化，因此不仅对 GPU、NPU 等运算处理单元，也对 DRAM 等存储器件的需求有巨大的增长空间。

医药健康方面，我们认为，目前是生物技术在医药领域应用快速普及的时期。业界对于既有靶点和新靶点的认知和探索都在不断深化，对于药物结构、合成工艺、药效药理的研究也在不断深入，这些都在加速疗效更好、靶向性更强、副作用更小的创新药的推出。同时，我国具有医学、生物、化学、电子、机电等相关领域的专业人才红利，也拥有技术和管理水平先进、配套齐全的化工、机电等相关产业链，具有发展创新药、医疗器械、医疗服务等行业的优良土壤。2020 年疫情以来，全球对疫苗的大量需求，以及各种创新药在研发和生产端快速向我国进行产能转移的趋势，进一步推动了我国的 CRO 和 CDMO 产业发展。我们关注创新药相关上市公司在小分子创新药、单抗、双抗、ADC（抗体药物偶联物）、CGT（细胞和基因疗法）等领域的管线布局、试验评审与商业化进程，寻找长期成长性好的公司。我们同样看好医疗器械、医疗服务等领域的投资机会。

我们也看好消费、军工以及竞争环境明显改善的传统产业等投资方向，限于篇幅原因，

就不一一展开了。

我们认为，投资应当反映产业中正在或将要发生的变革与进步，希望努力做到：从产业中来，到投资中去。在对产业的研究中，我们努力做到三个方面：第一是努力通过专业和细致的研究缩小研究的颗粒度，提高投资在空间（细分行业和公司的选择）和时间（投资节奏应匹配产业节奏）上的精确度；第二是注重产业链研究，在上下游和相关行业间进行交叉验证；第三是以长远视角看待  $\alpha$  和  $\beta$  的关系， $\beta$ （例如供需失衡带来的涨价）是过程， $\alpha$ （例如利用供需失衡的非正常产业环境加速导入新客户、新产品，并建立供应链壁垒，抬高长期发展曲线）才是目的。

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，本基金所指的“低碳生活”是指低碳、环保、健康、节能等环境友好与健康的生活方式的统称。“低碳生活”依托节能环保、新一代信息技术、工业制造、生物医药等先进技术，为人们提供更加低碳、环保和健康的产品及服务，全面提升人们在衣、食、住、行、健康、教育、运动、娱乐等物质生活和精神生活方面的质量。基金经理注重学习和借鉴各类 ESG 研究和 ESG 指数制定机构对 ESG 概念的全面、深入理解，力求更加全面、精准的把握 ESG 投资的涵义，并用于帮助不断投高投资业绩。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	579,495,369.89	90.02
	其中：股票	579,495,369.89	90.02
2	固定收益投资	776,058.45	0.12
	其中：债券	776,058.45	0.12
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	56,373,170.67	8.76
7	其他各项资产	7,114,510.39	1.11
8	合计	643,759,109.40	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为101,933,760.70人民币，占期末净值比例16.27%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 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	87,114.38	0.01
B	采矿业	3,248,059.35	0.52
C	制造业	392,044,169.21	62.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00

E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	494,474.26	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,003,454.99	10.85
J	金融业	5,480,875.64	0.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,507,226.29	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	657,843.31	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	477,561,609.19	76.22

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
工业	5,698,316.82	0.91
非日常生活消费品	2,569,862.44	0.41
医疗保健	23,079,527.77	3.68
信息技术	70,586,053.67	11.27
合计	101,933,760.70	16.27

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	01347	华虹半导体	883,000	31,519,772.86	5.03
2	00981	中芯国际	1,522,500	30,277,519.02	4.83
3	603501	韦尔股份	91,427	29,439,494.00	4.70
4	603893	瑞芯微	193,800	27,027,348.00	4.31
5	688699	明微电子	87,601	24,994,317.32	3.99
6	300223	北京君正	233,600	23,574,912.00	3.76
7	300782	卓胜微	42,944	23,082,400.00	3.68
8	02269	药明生物	192,500	22,792,959.42	3.64

9	300613	富瀚微	142,992	22,289,592.96	3.56
10	300750	宁德时代	41,100	21,980,280.00	3.51

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	776,058.45	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	776,058.45	0.12

#### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123111	东财转 3	2,450	358,582.00	0.06
2	113616	韦尔转债	1,510	233,748.00	0.04
3	128136	立讯转债	1,571	183,728.45	0.03

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

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

## 细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	253,370.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,027.84
5	应收申购款	6,854,112.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,114,510.39

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128136	立讯转债	183,728.45	0.03

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	252,702,689.35
报告期期间基金总申购份额	52,378,877.33
减：报告期期间基金总赎回份额	72,178,281.95
报告期期间基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	232,903,284.73
-------------	----------------

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《华安低碳生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安低碳生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安低碳生活混合型证券投资基金托管协议》

### 8.2 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>。

### 8.3 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

二〇二一年七月二十日

