

华安物联网主题股票型证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§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 2023 年 1 月 18 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安物联网主题
基金主代码	001028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 17 日
报告期末基金份额总额	261,346,111.84 份
投资目标	本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择方面通过对物联网相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率

风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	华安物联网主题股票 A	华安物联网主题股票 C
下属分级基金的交易代码	001028	016292
报告期末下属分级基金的份额总额	261,296,096.13 份	50,015.71 份

§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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)	
	华安物联网主题股票 A	华安物联网主题股票 C
1.本期已实现收益	2,285,413.36	392.35
2.本期利润	-349,554.33	-1,226.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0013	-0.0272
4.期末基金资产净值	295,889,768.78	56,538.94
5.期末基金份额净值	1.132	1.130

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、华安物联网主题股票型证券投资基金自2022年8月11日起新增C类基金份额。

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

1、华安物联网主题股票 A:

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	-0.18%	1.21%	1.49%	0.94%	-1.67%	0.27%
过去六个月	-15.90%	1.23%	-9.99%	0.85%	-5.91%	0.38%
过去一年	-26.78%	1.53%	-17.01%	1.01%	-9.77%	0.52%
过去三年	29.22%	1.60%	-0.96%	1.02%	30.18%	0.58%
过去五年	48.95%	1.60%	-1.74%	1.03%	50.69%	0.57%
自基金合同 生效起至今	13.20%	1.82%	1.63%	1.17%	11.57%	0.65%

2、华安物联网主题股票 C:

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	-0.35%	1.21%	1.49%	0.94%	-1.84%	0.27%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-15.48%	1.25%	-6.46%	0.87%	-9.02%	0.38%

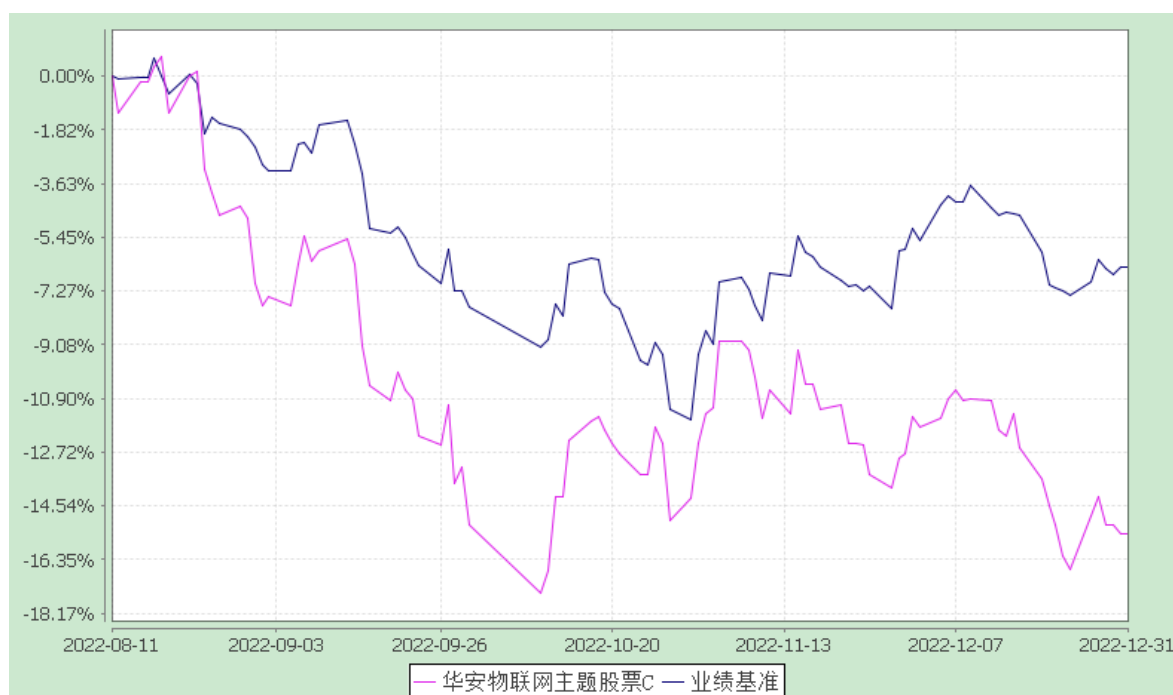
3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安物联网主题股票型证券投资基金
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
(2015 年 3 月 17 日至 2022 年 12 月 31 日)

1. 华安物联网主题股票 A:



2. 华安物联网主题股票 C:



注：华安物联网主题股票型证券投资基金自 2022 年 8 月 11 日起新增 C 类基金份额。

§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		
翁启森	本基金的基金经理，副总经理，首席投资官	2015-03-17	-	28	工业工程学硕士，28 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任公司副总经理兼首席投资官。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 3 月至 2016 年 9 月同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月至 2016 年 9 月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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。

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 2 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

四季度 A 股指数呈现区间震荡，板块分化较为严重。行业方面，社会服务、计算机、传媒等行业涨幅领先，而煤炭、石油石化、农业、电力设备新能源等行业在四季度涨幅明显落后。报告期内，本基金在契约范围内积极配置新能源、科技、高端制造等板块的优质公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.132 元，本报告期份额净值增长率为-0.18%，同期业绩比较基准增长率为 1.49%；本基金 C 类份额净值为 1.130 元，本报告期份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准增长率为 1.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度的市场分化严重，以社会服务、美容护理、商贸零售为代表的消费板块出现上涨，而煤炭、石油化工、国防军工、电力设备新能源等行业持续下跌。市场对于疫情防控政策的优化做出了对应的选择，疫后复苏成为阶段性主线。尽管短期的冲击仍未结束，但是我们持谨慎乐观的态度，预计不久的将来，消费及服务行业的数据有望接近甚至超越疫情前的水平。

自主可控领域是我们积极布局的方向。以计算机行业为代表的信创及数据要素板块，受益于国内相关政策的发力，国产替代的步伐持续加快，大数据应用有望迎来一轮景气周期。传媒行业中的广告、电影等板块，此前受到疫情影响较大，但是随着疫情防控政策的优化以及服务经济的恢复，有望看到更加积极的信号。

以军工为代表的大安全领域，持续受益于国内装备的升级以及国产化率的提升，将延续较高

的景气度。此外，军工企业的国企改革取得了显著的成效，我们将积极寻找在新一轮国企改革中受益的军工企业。半导体行业正在经历一轮去库存，整个板块的估值经历充分调整后回到了相对低位，部分掌握新产品新技术的公司值得关注。

医药行业的投资机会同样值得重视。一方面，在后疫情时代，居民正常就医需求有望恢复到疫情前水平，带动相关药品、器械、医疗服务需求的回暖。另一方面，我们观察到一些国内创新药企业在海外的加速授权，反应了这些企业的研发能力持续提高，全球竞争力正在不断上升。光伏行业伴随着产业链产能的释放，硅料推动各个环节价格下行，集中电站及分布式发电的收益率提高，需求有望得以释放。

展望 2023 年一季度，我们对市场保持谨慎乐观态度，努力寻找结构性机会。我们将密切跟踪科技、军工、消费、医药、新能源、高端制造等领域的投资机会，选择风险收益比合适的标的进行重点投资。

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	279,414,938.32	93.83
	其中：股票	279,414,938.32	93.83
2	固定收益投资	595,371.00	0.20
	其中：债券	595,371.00	0.20
	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	16,555,652.55	5.56
7	其他各项资产	1,225,857.00	0.41
8	合计	297,791,818.87	100.00

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	3,088,131.20	1.04
B	采矿业	4,350,993.00	1.47
C	制造业	212,746,972.09	71.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,028,973.11	1.02
E	建筑业	865,857.71	0.29
F	批发和零售业	1,655,026.86	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	4,376,450.80	1.48
H	住宿和餐饮业	543,120.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,302,848.04	9.23
J	金融业	11,814,209.16	3.99
K	房地产业	269,019.00	0.09
L	租赁和商务服务业	2,398,706.78	0.81
M	科学研究和技术服务业	286,225.03	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,321,024.61	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	159,314.21	0.05
R	文化、体育和娱乐业	4,588,989.92	1.55
S	综合	619,076.80	0.21

	合计	279,414,938.32	94.41
--	----	----------------	-------

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300014	亿纬锂能	99,100	8,710,890.00	2.94
2	000977	浪潮信息	361,447	7,778,339.44	2.63
3	002709	天赐材料	174,364	7,647,605.04	2.58
4	002179	中航光电	127,100	7,341,296.00	2.48
5	600760	中航沈飞	112,380	6,588,839.40	2.23
6	300316	晶盛机电	99,730	6,338,838.80	2.14
7	300750	宁德时代	14,900	5,861,958.00	1.98
8	002812	恩捷股份	43,500	5,711,115.00	1.93
9	603799	华友钴业	95,508	5,313,110.04	1.80
10	002025	航天电器	76,400	5,061,500.00	1.71

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	407,274.82	0.14
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）	188,096.18	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	595,371.00	0.20

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	019656	21 国债 08	3,000	305,253.86	0.10
2	113641	华友转债	1,370	151,626.57	0.05
3	019666	22 国债 01	1,000	102,020.96	0.03
4	118022	锂科转债	310	36,469.61	0.01

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），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

无。

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	17,559.51
2	应收证券清算款	1,182,203.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,093.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,225,857.00

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	113641	华友转债	151,626.57	0.05

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未持有存在流通受限情况的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安物联网主题股票A	华安物联网主题股票C
本报告期期初基金份额总额	261,428,145.71	37,238.03
报告期期间基金总申购份额	3,692,733.82	46,848.27
减：报告期期间基金总赎回份额	3,824,783.40	34,070.59
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	261,296,096.13	50,015.71

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安物联网主题股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安物联网主题股票型证券投资基金托管协议》

9.2 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>。

9.3 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

二〇二三年一月二十日