

# 华安大国新经济股票型证券投资基金

## 2020 年中期报告

### 2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>7 投资组合报告</b>	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
<b>8 基金份额持有人信息</b>	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	47
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.7.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....	50
10.8	其他重大事件 .....	51
<b>11</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
11.1	备查文件目录 .....	52
11.2	存放地点 .....	52
11.3	查阅方式 .....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安大国新经济股票型证券投资基金
基金简称	华安大国新经济股票
基金主代码	000549
交易代码	000549
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 14 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	66,967,868.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与大国新经济相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采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。股票投资中，通过对大国新经济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	90%×中证 800 指数收益率+10%×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。

### 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	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼

	-32层	
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	23,317,530.36
本期利润	39,681,461.38
加权平均基金份额本期利润	0.5124
本期加权平均净值利润率	20.92%
本期基金份额净值增长率	24.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	61,900,348.24
期末可供分配基金份额利润	0.9243
期末基金资产净值	184,435,082.31
期末基金份额净值	2.754
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	175.40%

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
过去一个月	13.24%	1.25%	6.98%	0.78%	6.26%	0.47%
过去三个月	23.83%	1.52%	12.24%	0.83%	11.59%	0.69%
过去六个月	24.67%	2.14%	3.63%	1.40%	21.04%	0.74%
过去一年	61.71%	1.78%	10.26%	1.12%	51.45%	0.66%
过去三年	60.68%	1.64%	8.43%	1.14%	52.25%	0.50%
自基金合同生效起至今	175.40%	1.88%	66.74%	1.37%	108.66%	0.51%

#### 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

华安大国新经济股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014 年 4 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日）



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 138 只开放式基金，管理资产规模达到 4,157.70 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翁启森	本基金的基金经理，副总经理，首席投资官	2014-04-15	-	25 年	工业工程学硕士，25 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，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部总监。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 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。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。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。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 月起担任公司总经理助理。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员

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

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度随着 COVID-19 新冠肺炎疫情的扩散，全球经济受冲击超出预期，风险偏好快速回落，导致全球权益市场巨幅回撤，A 股市场也遭受巨大波动。随着国内外疫情的逐渐控制，中国带领下的全球复工复产是当下市场的主旋律，二季度全球股票市场领先疫情开启反弹修复行情。报告期内，本基金在契约范围内积极配置 5G 及相关产业、半导体、新能源、优质消费等方向的龙头公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.754 元，本报告期份额净值增长率为 24.67%，同期业绩比较基准增长率为 3.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

放眼未来，随着疫情的逐渐控制，全球经济活动也将陆续恢复，同时低利率环境有望较长时间持续，我们认为这个环境比较利好权益类风险资产。横向比较，我们仍然认为中国存在相对优势，一方面中国疫情结束早，复工快，宏观政策空间充足，另一方面 A 股权益资产在全球横向比较中更具吸引力。尽管美国对华的“科技战”可能会长期化，但全球科技周期在 5G 预期的引领下仍然处于上行周期，产业供应链格局正加速发生重构，其实是国内企业取得突破的机遇期。过去一段时间核心消费和科技板块涨幅较大，部分个股存在阶段性超涨现象，我们按照基本面预期和合理估值及时调整组合结构。随着疫情的缓解，经济企稳复苏，下一阶段我们将关注 PPI 反弹的力道，优质价值龙头个股或许存在受益机会。我们将紧密跟踪未来新冠疫苗的进展、经济走势和货币政策调整。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

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

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安大国新经济股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	14,174,864.38	11,601,533.33
结算备付金		53,521.25	43,625.89
存出保证金		27,463.91	21,606.57
交易性金融资产	6.4.7.2	174,312,091.36	180,698,398.23
其中：股票投资		174,107,416.49	180,364,031.49
基金投资		-	-

债券投资		204,674.87	334,366.74
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,407,342.28	128,306.82
应收利息	6.4.7.5	2,019.45	2,376.31
应收股利		-	-
应收申购款		408,414.46	277,003.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>190,385,717.09</b>	<b>192,772,851.08</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	135,412.52
应付赎回款		5,451,419.30	677,321.76
应付管理人报酬		226,947.52	236,987.72
应付托管费		37,824.57	39,497.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	140,430.36	119,246.14
应交税费		0.44	1.78
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,012.59	170,155.14
<b>负债合计</b>		<b>5,950,634.78</b>	<b>1,378,623.00</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	66,967,868.46	86,648,504.53
未分配利润	6.4.7.10	117,467,213.85	104,745,723.55
<b>所有者权益合计</b>		<b>184,435,082.31</b>	<b>191,394,228.08</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>190,385,717.09</b>	<b>192,772,851.08</b>

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.754 元，基金份额总额 66,967,868.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安大国新经济股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>41,685,511.73</b>	<b>45,951,925.20</b>
1.利息收入		43,246.54	40,960.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,123.73	40,469.14
债券利息收入		122.81	491.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,029,419.05	-3,705,568.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,999,446.72	-5,118,835.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	138,296.40	56,111.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	891,675.93	1,357,155.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,363,931.02	49,561,218.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	248,915.12	55,314.43
<b>减：二、费用</b>		<b>2,004,050.35</b>	<b>1,728,170.81</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,418,276.55	1,238,085.50
2. 托管费	6.4.10.2	236,379.44	206,347.63
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	263,551.50	195,138.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		0.31	1.49
7. 其他费用	6.4.7.21	85,842.55	88,597.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>39,681,461.38</b>	<b>44,223,754.39</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>39,681,461.38</b>	<b>44,223,754.39</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安大国新经济股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	86,648,504.53	104,745,723.55	191,394,228.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,681,461.38	39,681,461.38
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）	-19,680,636.07	-26,959,971.08	-46,640,607.15
其中：1.基金申购款	32,010,868.76	49,980,609.14	81,991,477.90
2.基金赎回款	-51,691,504.83	-76,940,580.22	-128,632,085.05
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）	66,967,868.46	117,467,213.85	184,435,082.31
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	106,689,096.78	31,093,248.21	137,782,344.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,223,754.39	44,223,754.39
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）	-8,560,128.73	-6,377,013.93	-14,937,142.66
其中：1.基金申购款	8,117,899.50	5,565,393.58	13,683,293.08
2.基金赎回款	-16,678,028.23	-11,942,407.51	-28,620,435.74
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）	98,128,968.05	68,939,988.67	167,068,956.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安大国新经济股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】183号《关于核准华安大国新经济股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自2014年3月13日起至2014年4月10日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明（2014）验字第60971571\_B06号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年4月14日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币433,354,935.04元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币152,564.35元，以上实收基金（本息）合计为人民币433,507,499.39元，折合433,507,499.39份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构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。

本基金为股票型基金，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的A股股票等权益类证券（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等）、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的股票资产投资比例为基金资产的80%-95%，其中，投资于新经济相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 10\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信

息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的

规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### (3)城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### (4)企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### (5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	14,174,864.38
定期存款	-

其他存款	-
合计	14,174,864.38

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	136,901,435.48	174,107,416.49	37,205,981.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	194,300.00	204,674.87
	银行间市场	-	-
	合计	194,300.00	204,674.87
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	137,095,735.48	174,312,091.36	37,216,355.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,935.75
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	21.69
应收债券利息	50.85
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	-
应收出借证券利息	-

其他	11.16
合计	2,019.45

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	140,430.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	140,430.36

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,477.23
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	24,863.02
合计	94,012.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	86,648,504.53	86,648,504.53
本期申购	32,010,868.76	32,010,868.76
本期赎回（以“-”号填列）	-51,691,504.83	-51,691,504.83
本期末	66,967,868.46	66,967,868.46

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	53,972,177.78	50,773,545.77	104,745,723.55
本期利润	23,317,530.36	16,363,931.02	39,681,461.38
本期基金份额交易产生的变动数	-15,389,359.90	-11,570,611.18	-26,959,971.08
其中：基金申购款	24,883,906.51	25,096,702.63	49,980,609.14
基金赎回款	-40,273,266.41	-36,667,313.81	-76,940,580.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,900,348.24	55,566,865.61	117,467,213.85

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	42,227.58
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	697.91
其他	198.24
合计	43,123.73

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	101,369,140.35
减：卖出股票成本总额	77,369,693.63
买卖股票差价收入	23,999,446.72

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	478,927.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	340,400.00
减：应收利息总额	231.09
买卖债券差价收入	138,296.40

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	891,675.93
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	891,675.93

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	16,363,931.02
——股票投资	16,419,822.89
——债券投资	-55,891.87

——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	16,363,931.02

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	200,100.37
转换费收入	48,814.75
合计	248,915.12

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

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	263,551.50
银行间市场交易费用	-
合计	263,551.50

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行汇划费	1,307.19
合计	85,842.55

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、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	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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	12,084,059.09	7.90%	26,301,768.57	21.49%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	228,600.00	30.66%	220,516.65	20.63%

### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	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	11,012.34	7.84%	11,012.34	7.84%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	23,968.48	21.27%	23,968.48	21.27%

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,418,276.55	1,238,085.50
其中：支付销售机构的客户维护费	525,409.88	481,736.14

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 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6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	236,379.44	206,347.63

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
期初持有的基金份额	4,509,646.08	4,509,646.08
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	4,509,646.08	4,509,646.08
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.73%	4.60%

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	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	14,174,864.38	42,227.58	12,273,160.27	39,514.42
--------	---------------	-----------	---------------	-----------

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	网下中签	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	网下中签	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	网下中签	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	网下中签	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	网下中签	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
688169	石头科技	2020-02-13	2020-08-21	处于锁定期	271.12	365.14	986.00	267,324.32	360,028.04	-
688186	广大特材	2020-01-23	2020-08-11	处于锁定期	17.16	34.15	5,164.00	88,614.24	176,350.60	-

688396	华润微	2020-02-14	2020-08-27	处于锁定期	12.80	41.45	11,262.00	144,153.60	466,809.90	-
688398	赛特新材	2020-02-03	2020-08-11	处于锁定期	24.12	54.47	3,246.00	78,293.52	176,809.62	-
<b>6.4.12.1.2 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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转 2	2020-06-12	2020-07-13	认购新发证券	100.00	100.00	1,148.00	114,800.00	114,800.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	认购新发证券	100.00	100.00	315.00	31,500.00	31,500.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金重点投资于与大国新经济相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基

金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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%。

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而

发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,174,864.38	-	-	-	14,174,864.38
结算备付金	53,521.25	-	-	-	53,521.25
存出保证金	27,463.91	-	-	-	27,463.91
交易性金融资产	204,674.87	-	-	174,107,416.49	174,312,091.36
应收证券清算款	-	-	-	1,407,342.28	1,407,342.28
应收利息	-	-	-	2,019.45	2,019.45
应收申购款	-	-	-	408,414.46	408,414.46
资产总计	14,460,524.41	-	-	175,925,192.68	190,385,717.09
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	-	-	-	5,451,419.30	5,451,419.30
应付管理人报酬	-	-	-	226,947.52	226,947.52
应付托管费	-	-	-	37,824.57	37,824.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	140,430.36	140,430.36
应交税费	-	-	-	0.44	0.44
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	94,012.59	94,012.59
负债总计	-	-	-	5,950,634.78	5,950,634.78
利率敏感度缺口	14,460,524.41	-	-	169,974,557.90	184,435,082.31
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,601,533.33	-	-	-	11,601,533.33
结算备付金	43,625.89	-	-	-	43,625.89
存出保证金	21,606.57	-	-	-	21,606.57
交易性金融资产	334,366.74	-	-	180,364,031.49	180,698,398.23
应收证券清算款	-	-	-	128,306.82	128,306.82
应收利息	-	-	-	2,376.31	2,376.31
应收申购款	-	-	-	277,003.93	277,003.93
资产总计	12,001,132.53	-	-	180,771,718.55	192,772,851.08
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	-	-	-	135,412.52	135,412.52
应付赎回款	-	-	-	677,321.76	677,321.76
应付管理人报酬	-	-	-	236,987.72	236,987.72
应付托管费	-	-	-	39,497.94	39,497.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	119,246.14	119,246.14
应交税费	-	-	-	1.78	1.78
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	170,155.14	170,155.14
负债总计	-	-	-	1,378,623.00	1,378,623.00
利率敏感度缺口	12,001,132.53	-	-	179,393,095.55	191,394,228.08

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.11% (2019 年 12 月 31 日：0.17%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 6 月 30 日		2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	174,107,416.49	94.40	180,364,031.49	94.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	174,107,416.49	94.40	180,364,031.49	94.24

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 1,268	增加约 1,189
	业绩比较基准减少 5%	减少约 1,268	减少约 1,189

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	174,107,416.49	91.45
	其中: 股票	174,107,416.49	91.45

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	204,674.87	0.11
	其中：债券	204,674.87	0.11
	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	14,228,385.63	7.47
8	其他各项资产	1,845,240.10	0.97
9	合计	190,385,717.09	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,522,585.00	1.91
B	采矿业	688,612.00	0.37
C	制造业	128,744,604.12	69.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	245,071.68	0.13
E	建筑业	359,926.58	0.20
F	批发和零售业	1,203,353.50	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,297,598.55	0.70
H	住宿和餐饮业	371,239.50	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,456,709.68	14.34
J	金融业	2,289,166.40	1.24
K	房地产业	187,224.00	0.10
L	租赁和商务服务业	2,064,648.97	1.12
M	科学研究和技术服务业	676,368.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	651,460.00	0.35

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,150.31	0.06
R	文化、体育和娱乐业	3,701,909.20	2.01
S	综合	1,531,789.00	0.83
	合计	174,107,416.49	94.40

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000977	浪潮信息	343,616	13,462,874.88	7.30
2	300113	顺网科技	288,493	7,327,722.20	3.97
3	300316	晶盛机电	221,880	5,489,311.20	2.98
4	002709	天赐材料	141,660	4,786,691.40	2.60
5	000063	中兴通讯	112,069	4,497,328.97	2.44
6	002129	中环股份	148,800	3,342,048.00	1.81
7	601231	环旭电子	149,382	3,262,502.88	1.77
8	603444	吉比特	5,400	2,964,654.00	1.61
9	002174	游族网络	112,200	2,926,176.00	1.59
10	300433	蓝思科技	104,300	2,924,572.00	1.59
11	002299	圣农发展	89,200	2,586,800.00	1.40
12	688019	安集科技	6,459	2,484,583.53	1.35
13	002555	三七互娱	53,000	2,480,400.00	1.34
14	002138	顺络电子	99,300	2,477,535.00	1.34
15	002475	立讯精密	48,058	2,467,778.30	1.34
16	600703	三安光电	95,400	2,385,000.00	1.29
17	300054	鼎龙股份	137,300	2,279,180.00	1.24
18	002938	鹏鼎控股	40,700	2,037,442.00	1.10
19	300502	新易盛	29,880	1,886,025.60	1.02
20	000636	风华高科	63,900	1,865,241.00	1.01
21	603605	珀莱雅	10,000	1,800,200.00	0.98
22	002273	水晶光电	104,909	1,798,140.26	0.97
23	300567	精测电子	25,600	1,747,200.00	0.95
24	601138	工业富联	113,800	1,724,070.00	0.93
25	300133	华策影视	231,200	1,676,200.00	0.91

26	603718	海利生物	90,900	1,659,834.00	0.90
27	600276	恒瑞医药	17,438	1,609,527.40	0.87
28	000066	中国长城	119,858	1,582,125.60	0.86
29	300613	富瀚微	13,680	1,549,944.00	0.84
30	002511	中顺洁柔	67,000	1,494,100.00	0.81
31	000877	天山股份	98,800	1,491,880.00	0.81
32	600882	妙可蓝多	39,800	1,444,342.00	0.78
33	002185	华天科技	103,332	1,398,081.96	0.76
34	603068	博通集成	17,300	1,394,034.00	0.76
35	002212	南洋股份	51,800	1,376,844.00	0.75
36	002531	天顺风能	227,029	1,357,633.42	0.74
37	002353	杰瑞股份	42,900	1,329,900.00	0.72
38	300450	先导智能	27,679	1,279,046.59	0.69
39	002080	中材科技	78,928	1,223,384.00	0.66
40	300607	拓斯达	28,260	1,149,899.40	0.62
41	002195	二三四五	389,208	1,093,674.48	0.59
42	603496	恒为科技	47,754	1,062,526.50	0.58
43	600584	长电科技	33,300	1,041,291.00	0.56
44	300595	欧普康视	15,000	1,040,100.00	0.56
45	600196	复星医药	30,200	1,022,270.00	0.55
46	002241	歌尔股份	34,600	1,015,856.00	0.55
47	000997	新大陆	63,200	1,009,936.00	0.55
48	300207	欣旺达	51,185	967,396.50	0.52
49	600030	中信证券	39,800	959,578.00	0.52
50	002120	韵达股份	39,000	953,550.00	0.52
51	002127	南极电商	44,979	952,205.43	0.52
52	600673	东阳光	136,000	939,760.00	0.51
53	002739	万达电影	61,200	934,524.00	0.51
54	600760	中航沈飞	28,200	925,524.00	0.50
55	600585	海螺水泥	17,300	915,343.00	0.50
56	688008	澜起科技	8,822	897,020.96	0.49
57	002230	科大讯飞	23,850	892,705.50	0.48
58	002415	海康威视	29,400	892,290.00	0.48
59	000661	长春高新	2,000	870,600.00	0.47
60	002157	正邦科技	49,300	861,764.00	0.47
61	603338	浙江鼎力	11,368	861,353.36	0.47
62	601966	玲珑轮胎	42,600	860,520.00	0.47
63	300760	迈瑞医疗	2,800	855,960.00	0.46
64	002075	沙钢股份	67,500	843,750.00	0.46
65	600372	中航电子	63,000	839,160.00	0.45
66	002655	共达电声	65,900	834,294.00	0.45
67	603825	华扬联众	25,000	803,750.00	0.44
68	600845	宝信软件	13,290	785,173.20	0.43
69	000538	云南白药	8,200	769,242.00	0.42

70	002202	金风科技	70,952	707,391.44	0.38
71	300017	网宿科技	82,700	702,123.00	0.38
72	000876	新希望	23,400	697,320.00	0.38
73	300570	太辰光	34,700	694,000.00	0.38
74	002179	中航光电	16,842	690,690.42	0.37
75	603859	能科股份	19,800	676,368.00	0.37
76	002262	恩华药业	39,280	662,260.80	0.36
77	300413	芒果超媒	10,100	658,520.00	0.36
78	600259	广晟有色	20,800	624,000.00	0.34
79	002567	唐人神	60,800	578,816.00	0.31
80	002223	鱼跃医疗	15,500	564,200.00	0.31
81	300383	光环新网	21,600	563,112.00	0.31
82	000568	泸州老窖	6,100	555,832.00	0.30
83	600038	中直股份	13,369	549,064.83	0.30
84	600887	伊利股份	17,600	547,888.00	0.30
85	000009	中国宝安	64,200	546,342.00	0.30
86	300406	九强生物	23,441	539,143.00	0.29
87	603283	赛腾股份	9,900	532,620.00	0.29
88	002236	大华股份	27,550	529,235.50	0.29
89	002624	完美世界	9,000	518,760.00	0.28
90	300223	北京君正	5,074	512,169.56	0.28
91	002876	三利谱	9,670	511,543.00	0.28
92	600380	健康元	31,400	509,936.00	0.28
93	002878	元隆雅图	23,290	509,585.20	0.28
94	000725	京东方 A	108,600	507,162.00	0.27
95	300785	值得买	3,977	499,948.67	0.27
96	000967	盈峰环境	60,000	495,000.00	0.27
97	600285	羚锐制药	52,225	488,303.75	0.26
98	002714	牧原股份	5,950	487,900.00	0.26
99	002815	崇达技术	23,600	477,428.00	0.26
100	002410	广联达	6,700	466,990.00	0.25
101	688396	华润微	11,262	466,809.90	0.25
102	000998	隆平高科	26,900	447,885.00	0.24
103	600217	中再资环	91,600	441,512.00	0.24
104	600486	扬农化工	5,331	439,807.50	0.24
105	300709	精研科技	4,550	437,482.50	0.24
106	300750	宁德时代	2,400	418,464.00	0.23
107	002463	沪电股份	16,500	412,170.00	0.22
108	300346	南大光电	9,447	407,354.64	0.22
109	600183	生益科技	13,836	404,979.72	0.22
110	300463	迈克生物	6,893	401,379.39	0.22
111	000970	中科三环	39,318	384,530.04	0.21
112	600036	招商银行	11,100	374,292.00	0.20
113	600031	三一重工	19,844	372,273.44	0.20

114	688111	金山办公	1,089	371,980.62	0.20
115	600754	锦江酒店	13,378	371,239.50	0.20
116	002050	三花智控	16,731	366,408.90	0.20
117	688169	石头科技	986	360,028.04	0.20
118	603929	亚翔集成	20,462	359,926.58	0.20
119	300770	新媒股份	1,558	348,462.28	0.19
120	002318	久立特材	46,999	343,092.70	0.19
121	002311	海大集团	7,200	342,648.00	0.19
122	688166	博瑞医药	5,530	342,251.70	0.19
123	600802	福建水泥	30,400	330,144.00	0.18
124	002035	华帝股份	32,030	324,463.90	0.18
125	002371	北方华创	1,827	312,252.57	0.17
126	600837	海通证券	24,728	311,078.24	0.17
127	600093	易见股份	26,465	310,169.80	0.17
128	002955	鸿合科技	10,030	304,912.00	0.17
129	000915	山大华特	9,276	303,789.00	0.16
130	002478	常宝股份	62,800	303,324.00	0.16
131	002812	恩捷股份	4,400	289,520.00	0.16
132	300059	东方财富	14,280	288,456.00	0.16
133	600436	片仔癀	1,693	288,233.25	0.16
134	000513	丽珠集团	6,000	288,060.00	0.16
135	002036	联创电子	22,911	286,387.50	0.16
136	000034	神州数码	11,444	278,546.96	0.15
137	600420	现代制药	27,868	268,368.84	0.15
138	603345	安井食品	2,263	267,034.00	0.14
139	300367	东方网力	74,570	259,503.60	0.14
140	600563	法拉电子	4,178	258,200.40	0.14
141	603186	华正新材	5,060	251,836.20	0.14
142	300168	万达信息	11,000	242,770.00	0.13
143	603799	华友钴业	5,750	223,445.00	0.12
144	603195	公牛集团	1,359	218,323.35	0.12
145	002831	裕同科技	7,858	216,173.58	0.12
146	000988	华工科技	8,600	210,098.00	0.11
147	300603	立昂技术	7,000	205,310.00	0.11
148	600009	上海机场	2,800	201,796.00	0.11
149	600745	闻泰科技	1,600	201,520.00	0.11
150	600332	白云山	6,200	200,446.00	0.11
151	000403	双林生物	2,700	200,151.00	0.11
152	601233	桐昆股份	14,980	191,144.80	0.10
153	688039	当虹科技	2,008	187,527.12	0.10
154	601318	中国平安	2,600	185,640.00	0.10
155	600977	中国电影	14,100	185,133.00	0.10
156	300365	恒华科技	17,600	179,520.00	0.10
157	603839	安正时尚	14,000	177,800.00	0.10

158	300782	卓胜微	437	177,321.49	0.10
159	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.10
160	688186	广大特材	5,164	176,350.60	0.10
161	300196	长海股份	16,500	174,570.00	0.09
162	300438	鹏辉能源	9,900	172,755.00	0.09
163	600114	东睦股份	16,548	171,768.24	0.09
164	002026	山东威达	34,000	170,000.00	0.09
165	603508	思维列控	4,900	164,836.00	0.09
166	300308	中际旭创	2,595	163,485.00	0.09
167	600803	新奥股份	15,575	161,045.50	0.09
168	600198	大唐电信	9,536	152,957.44	0.08
169	300832	新产业	882	151,871.58	0.08
170	300140	中环装备	16,863	151,429.74	0.08
171	000963	华东医药	5,940	150,282.00	0.08
172	603626	科森科技	12,314	149,615.10	0.08
173	600066	宇通客车	12,100	147,620.00	0.08
174	600029	南方航空	27,515	142,252.55	0.08
175	600426	华鲁恒升	7,700	136,136.00	0.07
176	300033	同花顺	1,000	133,080.00	0.07
177	603392	万泰生物	785	129,525.00	0.07
178	000910	大亚圣象	8,100	125,874.00	0.07
179	002850	科达利	1,800	124,560.00	0.07
180	000049	德赛电池	2,500	122,525.00	0.07
181	600136	当代文体	14,928	121,812.48	0.07
182	600138	中青旅	12,136	119,782.32	0.06
183	603026	石大胜华	4,400	117,436.00	0.06
184	002570	贝因美	18,076	116,409.44	0.06
185	603214	爱婴室	3,780	115,932.60	0.06
186	002044	美年健康	7,991	115,150.31	0.06
187	002727	一心堂	3,100	115,041.00	0.06
188	600895	张江高科	5,600	114,072.00	0.06
189	603708	家家悦	2,305	113,544.30	0.06
190	002640	跨境通	17,220	111,757.80	0.06
191	300100	双林股份	20,510	111,574.40	0.06
192	603968	醋化股份	7,686	111,062.70	0.06
193	603989	艾华集团	3,750	108,825.00	0.06
194	000756	新华制药	10,300	106,296.00	0.06
195	300236	上海新阳	1,718	103,183.08	0.06
196	600153	建发股份	12,400	100,440.00	0.05
197	002065	东华软件	7,902	98,933.04	0.05
198	003816	中国广核	33,358	98,739.68	0.05
199	002686	亿利达	19,100	97,410.00	0.05
200	600690	海尔智家	5,502	97,385.40	0.05
201	002559	亚威股份	15,800	93,852.00	0.05

202	600050	中国联通	19,000	91,960.00	0.05
203	002024	苏宁易购	10,400	91,208.00	0.05
204	002400	省广集团	8,600	90,214.00	0.05
205	600826	兰生股份	8,604	89,997.84	0.05
206	601555	东吴证券	10,741	87,646.56	0.05
207	002699	美盛文化	14,396	87,383.72	0.05
208	300400	劲拓股份	6,100	86,864.00	0.05
209	002479	富春环保	14,700	86,142.00	0.05
210	002466	天齐锂业	3,640	83,538.00	0.05
211	002027	分众传媒	14,846	82,692.22	0.04
212	601688	华泰证券	4,387	82,475.60	0.04
213	300068	南都电源	7,600	81,016.00	0.04
214	300137	先河环保	12,020	80,173.40	0.04
215	300388	国祯环保	8,600	79,292.00	0.04
216	300129	泰胜风能	21,399	78,534.33	0.04
217	002110	三钢闽光	11,650	77,589.00	0.04
218	000826	启迪环境	10,400	77,168.00	0.04
219	600409	三友化工	16,400	76,424.00	0.04
220	002349	精华制药	13,990	73,727.30	0.04
221	600328	中盐化工	10,355	73,624.05	0.04
222	600340	华夏幸福	3,200	73,152.00	0.04
223	600273	嘉化能源	7,740	67,647.60	0.04
224	601699	潞安环能	11,600	64,612.00	0.04
225	300385	雪浪环境	9,952	63,394.24	0.03
226	600141	兴发集团	7,000	62,650.00	0.03
227	300335	迪森股份	13,000	60,190.00	0.03
228	600603	广汇物流	9,700	45,687.00	0.02
229	002156	通富微电	1,724	43,186.20	0.02
230	603087	甘李药业	430	43,129.00	0.02
231	300260	新莱应材	2,000	40,900.00	0.02
232	600686	金龙汽车	6,800	38,352.00	0.02
233	603721	中广天择	1,600	38,336.00	0.02
234	600511	国药股份	900	36,603.00	0.02
235	605001	威奥股份	1,353	27,709.44	0.02
236	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
237	300833	浩洋股份	406	26,430.60	0.01
238	002409	雅克科技	500	26,085.00	0.01
239	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
240	300577	开润股份	900	24,273.00	0.01
241	002172	澳洋健康	8,195	20,323.60	0.01
242	603095	越剑智能	630	19,000.80	0.01
243	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
244	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
245	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01

246	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
247	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
248	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
249	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
250	002422	科伦药业	100	2,100.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300113	顺网科技	7,334,956.49	3.83
2	300059	东方财富	3,191,598.00	1.67
3	002709	天赐材料	2,918,351.11	1.52
4	603718	海利生物	2,476,829.04	1.29
5	600673	东阳光	2,412,961.00	1.26
6	002299	圣农发展	2,276,119.00	1.19
7	002739	万达电影	2,119,170.34	1.11
8	300607	拓斯达	2,046,270.40	1.07
9	688019	安集科技	1,938,244.23	1.01
10	300433	蓝思科技	1,749,053.00	0.91
11	002212	南洋股份	1,462,344.00	0.76
12	300567	精测电子	1,440,608.00	0.75
13	002531	天顺风能	1,328,772.60	0.69
14	300383	光环新网	1,255,189.00	0.66
15	002955	鸿合科技	1,129,572.00	0.59
16	688008	澜起科技	954,881.99	0.50
17	300570	太辰光	897,169.00	0.47
18	002075	沙钢股份	891,187.00	0.47
19	600882	妙可蓝多	875,403.00	0.46
20	300133	华策影视	839,142.00	0.44

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603068	博通集成	7,250,407.04	3.79
2	600745	闻泰科技	5,641,758.00	2.95

3	002531	天顺风能	4,418,772.78	2.31
4	300316	晶盛机电	3,672,068.00	1.92
5	300498	温氏股份	3,196,609.00	1.67
6	603799	华友钴业	3,163,507.10	1.65
7	300502	新易盛	3,129,216.60	1.63
8	002065	东华软件	3,113,016.20	1.63
9	002156	通富微电	3,060,333.00	1.60
10	300059	东方财富	3,011,125.00	1.57
11	300223	北京君正	2,698,394.75	1.41
12	601138	工业富联	2,174,242.00	1.14
13	603708	家家悦	2,072,435.62	1.08
14	300383	光环新网	1,920,310.00	1.00
15	002236	大华股份	1,711,144.12	0.89
16	003816	中国广核	1,617,868.00	0.85
17	000063	中兴通讯	1,611,759.00	0.84
18	688019	安集科技	1,598,895.09	0.84
19	000066	中国长城	1,521,473.00	0.79
20	002555	三七互娱	1,495,086.90	0.78

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	54,693,255.74
卖出股票的收入（成交）总额	101,369,140.35

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	204,674.87	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	204,674.87	0.11

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128112	歌尔转 2	1,148	114,800.00	0.06
2	128114	正邦转债	315	31,500.00	0.02
3	128101	联创转债	237	27,380.61	0.01
4	128104	裕同转债	126	16,097.76	0.01
5	128095	恩捷转债	87	10,709.70	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,463.91
2	应收证券清算款	1,407,342.28
3	应收股利	-
4	应收利息	2,019.45
5	应收申购款	408,414.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,845,240.10

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
5,567	12,029.44	5,234,393.36	7.82%	61,733,475.10	92.18%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	159,340.28	0.24%

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

本公司高级管理人员、基金投资和研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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 4 月 14 日）基金份额总额	433,507,499.39
本报告期期初基金份额总额	86,648,504.53
本报告期基金总申购份额	32,010,868.76
减：本报告期基金总赎回份额	51,691,504.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,967,868.46

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	26,838,266.24	17.55%	24,458.93	17.42%	-
方正证券	3	23,482,615.21	15.36%	21,399.89	15.24%	-
光大证券	2	18,614,329.01	12.17%	16,963.54	12.08%	-
天风证券	2	18,534,690.50	12.12%	16,891.28	12.03%	-
国盛证券	1	12,264,499.12	8.02%	11,422.03	8.13%	-
国泰君安证券	1	12,084,059.09	7.90%	11,012.34	7.84%	-
海通证券	1	9,338,439.91	6.11%	8,697.34	6.19%	-
兴业证券	1	8,777,947.68	5.74%	8,175.02	5.82%	-
中信建投	1	7,987,905.84	5.22%	7,439.56	5.30%	-
广发证券	1	5,983,071.41	3.91%	5,572.04	3.97%	-
银河证券	1	4,094,997.56	2.68%	3,813.63	2.72%	-
长江证券	2	2,616,955.94	1.71%	2,437.14	1.74%	-
新时代证券	2	2,306,195.24	1.51%	2,147.62	1.53%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	21,216.51	2.85%	-	-	-	-
方正证券	279,502.00	37.49%	-	-	-	-
光大证券	138,935.48	18.64%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	228,600.00	30.66%	-	-	-	-
海通证券	35,000.00	4.69%	-	-	-	-
兴业证券	42,273.50	5.67%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告.doc	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
3	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
4	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
5	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
6	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和	2020-03-30

		公司网站	
7	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.doc	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
8	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.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
9	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.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
10	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.docx	《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《证券时报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安大国新经济股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安大国新经济股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安大国新经济股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安大国新经济股票型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日