

**华安升级主题混合型证券投资基金**  
**2019 年年度报告**  
**2019 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：二〇二〇年四月十一日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 7 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 2019 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> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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合规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	14
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58

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 .....	58
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	61
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安升级主题混合型证券投资基金
基金简称	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 22 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
报告期末基金份额总额	344,176,068.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。即：采取“自上而下”的方式选择行业，挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题； 根据上述“自上而下”策略选择行业的基础上，采取“自下而上”的方法，运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	薛珍	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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)	中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	63,838,447.56	-28,275,510.84	2,590,652.41
本期利润	89,781,615.71	-39,073,750.47	7,898,341.33
加权平均基金份额本期利润	0.5723	-0.2622	0.0204
本期加权平均净值利润率	43.12%	-23.27%	1.82%
本期基金份额净值增长率	57.45%	-21.84%	10.46%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	179,340,033.67	-5,024,106.70	39,178,729.28
期末可供分配基金份额利润	0.5211	-0.0344	0.2362
期末基金资产净值	523,516,102.48	140,921,613.30	205,036,699.03
期末基金份额净值	1.521	0.966	1.236
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	120.68%	40.15%	79.33%

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	6.89%	0.65%	6.09%	0.59%	0.80%	0.06%
过去六个月	15.75%	0.83%	5.96%	0.68%	9.79%	0.15%
过去一年	57.45%	1.21%	29.08%	0.99%	28.37%	0.22%
过去三年	35.92%	1.24%	19.56%	0.89%	16.36%	0.35%
过去五年	97.38%	1.94%	13.84%	1.23%	83.54%	0.71%
自基金合同生效起至今	120.68%	1.67%	20.60%	1.15%	100.08%	0.52%

### 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

华安升级主题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  
(2011 年 4 月 22 日至 2019 年 12 月 31 日)

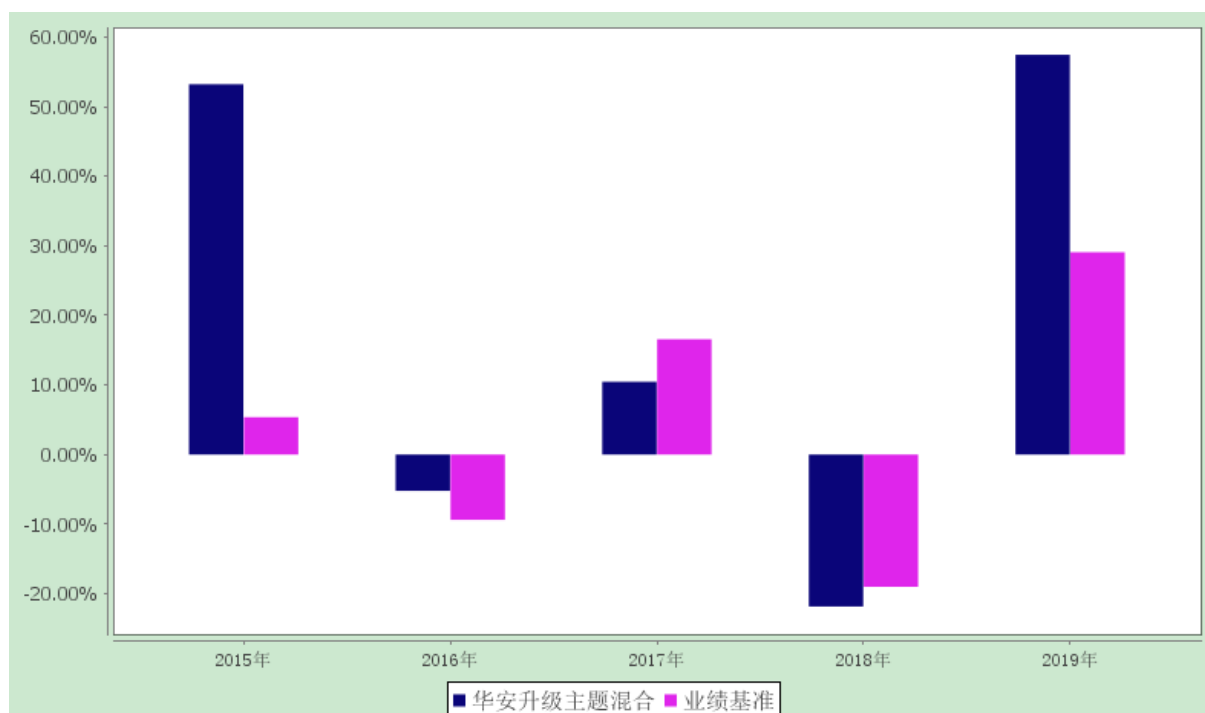


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安升级主题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

本基金过去三年未发生利润分配。

## §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 2019 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 129 只开放式基金，管理资产规模达到 3,516.57 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	12 年	硕士，12 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起同时担任本基金及华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安汇智精选两年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

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

2019 年上证指数上涨 22.3%，创业板上涨 43.8%。行业层面，电子、食品饮料、家电、建材、

农业等涨幅居前，建筑、钢铁、公用事业、零售等相对落后。从估值、业绩角度拆分看，2019 年虽然整体盈利对市场上涨有一定贡献，但主要涨幅来自估值贡献。2019 年年除市场整体估值处于历史较低位置，年末回升到历史中间水平。板块结构看，仍存在一些处于历史极低估值水平的板块。通过对宏观、行业的研究，以及精选个股，2019 年华安升级主题取得了 57.45% 的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.521 元，本报告期份额净值增长率为 57.45%，同期业绩比较基准增长率为 29.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年四季度，经济增长仍在低位徘徊，受价格因素影响，名义增速有所回升。从工业企业产能利用率及库存数据看，整体仍处于比较健康的状态。受猪肉价格上涨影响，CPI 水平较高。

展望未来，中国经济仍将长期处于“总量增长”向“高质量增长”的过渡阶段。这个阶段经济增速可能逐步放缓，但经济结构同时逐步优化。中观和微观表现为新兴行业 and 传统行业间的增长速度分化，各个行业内部的优质企业和劣质企业经营状态的分化。从投资的角度，这两个方向都值得重视，在标的的选择上，将更看重公司的质地尤其是可持续的盈利能力、业务壁垒和竞争优势。我们将结合行业轮动，筛选估值、增速更优的行业，把握转型升级的过程中的结构性变化的机会。

#### 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《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》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。估值委员会成员由投资总监、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、风险管理部总监等人员组成，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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 23325 号

华安升级主题混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了华安升级主题混合型证券投资基金(以下简称“华安升级主题基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 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。

### 6.1 审计意见

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，公允反映了华安升级主题基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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，我们独立于华安升级主题基金，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

华安升级主题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升级主题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升级主题基金、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升级主题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，就可能导致对华安升级主题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升级主题基金不能持续经营。

(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  
单峰 楼茜蓉

中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2020 年 4 月 7 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	97,792,432.32	20,008,036.95
结算备付金		719,493.24	1,011,710.95
存出保证金		125,933.68	243,377.41
交易性金融资产	7.4.7.2	435,856,610.06	122,933,351.68
其中：股票投资		435,458,810.06	122,804,141.69



基金投资		-	-
债券投资		397,800.00	129,209.99
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		4,426,765.24	22,456.68
应收利息	7.4.7.5	26,577.72	3,837.40
应收股利		-	-
应收申购款		418,897.11	13,983.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>539,366,709.37</b>	<b>144,236,754.76</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		3,135,003.45	910,188.77
应付赎回款		10,611,982.55	65,198.79
应付管理人报酬		535,775.12	182,553.65
应付托管费		89,295.86	30,425.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,263,159.94	1,788,632.02
应交税费		0.87	1.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	215,389.10	338,141.61
<b>负债合计</b>		<b>15,850,606.89</b>	<b>3,315,141.46</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	344,176,068.81	145,945,720.00
未分配利润	7.4.7.10	179,340,033.67	-5,024,106.70
<b>所有者权益合计</b>		<b>523,516,102.48</b>	<b>140,921,613.30</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>539,366,709.37</b>	<b>144,236,754.76</b>

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.521 元，基金份额总额 344,176,068.81 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 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
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>97,174,061.67</b>	<b>-28,599,642.02</b>
1.利息收入		299,441.95	237,959.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	299,397.19	237,924.56
债券利息收入		44.76	35.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		70,769,887.15	-18,070,153.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,424,195.37	-19,686,814.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,937.57	-
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	2,348,629.35	1,616,661.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	25,943,168.15	-10,798,239.63
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	161,564.42	30,790.97
<b>减：二、费用</b>		<b>7,392,445.96</b>	<b>10,474,108.45</b>
1. 管理人报酬		3,106,640.94	2,520,319.73
2. 托管费		517,773.59	420,053.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,581,858.46	7,186,388.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.17	0.14
7. 其他费用	7.4.7.19	186,172.80	347,347.25
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>89,781,615.71</b>	<b>-39,073,750.47</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>89,781,615.71</b>	<b>-39,073,750.47</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	145,945,720.00	-5,024,106.70	140,921,613.30
二、本期经营活动产生	-	89,781,615.71	89,781,615.71

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	198,230,348.81	94,582,524.66	292,812,873.47
其中：1.基金申购款	306,812,689.49	140,248,810.30	447,061,499.79
2.基金赎回款	-108,582,340.68	-45,666,285.64	-154,248,626.32
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）	344,176,068.81	179,340,033.67	523,516,102.48
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	165,857,969.75	39,178,729.28	205,036,699.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,073,750.47	-39,073,750.47
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）	-19,912,249.75	-5,129,085.51	-25,041,335.26
其中：1.基金申购款	19,152,445.42	2,957,774.41	22,110,219.83
2.基金赎回款	-39,064,695.17	-8,086,859.92	-47,151,555.09
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）	145,945,720.00	-5,024,106.70	140,921,613.30

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安升级主题混合型证券投资基金(原名为华安升级主题股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 [2011]317 号《关于核准华安升级主题股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,118,599,416.41 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,119,090,620.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 491,204.06 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》，华安升级主题股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安升级主题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《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业 and 传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 4 月 7 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》、《华安升级主题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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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(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(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

本基金本报告期末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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	97,792,432.32	20,008,036.95
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	97,792,432.32	20,008,036.95

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	415,758,348.49	435,458,810.06	19,700,461.57
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	397,800.00	397,800.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	397,800.00	397,800.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		416,156,148.49	435,856,610.06	19,700,461.57
项目	上年度末			
	2018 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		129,043,358.26	122,804,141.69	-6,239,216.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	132,700.00	129,209.99	-3,490.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	132,700.00	129,209.99	-3,490.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		129,176,058.26	122,933,351.68	-6,242,706.58

#### 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

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	26,171.16	3,236.05
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	323.80	455.20
应收债券利息	26.16	36.65
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	56.60	109.50
合计	26,577.72	3,837.40

#### 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,263,159.94	1,788,632.02
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,263,159.94	1,788,632.02

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	37,389.10	141.61
预提费用	178,000.00	338,000.00
合计	215,389.10	338,141.61

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,945,720.00	145,945,720.00
本期申购	306,812,689.49	306,812,689.49
本期赎回（以“-”号填列）	-108,582,340.68	-108,582,340.68
本期末	344,176,068.81	344,176,068.81

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	72,181,898.72	-77,206,005.42	-5,024,106.70
本期利润	63,838,447.56	25,943,168.15	89,781,615.71
本期基金份额交易产生的变动数	182,879,219.30	-88,296,694.64	94,582,524.66
其中：基金申购款	272,017,537.20	-131,768,726.90	140,248,810.30
基金赎回款	-89,138,317.90	43,472,032.26	-45,666,285.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	318,899,565.58	-139,559,531.91	179,340,033.67

#### 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月

	31 日	月 31 日
活期存款利息收入	283,549.07	199,708.94
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	13,298.13	34,135.32
其他	2,549.99	4,080.30
合计	299,397.19	237,924.56

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	68,424,195.37	-19,686,814.68
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	68,424,195.37	-19,686,814.68

##### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,101,839,273.78	2,390,106,410.17
减：卖出股票成本总额	1,033,415,078.41	2,409,793,224.85
买卖股票差价收入	68,424,195.37	-19,686,814.68

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-2,937.57	-



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	-2,937.57	-

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	129,819.15	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	132,700.00	-
减：应收利息总额	56.72	-
买卖债券差价收入	-2,937.57	-

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,348,629.35	1,616,661.37
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,348,629.35	1,616,661.37

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
1.交易性金融资产	25,943,168.15	-10,798,239.63
——股票投资	25,939,678.14	-10,794,749.62
——债券投资	3,490.01	-3,490.01

——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	25,943,168.15	-10,798,239.63

#### 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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	161,564.42	30,790.97
合计	161,564.42	30,790.97

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	3,581,858.46	7,186,388.11
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	3,581,858.46	7,186,388.11

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	58,000.00	58,000.00
信息披露费	120,000.00	280,000.00
银行汇划费	8,172.80	9,347.25
合计	186,172.80	347,347.25

**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**

无。

**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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	179,458,025.35	7.45%	-	-

注：关联方交易上年度比较期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
国泰君安	397,800.00	75.40%	-	-

注：关联方交易上年度比较期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	163,139.57	7.35%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-	-	25,268.91	1.41%
------	---	---	-----------	-------

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。

3. 关联方交易上年度比较期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

#### 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 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,106,640.94	2,520,319.73
其中：支付销售机构的客户维护费	1,333,110.56	985,475.93

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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	517,773.59	420,053.22

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国建设银行	97,792,432.32	283,549.07	20,008,036.95	199,708.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 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
上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
-	-	-	-	-	-

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（2019 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
688001	华兴源创	2019-07-01	2020-01-22	首次公开发售限售	24.26	41.57	17,912.00	434,545.12	744,601.84	-
688021	奥福环保	2019-10-29	2020-05-06	首次公开发售限售	26.17	33.32	2,940.00	1,887,766.98	97,960.80	-
688066	航天宏图	2019-07-16	2020-01-22	首次公开发售限售	17.25	37.17	15,134.00	261,061.50	562,530.78	-
688128	中国电研	2019-10-29	2020-05-06	首次公开发售限售	18.79	17.52	9,027.00	169,617.33	158,153.04	-
688166	博瑞医药	2019-10-29	2020-05-08	首次公开发售限售	12.71	25.64	8,041.00	102,201.11	206,171.24	-
688288	鸿泉物联	2019-10-29	2020-05-06	首次公开发售限售	24.99	28.45	3,429.00	85,690.71	97,555.05	-
00297	侨银	2019-1	2020-0	新股	5.74	5.74	1,146.	6,578.	6,578.	-

3	环保	2-27	1-06	未上市			00	04	04	
688081	兴图新科	2019-1 2-26	2020-0 1-06	新股未上市	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
688181	八亿时空	2019-1 2-27	2020-0 1-06	新股未上市	43.98	43.98	4,306.00	189,377.88	189,377.88	-
<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
123039	开润转债	2019-1 2-26	2020-0 1-23	新债未上市	100.00	100.00	3,978.00	397,800.00	397,800.00	-

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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，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。

#### 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，本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 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执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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人中国建设银行，因而与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 2019 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 0.08%（2018 年 12 月 31 日：0.09%）。

#### 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 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 2019 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 0.49%。

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 2019 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 532,810,026.48 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

2019 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	97,792,432.32	-	-	-	97,792,432.32
结算备付金	719,493.24	-	-	-	719,493.24
存出保证金	125,933.68	-	-	-	125,933.68
交易性金融资产	-	-	397,800.00	435,458,810.06	435,856,610.06
应收证券清算款	-	-	-	4,426,765.24	4,426,765.24
应收利息	-	-	-	26,577.72	26,577.72
应收申购款	-	-	-	418,897.11	418,897.11
资产总计	98,637,859.24	-	397,800.00	440,331,050.13	539,366,709.37
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	-	-	-	3,135,003.45	3,135,003.45
应付赎回款	-	-	-	10,611,982.55	10,611,982.55
应付管理人报酬	-	-	-	535,775.12	535,775.12
应付托管费	-	-	-	89,295.86	89,295.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,263,159.94	1,263,159.94
应交税费	-	-	-	0.87	0.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	215,389.10	215,389.10
负债总计	-	-	-	15,850,606.89	15,850,606.89
利率敏感度缺口	98,637,859.24	-	397,800.00	424,480,443.24	523,516,102.48
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	20,008,036.95	-	-	-	20,008,036.95
结算备付金	1,011,710.95	-	-	-	1,011,710.95
存出保证金	243,377.41	-	-	-	243,377.41
交易性金融资产	-	-	129,209.99	122,804,141.69	122,933,351.68
应收证券清算款	-	-	-	22,456.68	22,456.68
应收利息	-	-	-	3,837.40	3,837.40
应收申购款	-	-	-	13,983.69	13,983.69
资产总计	21,263,125.31	-	129,209.99	122,844,419.46	144,236,754.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	910,188.77	910,188.77
应付赎回款	-	-	-	65,198.79	65,198.79
应付管理人报酬	-	-	-	182,553.65	182,553.65
应付托管费	-	-	-	30,425.58	30,425.58
应付交易费用	-	-	-	1,788,632.02	1,788,632.02
应交税费	-	-	-	1.04	1.04
其他负债	-	-	-	338,141.61	338,141.61
负债总计	-	-	-	3,315,141.46	3,315,141.46
利率敏感度缺口	21,263,125.31	-	129,209.99	119,529,278.00	140,921,613.30

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 2019 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 0.08%(2018 年 12 月 31 日：0.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 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”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中，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、现金、货币市场工具和资产支持证券为 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	435,458,810.06	83.18	122,804,141.69	87.14
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	435,458,810.06	83.18	122,804,141.69	87.14

#### 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 28,610,000.00	增加约 8,530,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 28,610,000.00	减少约 8,530,000.00

#### 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 2019 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 433,306,935.26 元，属于第二层次的余额为 2,549,674.80 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 122,933,351.68 元，无第二或第三层次)。

##### (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 2019 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(2018 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	435,458,810.06	80.74
	其中：股票	435,458,810.06	80.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	397,800.00	0.07
	其中：债券	397,800.00	0.07
	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	98,511,925.56	18.26



8	其他各项资产	4,998,173.75	0.93
9	合计	539,366,709.37	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	5,672,100.00	1.08
C	制造业	197,997,441.31	37.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,936,000.00	0.56
E	建筑业	6,920,468.00	1.32
F	批发和零售业	10,155,587.00	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	31,184,201.00	5.96
H	住宿和餐饮业	1,259,271.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,606,744.78	6.61
J	金融业	71,281,658.00	13.62
K	房地产业	49,760,669.13	9.51
L	租赁和商务服务业	6,955,292.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	158,153.04	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	8,395,632.04	1.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	602,144.76	0.12
Q	卫生和社会工作	16,568.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	7,556,880.00	1.44
S	综合	-	-
	合计	435,458,810.06	83.18

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	002120	韵达股份	872,058	29,039,531.40	5.55
2	000002	万科A	820,000	26,387,600.00	5.04
3	600036	招商银行	679,600	25,539,368.00	4.88
4	600048	保利地产	1,095,200	17,720,336.00	3.38
5	601138	工业富联	877,500	16,031,925.00	3.06
6	601318	中国平安	181,300	15,493,898.00	2.96
7	000858	五粮液	115,394	15,348,555.94	2.93
8	000661	长春高新	33,473	14,962,431.00	2.86
9	300577	开润股份	420,320	14,795,264.00	2.83
10	600887	伊利股份	465,896	14,414,822.24	2.75
11	002013	中航机电	1,762,500	12,231,750.00	2.34
12	002555	三七互娱	441,800	11,897,674.00	2.27
13	300559	佳发教育	405,800	11,889,940.00	2.27
14	000568	泸州老窖	126,200	10,939,016.00	2.09
15	601328	交通银行	1,889,300	10,636,759.00	2.03
16	000651	格力电器	159,000	10,427,220.00	1.99
17	603899	晨光文具	202,900	9,889,346.00	1.89
18	002867	周大生	512,800	9,763,712.00	1.87
19	601818	光大银行	2,180,800	9,617,328.00	1.84
20	002174	游族网络	354,700	8,253,869.00	1.58
21	603079	圣达生物	202,300	8,055,586.00	1.54
22	601799	星宇股份	83,892	7,968,062.16	1.52
23	300133	华策影视	1,021,200	7,556,880.00	1.44
24	000333	美的集团	126,657	7,377,770.25	1.41
25	300070	碧水源	964,900	7,333,240.00	1.40
26	600690	海尔智家	358,100	6,982,950.00	1.33
27	002127	南极电商	636,700	6,946,397.00	1.33
28	601668	中国建筑	1,231,400	6,920,468.00	1.32
29	002415	海康威视	192,012	6,286,472.88	1.20
30	601088	中国神华	310,800	5,672,100.00	1.08
31	001914	招商积余	278,597	5,652,733.13	1.08
32	300596	利安隆	140,600	5,161,426.00	0.99
33	601398	工商银行	863,500	5,077,380.00	0.97
34	600372	中航电子	350,400	4,989,696.00	0.95
35	601988	中国银行	1,332,500	4,916,925.00	0.94
36	603517	绝味食品	105,293	4,890,859.85	0.93
37	002557	洽洽食品	127,900	4,344,763.00	0.83
38	000977	浪潮信息	102,700	3,091,270.00	0.59

39	600027	华电国际	800,000	2,936,000.00	0.56
40	603605	珀莱雅	31,800	2,799,990.00	0.53
41	600176	中国巨石	216,400	2,358,760.00	0.45
42	002938	鹏鼎控股	44,400	1,993,560.00	0.38
43	688021	奥福环保	53,479	1,933,031.89	0.37
44	002353	杰瑞股份	40,500	1,496,880.00	0.29
45	600258	首旅酒店	61,100	1,259,271.00	0.24
46	300750	宁德时代	10,400	1,106,560.00	0.21
47	603871	嘉友国际	35,920	1,102,025.60	0.21
48	002624	完美世界	24,900	1,099,086.00	0.21
49	002508	老板电器	31,900	1,078,539.00	0.21
50	603199	九华旅游	44,700	1,055,814.00	0.20
51	601111	中国国航	107,600	1,042,644.00	0.20
52	300415	伊之密	103,900	1,019,259.00	0.19
53	002831	裕同科技	36,800	977,040.00	0.19
54	603825	华扬联众	46,700	903,645.00	0.17
55	600276	恒瑞医药	8,900	778,928.00	0.15
56	688363	华熙生物	9,310	776,454.00	0.15
57	688001	华兴源创	17,912	744,601.84	0.14
58	002607	中公教育	33,677	602,144.76	0.12
59	688066	航天宏图	15,134	562,530.78	0.11
60	300196	长海股份	47,700	552,366.00	0.11
61	000547	航天发展	53,300	544,726.00	0.10
62	000739	普洛药业	31,800	412,446.00	0.08
63	603233	大参林	7,500	391,875.00	0.07
64	688166	博瑞医药	8,041	206,171.24	0.04
65	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.04
66	002129	中环股份	15,900	187,779.00	0.04
67	688128	中国电研	9,027	158,153.04	0.03
68	688198	佰仁医疗	3,213	135,427.95	0.03
69	688399	硕世生物	2,290	132,591.00	0.03
70	688288	鸿泉物联	3,429	97,555.05	0.02
71	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
72	300725	药石科技	1,000	68,330.00	0.01
73	300806	斯迪克	666	26,693.28	0.01
74	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
75	603160	汇顶科技	100	20,630.00	0.00
76	300760	迈瑞医疗	100	18,190.00	0.00
77	603109	N 神驰	684	18,105.48	0.00
78	002821	凯莱英	100	12,950.00	0.00
79	600763	通策医疗	100	10,253.00	0.00
80	601888	中国国旅	100	8,895.00	0.00
81	300529	健帆生物	100	7,184.00	0.00
82	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

83	300347	泰格医药	100	6,315.00	0.00
84	002475	立讯精密	100	3,650.00	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	600036	招商银行	40,841,335.19	28.98
2	600030	中信证券	34,010,995.22	24.13
3	002120	韵达股份	31,257,961.60	22.18
4	000858	五粮液	27,075,692.40	19.21
5	000002	万科A	26,065,681.00	18.50
6	000661	长春高新	23,417,677.00	16.62
7	600048	保利地产	22,044,932.58	15.64
8	601688	华泰证券	21,410,872.92	15.19
9	601318	中国平安	20,956,566.01	14.87
10	300383	光环新网	19,070,228.91	13.53
11	603218	日月股份	18,675,935.97	13.25
12	002475	立讯精密	16,770,562.90	11.90
13	600519	贵州茅台	16,352,961.63	11.60
14	000568	泸州老窖	16,273,427.35	11.55
15	600887	伊利股份	16,129,338.72	11.45
16	002415	海康威视	14,860,595.33	10.55
17	600340	华夏幸福	14,854,598.00	10.54
18	601328	交通银行	14,792,402.00	10.50
19	601138	工业富联	14,639,587.99	10.39
20	300559	佳发教育	13,760,486.05	9.76
21	002555	三七互娱	13,715,069.00	9.73
22	300577	开润股份	13,611,077.91	9.66
23	002013	中航机电	13,500,316.72	9.58
24	601799	星宇股份	12,548,865.00	8.90
25	002938	鹏鼎控股	12,540,528.81	8.90
26	300129	泰胜风能	12,350,293.90	8.76
27	601398	工商银行	12,289,158.55	8.72
28	000063	中兴通讯	11,906,569.00	8.45
29	002202	金风科技	11,882,037.95	8.43
30	601668	中国建筑	11,877,031.80	8.43
31	002142	宁波银行	11,529,545.28	8.18
32	300498	温氏股份	11,454,819.28	8.13

33	002821	凯莱英	11,267,138.00	8.00
34	000333	美的集团	11,203,964.59	7.95
35	000672	上峰水泥	10,560,444.00	7.49
36	603899	晨光文具	10,477,434.16	7.43
37	600011	华能国际	10,445,303.50	7.41
38	601888	中国国旅	10,396,020.00	7.38
39	603636	南威软件	10,288,867.97	7.30
40	000651	格力电器	10,262,676.83	7.28
41	601818	光大银行	9,856,586.00	6.99
42	000069	华侨城 A	9,771,312.58	6.93
43	300529	健帆生物	9,656,082.00	6.85
44	300014	亿纬锂能	9,631,881.28	6.83
45	002867	周大生	9,609,969.30	6.82
46	603605	珀莱雅	9,546,462.90	6.77
47	600276	恒瑞医药	9,251,367.63	6.56
48	600585	海螺水泥	9,057,800.01	6.43
49	002607	中公教育	8,941,058.20	6.34
50	300347	泰格医药	8,684,242.26	6.16
51	600801	华新水泥	8,492,106.36	6.03
52	002439	启明星辰	8,388,400.00	5.95
53	601229	上海银行	8,310,966.00	5.90
54	603079	圣达生物	8,193,381.00	5.81
55	600027	华电国际	8,170,786.00	5.80
56	600999	招商证券	8,131,163.00	5.77
57	300070	碧水源	8,130,025.00	5.77
58	002174	游族网络	8,048,508.29	5.71
59	002557	洽洽食品	7,708,812.27	5.47
60	002127	南极电商	7,508,786.00	5.33
61	002008	大族激光	7,501,467.38	5.32
62	002422	科伦药业	7,488,265.69	5.31
63	600372	中航电子	7,402,564.00	5.25
64	300133	华策影视	7,309,974.35	5.19
65	000001	平安银行	7,009,914.00	4.97
66	600763	通策医疗	6,955,004.00	4.94
67	000625	长安汽车	6,740,742.00	4.78
68	600690	海尔智家	6,740,393.78	4.78
69	603259	药明康德	6,598,260.00	4.68
70	002714	牧原股份	6,490,195.00	4.61
71	000739	普洛药业	6,344,174.00	4.50
72	600377	宁沪高速	6,342,011.30	4.50
73	000977	浪潮信息	6,105,322.00	4.33
74	601012	隆基股份	6,014,620.23	4.27
75	600845	宝信软件	5,929,641.00	4.21
76	600025	华能水电	5,881,585.89	4.17

77	601088	中国神华	5,846,108.00	4.15
78	002044	美年健康	5,729,267.95	4.07
79	603517	绝味食品	5,489,168.04	3.90
80	600104	上汽集团	5,394,425.00	3.83
81	601628	中国人寿	5,391,737.98	3.83
82	601009	南京银行	5,382,897.00	3.82
83	001914	招商积余	5,381,706.95	3.82
84	603666	亿嘉和	5,307,112.61	3.77
85	002531	天顺风能	5,302,212.49	3.76
86	600406	国电南瑞	5,154,546.00	3.66
87	603983	丸美股份	5,044,739.68	3.58
88	600837	海通证券	5,034,218.00	3.57
89	300596	利安隆	5,027,624.00	3.57
90	002398	垒知集团	5,008,215.00	3.55
91	601128	常熟银行	4,943,254.24	3.51
92	601988	中国银行	4,930,250.00	3.50
93	603369	今世缘	4,902,911.00	3.48
94	000963	华东医药	4,766,151.50	3.38
95	603214	爱婴室	4,758,406.00	3.38
96	002353	杰瑞股份	4,739,535.00	3.36
97	002698	博实股份	4,497,782.60	3.19
98	600438	通威股份	4,369,205.00	3.10
99	002709	天赐材料	4,312,471.56	3.06
100	600745	闻泰科技	4,114,665.93	2.92
101	000725	京东方 A	3,996,124.00	2.84
102	600195	中牧股份	3,944,778.10	2.80
103	601100	恒立液压	3,810,298.10	2.70
104	300525	博思软件	3,803,424.63	2.70
105	601231	环旭电子	3,794,285.00	2.69
106	600547	山东黄金	3,740,141.33	2.65
107	300760	迈瑞医疗	3,602,079.00	2.56
108	603305	旭升股份	3,539,405.00	2.51
109	000796	凯撒旅业	3,531,861.00	2.51
110	300750	宁德时代	3,518,702.00	2.50
111	002812	恩捷股份	3,480,935.50	2.47
112	000429	粤高速 A	3,409,927.36	2.42
113	300433	蓝思科技	3,387,976.01	2.40
114	601336	新华保险	3,383,630.00	2.40
115	002463	沪电股份	3,354,544.00	2.38
116	002080	中材科技	3,236,543.92	2.30
117	300450	先导智能	3,203,980.00	2.27
118	300365	恒华科技	3,047,150.00	2.16
119	300015	爱尔眼科	3,045,834.20	2.16
120	600489	中金黄金	3,041,898.65	2.16

121	000049	德赛电池	3,017,864.00	2.14
122	600741	华域汽车	2,922,623.00	2.07
123	300725	药石科技	2,872,258.16	2.04

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	600030	中信证券	34,976,933.37	24.82
2	300383	光环新网	27,080,182.84	19.22
3	002475	立讯精密	21,876,639.21	15.52
4	601688	华泰证券	21,870,696.53	15.52
5	600519	贵州茅台	18,679,795.00	13.26
6	603218	日月股份	18,404,839.05	13.06
7	000858	五 粮 液	17,445,977.00	12.38
8	002821	凯莱英	17,202,514.00	12.21
9	600036	招商银行	16,687,188.25	11.84
10	000063	中兴通讯	16,266,257.20	11.54
11	600340	华夏幸福	14,853,741.02	10.54
12	000977	浪潮信息	13,524,503.38	9.60
13	601888	中国国旅	12,958,411.73	9.20
14	002607	中公教育	12,937,649.44	9.18
15	000661	长春高新	12,763,295.20	9.06
16	002142	宁波银行	12,643,918.25	8.97
17	002202	金风科技	12,604,529.13	8.94
18	603259	药明康德	12,334,710.20	8.75
19	600845	宝信软件	12,156,064.15	8.63
20	300129	泰胜风能	12,119,295.39	8.60
21	600025	华能水电	11,990,062.00	8.51
22	000672	上峰水泥	11,989,254.37	8.51
23	002938	鹏鼎控股	11,218,895.80	7.96
24	300014	亿纬锂能	10,602,827.71	7.52
25	603666	亿嘉和	10,401,994.12	7.38
26	000069	华侨城 A	10,094,358.34	7.16
27	300347	泰格医药	10,079,137.88	7.15
28	600276	恒瑞医药	10,036,440.00	7.12
29	600011	华能国际	9,995,009.25	7.09
30	300529	健帆生物	9,987,910.00	7.09
31	300498	温氏股份	9,876,782.83	7.01

32	603636	南威软件	9,831,487.23	6.98
33	600585	海螺水泥	9,530,790.00	6.76
34	300760	迈瑞医疗	9,220,387.23	6.54
35	600406	国电南瑞	8,932,195.52	6.34
36	600801	华新水泥	8,915,759.04	6.33
37	002415	海康威视	8,831,525.93	6.27
38	603605	珀莱雅	8,552,923.69	6.07
39	002008	大族激光	8,411,002.19	5.97
40	601229	上海银行	8,305,163.42	5.89
41	002439	启明星辰	8,304,947.00	5.89
42	300365	恒华科技	8,259,952.46	5.86
43	600999	招商证券	8,079,127.96	5.73
44	300481	濮阳惠成	7,700,217.37	5.46
45	600763	通策医疗	7,276,631.74	5.16
46	002376	新北洋	7,233,462.94	5.13
47	601398	工商银行	7,112,662.00	5.05
48	002422	科伦药业	6,986,487.02	4.96
49	000001	平安银行	6,851,497.92	4.86
50	603369	今世缘	6,781,142.34	4.81
51	600312	平高电气	6,713,472.76	4.76
52	000625	长安汽车	6,686,438.28	4.74
53	000739	普洛药业	6,440,751.00	4.57
54	300036	超图软件	6,225,847.76	4.42
55	600377	宁沪高速	6,215,968.17	4.41
56	002044	美年健康	6,187,551.15	4.39
57	601012	隆基股份	6,082,543.52	4.32
58	300525	博思软件	5,955,123.17	4.23
59	601628	中国人寿	5,919,196.96	4.20
60	000333	美的集团	5,675,629.21	4.03
61	000963	华东医药	5,558,913.26	3.94
62	600104	上汽集团	5,523,910.41	3.92
63	002714	牧原股份	5,485,046.20	3.89
64	601019	山东出版	5,418,015.64	3.84
65	600027	华电国际	5,319,469.00	3.77
66	000568	泸州老窖	5,144,077.00	3.65
67	600837	海通证券	5,132,283.00	3.64
68	600745	闻泰科技	5,099,177.64	3.62
69	601009	南京银行	5,096,109.02	3.62
70	002531	天顺风能	5,071,949.70	3.60
71	601318	中国平安	4,969,447.00	3.53
72	600048	保利地产	4,893,771.00	3.47
73	300630	普利制药	4,890,017.30	3.47
74	601799	星宇股份	4,866,350.00	3.45
75	603160	汇顶科技	4,822,163.63	3.42



76	002698	博实股份	4,764,700.42	3.38
77	601668	中国建筑	4,720,722.00	3.35
78	603983	丸美股份	4,580,961.84	3.25
79	600195	中牧股份	4,499,090.80	3.19
80	002557	洽洽食品	4,492,096.34	3.19
81	601949	中国出版	4,449,869.00	3.16
82	002709	天赐材料	4,403,528.20	3.12
83	600438	通威股份	4,402,172.00	3.12
84	601128	常熟银行	4,352,922.60	3.09
85	002353	杰瑞股份	4,320,649.76	3.07
86	603214	爱婴室	4,319,598.94	3.07
87	601231	环旭电子	4,293,077.00	3.05
88	002120	韵达股份	4,225,878.58	3.00
89	601328	交通银行	4,174,536.00	2.96
90	300232	洲明科技	4,145,880.59	2.94
91	300618	寒锐钴业	4,122,215.35	2.93
92	000725	京东方 A	4,106,386.00	2.91
93	000796	凯撒旅业	4,074,487.82	2.89
94	300559	佳发教育	4,057,968.76	2.88
95	002398	垒知集团	4,053,746.70	2.88
96	300725	药石科技	3,900,350.45	2.77
97	601100	恒立液压	3,767,544.00	2.67
98	600547	山东黄金	3,722,155.75	2.64
99	000429	粤高速 A	3,673,450.70	2.61
100	002463	沪电股份	3,646,517.00	2.59
101	300015	爱尔眼科	3,600,887.30	2.56
102	002812	恩捷股份	3,523,065.60	2.50
103	603305	旭升股份	3,435,793.00	2.44
104	600820	隧道股份	3,417,206.52	2.42
105	600339	中油工程	3,354,726.75	2.38
106	002555	三七互娱	3,320,473.11	2.36
107	600741	华域汽车	3,296,556.00	2.34
108	000002	万 科 A	3,243,288.19	2.30
109	300003	乐普医疗	3,075,962.08	2.18
110	300450	先导智能	3,073,800.03	2.18
111	603018	中设集团	3,055,642.96	2.17
112	600489	中金黄金	3,039,390.97	2.16
113	002832	比音勒芬	2,998,495.04	2.13
114	603181	皇马科技	2,965,597.60	2.10
115	300168	万达信息	2,962,582.80	2.10
116	300433	蓝思科技	2,899,340.00	2.06
117	002080	中材科技	2,848,246.80	2.02
118	000049	德赛电池	2,835,074.00	2.01

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	1,320,130,068.64
卖出股票的收入（成交）总额	1,101,839,273.78

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）	397,800.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	397,800.00	0.08

### 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	123039	开润转债	3,978	397,800.00	0.08

**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	125,933.68

2	应收证券清算款	4,426,765.24
3	应收股利	-
4	应收利息	26,577.72
5	应收申购款	418,897.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,998,173.75

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

### 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
9,170	37,532.83	3,930,489.62	1.14%	340,245,579.19	98.86%

#### 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	103,262.91	0.03%

### 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(2011 年 4 月 22 日)基金份额总额	4,119,090,620.47
本报告期期初基金份额总额	145,945,720.00
本报告期基金总申购份额	306,812,689.49
减：本报告期基金总赎回份额	108,582,340.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	344,176,068.81

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：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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 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 58,000.00 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。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2019 年 1 月 31 日，上海局根据 2018 年 11 月份来公司的现场检查情况，对我司出具了《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（证监决[2019]11 号文）。公司高度重视，立即逐一落实各项整改要求，进一步提升公司内部控制和风险管理能力，2019 年 2 月 20 日，上海局对我司整改工作进行现场验收，对公司整改情况表示认可。

除上述情况外，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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	574,469,463.35	23.84%	534,960.04	24.11%	-
光大证券	2	441,414,222.33	18.32%	402,262.07	18.13%	-
新时代证券	2	251,919,619.57	10.45%	231,011.40	10.41%	-
方正证券	3	231,171,225.38	9.59%	210,667.56	9.49%	-
国泰君安证券	1	179,458,025.35	7.45%	163,139.57	7.35%	-

广发证券	1	91,010,604.48	3.78%	84,758.65	3.82%	-
国信证券	1	88,801,665.90	3.68%	82,701.37	3.73%	-
天风证券	2	87,634,662.18	3.64%	79,861.98	3.60%	-
兴业证券	1	65,976,899.30	2.74%	61,445.54	2.77%	-
中信建投	1	62,993,040.61	2.61%	58,666.39	2.64%	-
长江证券	2	59,076,831.77	2.45%	53,836.97	2.43%	-
海通证券	1	53,781,475.52	2.23%	50,087.52	2.26%	-
东北证券	1	52,681,523.91	2.19%	49,062.85	2.21%	-
瑞银证券	1	43,728,098.04	1.81%	39,849.24	1.80%	-
华安证券	1	42,861,448.72	1.78%	39,916.09	1.80%	-
中信证券	1	41,675,944.35	1.73%	38,811.60	1.75%	-
中泰证券	1	25,358,231.95	1.05%	23,109.12	1.04%	-
招商证券	3	10,145,011.69	0.42%	9,447.83	0.43%	-
申万宏源	3	5,743,853.00	0.24%	5,234.35	0.24%	-

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：

2019年2月完成租用托管在建行的深交所新时代证券007691交易单元

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	129,819.15	24.60%	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	397,800.00	75.40%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-



华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金参加基煜基金费率优惠活动的公告（转换费）	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2019-01-15
2	关于华安暂停与大泰金石开展基金销售合作业务的公告	《证券时报》和公司网站	2019-01-29
3	华安基金关于参加平安证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-15
4	华安基金关于参加国泰君安证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-27
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长春高新”股票估值调整的公告	《证券时报》和公司网站	2019-02-28
6	华安基金关于旗下基金参加国信证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-05
7	华安基金关于旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-20
8	华安基金关于旗下基金参加中国中投证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-27
9	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
10	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	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
11	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-03-29
12	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-01
13	华安基金关于旗下基金参加恒天明泽优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-02
14	华安基金关于旗下基金参加方正证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-02
15	华安基金关于旗下基金参加民族证券证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-02
16	华安基金关于旗下基金参加中金公司优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-08
17	关于华安基金撤销沈阳分公司的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-10

		站	
18	华安基金关于旗下基金参加植信基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-12
19	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“隆基股份”股票估值调整的公告(ETF 除外)	《证券时报》和公司网站	2019-04-17
20	华安基金关于参加天府银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-04-30
21	华安基金关于旗下基金参加民生银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-14
22	关于旗下部分基金增加江苏汇林为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-15
23	华安基金关于旗下基金参加海银基金优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-05-28
24	华安基金关于参加长城国瑞证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-17
25	基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-21
26	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	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
27	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-06-28
28	华安基金关于旗下基金参加万联证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-07-03
29	华安基金关于参加新时代证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-07
30	华安基金关于旗下基金参加华融证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-08
31	华安基金关于旗下基金参加工商银行优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-20
32	华安基金关于旗下基金参加中航证券优惠活动的公告	《证券时报》和公司网站	2019-08-21
33	关于旗下部分基金增加广发银行为销售机构的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-04
34	关于旗下基金增加华泰证券为销售机构、参加华泰证券优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-05
35	华安基金关于旗下基金参加国海证券优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-05
36	华安基金关于参加邮储银行优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-27
37	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方	《证券时报》、中国证监会	2019-09-30

	式费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站和公司网站	
38	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-09-30
39	华安基金关于旗下基金参加申万宏源证券和申万宏源西部证券优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-10-26
40	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-25
41	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	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30
42	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	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2019-12-30

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、《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安升级主题混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安升级主题混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安升级主题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

二〇二〇年四月十一日