

# 华安升级主题混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：二〇二二年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2022 年 8 月 26 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 2022 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>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
<b>8 基金份额持有人信息</b>	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	53
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## 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	214,736,116.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C
下属分级基金的交易代码	040020	014976
报告期末下属分级基金的份额总额	214,668,942.15 份	67,174.18 份

### 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	杨牧云	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 —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（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C
本期已实现收益	-43,896,104.90	-1,315.64
本期利润	-13,121,757.72	17,699.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0590	0.4455
本期加权平均净值利润率	-2.67%	20.40%
本期基金份额净值增长率	-1.90%	17.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C
期末可供分配利润	305,401,468.71	95,411.13
期末可供分配基金份额利润	1.4227	1.4204
期末基金资产净值	520,070,410.86	162,585.31
期末基金份额净值	2.423	2.420

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C
基金份额累计净值增长率	251.54%	17.36%

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）。

4、华安升级主题混合型证券投资基金自 2022 年 4 月 27 日起新增 C 类基金份额。

### 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

华安升级主题混合 A

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	12.65%	1.31%	7.64%	0.85%	5.01%	0.46%
过去三个月	13.44%	1.62%	4.97%	1.14%	8.47%	0.48%
过去六个月	-1.90%	1.59%	-7.43%	1.16%	5.53%	0.43%
过去一年	-14.98%	1.37%	-10.97%	1.00%	-4.01%	0.37%
过去三年	84.40%	1.26%	14.46%	1.01%	69.94%	0.25%
自基金合同生效起至今	251.54%	1.60%	30.37%	1.13%	221.17%	0.47%

华安升级主题混合 C

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	12.56%	1.31%	7.64%	0.85%	4.92%	0.46%
过去三个月	17.36%	1.38%	12.10%	0.92%	5.26%	0.46%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	17.36%	1.38%	12.10%	0.92%	5.26%	0.46%

注：华安升级主题混合型证券投资基金自 2022 年 4 月 27 日起新增 C 类基金份额。

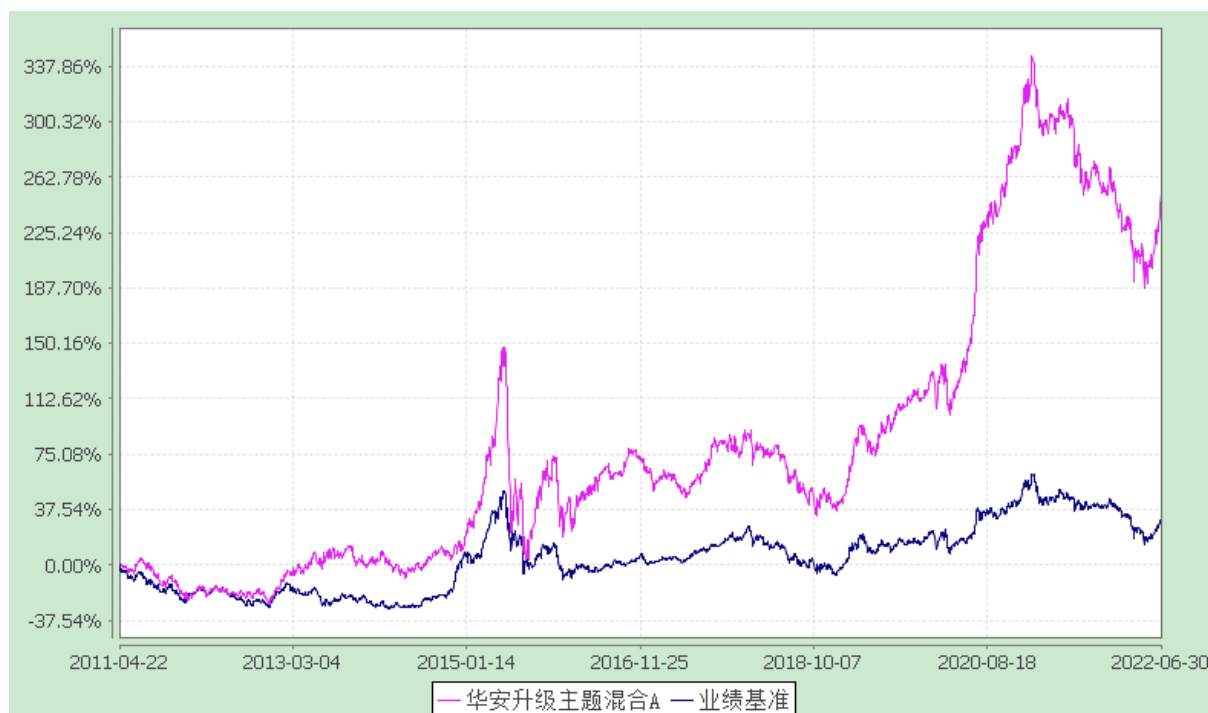
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安升级主题混合型证券投资基金

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

(2011 年 4 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日)

华安升级主题混合 A



华安升级主题混合 C





注：华安升级主题混合型证券投资基金自 2022 年 4 月 27 日起新增 C 类基金份额。

## 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。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2022 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 206 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,985.16 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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	14 年	硕士，14 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 月至 2020 年 5 月，同时担任华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起，同时担任华安升级主题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。2020 年 4 月起，同时担任华安现代生活混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月起，同时担任华安聚优精选混合型证券投资基金的基

					金经理。2021 年 8 月起，同时担任华安聚弘精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 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 12 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

2022 年上半年市场整体下跌，行业层面，煤炭、消费者服务、交运、建筑、银行等相对较强，电子、传媒、综合金融、计算机、军工等相对落后。华安升级主题净值下跌。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 2.423 元，本报告期份额净值增长率为-1.90%，同期业绩比较基准增长率为-7.43%；本基金 C 类份额净值为 2.420 元，本报告期份额净值增长率为 17.36%，同期业绩比较基准增长率为 12.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，市场受到多方面因素的影响，需求收缩、供给冲击、预期转弱。疫情对经济的冲击

相比过去一年更严重，疫情的反复加剧了一些行业的阶段性经营压力，长期看时间站在战胜疫情的一边，一些受疫情影响的行业未来基本面也会逐步回归。外部的一些不利因素，阶段性的美联储加息以及更趋复杂严峻和不确定的外部环境同样影响了市场信心，看未来，内需的重要性在提高。

无论是面对长期的外部竞争、还是稳定就业、以及持续推进的一些改革，可能都需要持续的经济增长和稳定的预期。去年底中央经济会议对市场关心、担心的问题，都有洞察、预判和深刻的认识。从去年底以来，一些稳定经济的政策逐步落地，对基本面逐步向好保持信心和耐心。

经济的中长期矛盾仍是转型升级。相比过去，经济发展面临的条件、外部环境有所变化，这也使得经济增长和过去的方式可能会有所不同，这种变化可能使得一些新兴、传统行业获得新的成长逻辑和空间。消费领域可能是受疫情影响最大的领域之一，疫情的反复仍可能持续一段时间，另一方面，药物研发也在推进，时间站在战胜疫情一边。需要更多的耐心等待疫情消退及基本面的恢复。在产业结构升级领域，争取寻找更多具有显著竞争优势、较高经营效率、广阔成长空间且估值合理的公司。

我们仍将客观评价各类投资机会，积极耐心等待寻找估值合理的优质公司、理解其成长逻辑、关注他们能力建设可能带来的成长，努力为持有人争取更好的收益。

#### 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,本基金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,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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：华安升级主题混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	72,758,146.52	82,275,150.50
结算备付金		256,429.80	1,125,324.55

存出保证金		192,581.30	278,969.20
交易性金融资产	6.4.7.2	454,955,628.52	473,250,399.47
其中：股票投资		454,955,628.52	473,248,399.47
基金投资		-	-
债券投资		-	2,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		3,071,411.06	3,866,291.72
应收股利		-	-
应收申购款		194,192.77	522,025.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	7,411.49
<b>资产总计</b>		<b>531,428,389.97</b>	<b>561,325,572.25</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,964,706.97	-
应付赎回款		1,125,179.82	560,198.98
应付管理人报酬		599,427.71	709,895.91
应付托管费		99,904.62	118,316.00
应付销售服务费		54.86	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,406,119.82	2,386,300.41
负债合计		11,195,393.80	3,774,711.30
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	214,736,116.33	225,761,090.41
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	305,496,879.84	331,789,770.54
净资产合计		520,232,996.17	557,550,860.95
负债和净资产总计		531,428,389.97	561,325,572.25

注：（1）报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 214,736,116.33 份，其中 A 类基金份额净值 2.423 元，基金份额总额 214,668,942.15 份；C 类基金份额净值 2.420 元，基金份额总额 67,174.18

份。

(2) 以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-8,741,045.98</b>	<b>38,947,422.87</b>
1.利息收入		104,879.32	469,304.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	104,879.32	469,207.24
债券利息收入		-	96.83
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）		-39,723,669.13	63,355,074.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-42,210,630.13	60,031,946.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	541.68	140,102.04
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,486,419.32	3,183,025.88
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	30,793,361.93	-25,656,167.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	84,381.90	779,211.39
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,363,012.63</b>	<b>11,647,592.18</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	3,662,875.92	6,254,913.36
2. 托管费	6.4.10.2	610,479.28	1,042,485.55
3. 销售服务费		87.28	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	0.43
8. 其他费用	6.4.7.16	89,570.15	4,350,192.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-13,104,058.61</b>	<b>27,299,830.69</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-13,104,058.61</b>	<b>27,299,830.69</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-13,104,058.61</b>	<b>27,299,830.69</b>

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	225,761,090.41	-	331,789,770.54	557,550,860.95
二、本期期初净资产（基金净值）	225,761,090.41	-	331,789,770.54	557,550,860.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,024,974.08	-	-26,292,890.70	-37,317,864.78
（一）、综合收益总额	-	-	-13,104,058.61	-13,104,058.61
（二）、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）	-11,024,974.08	-	-13,188,832.09	-24,213,806.17



其中：1.基金申购款	25,162,384.08	-	31,050,371.04	56,212,755.12
2.基金赎回款	-36,187,358.16	-	-44,239,203.13	-80,426,561.29
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	214,736,116.33	-	305,496,879.84	520,232,996.17

项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	实收基金
一、上期期末净资产（基金净值）	259,338,239.63	-	452,395,135.22	711,733,374.85
二、本期期初净资产（基金净值）	259,338,239.63	-	452,395,135.22	711,733,374.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,915,951.35	-	121,435,024.78	172,350,976.13
（一）、综合收益总额	-	-	27,299,830.69	27,299,830.69
（二）、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）	50,915,951.35	-	94,135,194.09	145,051,145.44
其中：1.基金申购款	266,122,411.02	-	487,666,713.88	753,789,124.90
2.基金赎回款	-215,206,459.67	-	-393,531,519.79	-608,737,979.46
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	310,254,190.98	-	573,830,160.00	884,084,350.98

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：朱兴华，主管会计工作负责人：朱兴华，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、存托凭证)、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产业、消费升级行业和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： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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 2022 年 8 月 26 日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外, 本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.2 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

#### 6.4.4.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证

券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：(a) 金融工具根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 82,275,150.50 元、1,125,324.55 元、278,969.20 元、7,411.49 元、3,866,291.72 元和 522,025.32 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 82,281,929.77 元、1,125,830.95 元、279,094.70 元、0.00 元、3,866,291.72 元和 522,025.32 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 473,250,399.47 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 473,250,399.79 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 560,198.98 元、709,895.91 元、118,316.00 元、2,186,336.43 元和 1,963.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 560,198.98 元、709,895.91 元、118,316.00 元、2,186,336.43 元和 1,963.98 元。(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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



比例计算缴纳。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	72,758,146.52
等于：本金	72,752,133.31
加：应计利息	6,013.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	72,758,146.52

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	432,976,555.41	-	454,955,628.52	21,979,073.11
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-
	银行间市 场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	432,976,555.41	-	454,955,628.52	21,979,073.11

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,138.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,193,720.83
其中：交易所市场	1,193,720.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	29,752.78
合计	1,406,119.82

#### 6.4.7.7 实收基金

华安升级主题混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	225,761,090.41	225,761,090.41
本期申购	25,033,388.47	25,033,388.47

本期赎回（以“-”号填列）	-36,125,536.73	-36,125,536.73
本期末	214,668,942.15	214,668,942.15

华安升级主题混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	128,995.61	128,995.61
本期赎回（以“-”号填列）	-61,821.43	-61,821.43
本期末	67,174.18	67,174.18

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安升级主题混合 A

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	397,287,268.59	-65,497,498.05	331,789,770.54
本期利润	-43,896,104.90	30,774,347.18	-13,121,757.72
本期基金份额交易产生的变动数	-17,623,674.57	4,357,130.46	-13,266,544.11
其中：基金申购款	41,652,465.82	-10,754,303.21	30,898,162.61
基金赎回款	-59,276,140.39	15,111,433.67	-44,164,706.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	335,767,489.12	-30,366,020.41	305,401,468.71

华安升级主题混合 C

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
本期利润	-1,315.64	19,014.75	17,699.11
本期基金份额交易产生的变动数	106,245.54	-28,533.52	77,712.02
其中：基金申购款	202,023.65	-49,815.22	152,208.43
基金赎回款	-95,778.11	21,281.70	-74,496.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	104,929.90	-9,518.77	95,411.13

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	94,852.43
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	8,123.45
其他	1,903.44
合计	104,879.32

**6.4.7.10 股票投资收益****6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-42,210,630.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-42,210,630.13

**6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	652,634,047.98
减：卖出股票成本总额	692,877,898.93
减：交易费用	1,966,779.18
买卖股票差价收入	-42,210,630.13

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及	540.96

债券到期兑付) 差价收入	
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	541.68

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	2,542.00
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,000.00
减: 应计利息总额	1.04
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	540.96

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,486,419.32
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	2,486,419.32

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	30,793,361.93
——股票投资	30,793,361.93
——债券投资	-
——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	30,793,361.93

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	78,277.50
转换费收入	6,104.40
合计	84,381.90

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。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。基金之间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。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	310.00
合计	89,570.15

### 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

根据本基金管理人于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经基金管理人股东会第七十三次会议决议

及中国证券监督管理委员会证监许可【2022】469 号文核准，基金管理人股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的本公司 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

#### 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(“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、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
国泰君安证券股份 有限公司	239,083,279.18	18.50%	592,189,429.57	21.00%

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
国泰君安证券股份有	0.00	0.00%	139,307.69	29.37%

限公司				
-----	--	--	--	--

#### 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 2022年1月1日至2022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
国泰君安证券股份有限公司	218,441.56	18.30%	218,441.56	18.30%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
国泰君安证券股份有限公司	539,663.11	20.78%	17,602.60	0.85%

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,662,875.92	6,254,913.36
其中：支付销售机构的客户维护费	1,431,017.95	2,170,912.28

注：支付基金管理人华安基金管理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 × 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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	610,479.28	1,042,485.55



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 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	23.21	23.21
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	23.21	23.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C	合计
合计	-	-	-

注：C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.6% 的年费率计提。销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

### 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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	72,758,146.52	94,852.43	221,142,108.68	448,347.54

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

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30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	688234	天岳先进	网下申购	2,511.00	208,925.12
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775.00	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813.00	135,783.09
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40
国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34

#### 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

无。

#### 6.4.12 期末（2022 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	受限期	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
301263	泰恩康	2022-03-22	1-6个月(含)	新股限售	19.93	31.38	682.00	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股限售	50.31	70.37	301.00	15,143.31	21,181.37	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	8.05	10.08	1,831.00	14,739.55	18,456.48	-
301235	华康医疗	2022-01-21	1-6个月(含)	新股限售	39.30	37.93	418.00	16,427.40	15,854.74	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月(含)	新股限售	76.56	51.92	303.00	23,197.68	15,731.76	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股限售	72.69	71.54	217.00	15,773.73	15,524.18	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	32.71	32.02	447.00	14,620.00	14,312.94	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	1-6个月(含)	新股限售	46.80	54.44	262.00	12,261.60	14,263.28	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股限售	72.75	45.69	305.00	22,187.90	13,935.45	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月(含)	新股限售	56.88	56.42	230.00	13,082.40	12,976.60	-

301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6个月(含)	新股限售	96.51	87.82	137.00	13,222.48	12,031.34	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月(含)	新股限售	37.23	25.39	397.00	14,780.31	10,079.83	-
301130	西点药业	2022-02-16	1-6个月(含)	新股限售	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股限售	55.57	30.03	292.00	16,226.44	8,768.76	-
301228	实朴检测	2022-01-21	1-6个月(含)	新股限售	20.08	20.34	373.00	7,489.84	7,586.82	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规

监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；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合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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。于 2022 年 6 月 30 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 522,803,632.29 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。

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、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	72,758,146.52	-	-	-	72,758,146.52
结算备付金	256,429.80	-	-	-	256,429.80
存出保证金	192,581.30	-	-	-	192,581.30
交易性金融资产	-	-	-	454,955,628.52	454,955,628.52
应收清算款	-	-	-	3,071,411.06	3,071,411.06
应收申购款	-	-	-	194,192.77	194,192.77
资产总计	73,207,157.62	-	-	458,221,232.35	531,428,389.97
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	7,964,706.97	7,964,706.97
应付赎回款	-	-	-	1,125,179.82	1,125,179.82

应付管理人报酬	-	-	-	599,427.71	599,427.71
应付托管费	-	-	-	99,904.62	99,904.62
应付销售服务费	-	-	-	54.86	54.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,406,119.82	1,406,119.82
负债总计	-	-	-	11,195,393.80	11,195,393.80
利率敏感度缺口	73,207,157.62	-	-	447,025,838.55	520,232,996.17
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	82,275,150.50	-	-	-	82,275,150.50
结算备付金	1,125,324.55	-	-	-	1,125,324.55
存出保证金	278,969.20	-	-	-	278,969.20
交易性金融资产	2,000.00	-	-	473,248,399.47	473,250,399.47
应收清算款	-	-	-	3,866,291.72	3,866,291.72
应收申购款	-	-	-	522,025.32	522,025.32
其他资产	-	-	-	7,411.49	7,411.49
资产总计	83,681,444.25	-	-	477,644,128.00	561,325,572.25
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	560,198.98	560,198.98
应付管理人报酬	-	-	-	709,895.91	709,895.91
应付托管费	-	-	-	118,316.00	118,316.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-



递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,386,300.41	2,386,300.41
负债总计	-	-	-	3,774,711.30	3,774,711.30
利率敏感度缺口	83,681,444.25	-	-	473,869,416.70	557,550,860.95

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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：0.0004%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 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，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、消费升级行业和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%。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	454,955,628. 52	87.45	473,248,399.4 7	84.88
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>454,955,628. 52</b>	<b>87.45</b>	<b>473,248,399.4 7</b>	<b>84.88</b>

### 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		
	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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	33,330,000.00	28,560,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-33,330,000.00	-28,560,000.00

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上期末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	454,744,588.91	472,046,483.47
第二层次	-	7,504.49
第三层次	211,039.61	1,196,411.51
合计	454,955,628.52	473,250,399.47

##### 6.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 8 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## 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	454,955,628.52	85.61
	其中：股票	454,955,628.52	85.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	73,014,576.32	13.74
8	其他各项资产	3,458,185.13	0.65
9	合计	531,428,389.97	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,018,698.22	0.39
C	制造业	258,130,639.40	49.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	7,444.75	0.00
F	批发和零售业	288,558.18	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	9,437,058.40	1.81
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,539,467.49	4.52
J	金融业	23,778,520.39	4.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,816,639.00	5.92
M	科学研究和技术服务业	75,912,292.92	14.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	31,011,332.33	5.96
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	454,955,628.52	87.45

### 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	601888	中国中免	132,300	30,816,639.00	5.92
2	000568	泸州老窖	106,600	26,281,164.00	5.05
3	300759	康龙化成	274,172	26,106,657.84	5.02
4	600519	贵州茅台	12,500	25,562,500.00	4.91
5	002142	宁波银行	664,019	23,778,520.39	4.57
6	603986	兆易创新	155,600	22,127,876.00	4.25
7	300347	泰格医药	177,900	20,360,655.00	3.91
8	300015	爱尔眼科	386,559	17,306,246.43	3.33
9	603369	今世缘	334,500	17,059,500.00	3.28
10	300613	富瀚微	194,292	16,475,961.60	3.17
11	600763	通策医疗	77,700	13,553,988.00	2.61
12	688131	皓元医药	92,968	13,209,823.12	2.54
13	300911	亿田智能	169,300	13,010,705.00	2.50
14	688677	海泰新光	139,155	12,800,868.45	2.46
15	300760	迈瑞医疗	39,800	12,465,360.00	2.40
16	600009	上海机场	166,200	9,423,540.00	1.81

17	000792	盐湖股份	302,700	9,068,892.00	1.74
18	002812	恩捷股份	36,000	9,016,200.00	1.73
19	000858	五粮液	43,100	8,703,183.00	1.67
20	688301	奕瑞科技	16,296	7,708,659.84	1.48
21	002049	紫光国微	40,400	7,664,688.00	1.47
22	603259	药明康德	70,400	7,320,896.00	1.41
23	688008	澜起科技	110,792	6,711,779.36	1.29
24	688050	爱博医疗	24,517	5,496,711.40	1.06
25	688295	中复神鹰	141,154	5,291,863.46	1.02
26	688200	华峰测控	14,562	5,189,896.80	1.00
27	688120	华海清科	16,790	4,170,636.00	0.80
28	688122	西部超导	45,149	4,162,737.80	0.80
29	688072	拓荆科技	26,597	4,125,194.70	0.79
30	600529	山东药玻	140,700	3,932,565.00	0.76
31	600845	宝信软件	64,200	3,505,320.00	0.67
32	688786	悦安新材	71,900	3,278,640.00	0.63
33	688179	阿拉丁	62,460	3,200,450.40	0.62
34	688665	四方光电	20,735	3,068,780.00	0.59
35	301080	百普赛斯	18,100	3,020,709.00	0.58
36	600809	山西汾酒	8,700	2,825,760.00	0.54
37	688238	和元生物	97,400	2,655,124.00	0.51
38	002460	赣锋锂业	17,800	2,646,860.00	0.51
39	300696	爱乐达	59,040	2,594,808.00	0.50
40	603198	迎驾贡酒	38,900	2,533,946.00	0.49
41	605123	派克新材	17,700	2,490,744.00	0.48
42	688188	柏楚电子	11,252	2,475,890.08	0.48
43	600132	重庆啤酒	16,400	2,404,240.00	0.46
44	603899	晨光股份	42,500	2,383,400.00	0.46
45	688356	键凯科技	9,525	2,303,240.25	0.44
46	688017	绿的谐波	18,696	2,224,824.00	0.43
47	688107	安路科技	28,844	1,981,582.80	0.38
48	688082	盛美上海	18,738	1,775,800.26	0.34
49	600123	兰花科创	103,200	1,697,640.00	0.33
50	688690	纳微科技	17,740	1,433,569.40	0.28
51	300957	贝泰妮	6,100	1,326,933.00	0.26
52	688269	凯立新材	11,121	1,178,826.00	0.23
53	601012	隆基绿能	15,800	1,052,754.00	0.20
54	688617	惠泰医疗	4,388	961,323.04	0.18
55	688083	中望软件	4,457	933,384.94	0.18
56	002791	坚朗五金	7,000	908,040.00	0.17
57	002985	北摩高科	14,600	855,268.00	0.16
58	300595	欧普康视	14,100	806,379.00	0.16
59	603833	欧派家居	5,100	768,468.00	0.15
60	688212	澳华内镜	14,512	679,161.60	0.13

61	688048	长光华芯	5,481	666,928.08	0.13
62	300450	先导智能	10,500	663,390.00	0.13
63	600702	舍得酒业	2,800	571,172.00	0.11
64	688329	艾隆科技	12,870	416,344.50	0.08
65	300502	新易盛	14,000	366,800.00	0.07
66	688197	首药控股	14,556	359,242.08	0.07
67	002179	中航光电	4,100	259,612.00	0.05
68	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.05
69	301256	华融化学	18,308	196,408.08	0.04
70	688234	天岳先进	2,511	168,237.00	0.03
71	000933	神火股份	12,700	166,116.00	0.03
72	600188	兖矿能源	4,200	165,816.00	0.03
73	301200	大族数控	3,026	162,773.76	0.03
74	301103	何氏眼科	4,463	151,097.90	0.03
75	000983	山西焦煤	10,300	137,917.00	0.03
76	301219	腾远钴业	1,368	125,874.22	0.02
77	688111	金山办公	622	122,608.64	0.02
78	688192	迪哲医药	4,518	120,811.32	0.02
79	300896	爱美客	200	120,002.00	0.02
80	002415	海康威视	2,655	96,111.00	0.02
81	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.01
82	300782	卓胜微	480	64,800.00	0.01
83	300821	东岳硅材	3,400	62,492.00	0.01
84	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
85	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
86	603122	合富中国	2,198	27,365.10	0.01
87	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
88	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
89	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
90	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
91	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.00
92	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
93	301082	久盛电气	915	16,973.25	0.00
94	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
95	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
96	301177	迪阿股份	212	15,730.40	0.00
97	301201	诚达药业	217	15,524.18	0.00
98	001313	粤海饲料	1,232	15,104.32	0.00
99	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
100	301096	百诚医药	184	14,536.00	0.00
101	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
102	301206	三元生物	305	13,935.45	0.00
103	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00
104	301190	善水科技	571	13,549.83	0.00

105	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
106	301207	华兰疫苗	230	12,976.60	0.00
107	301199	迈赫股份	402	12,880.08	0.00
108	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
109	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
110	301166	优宁维	186	10,947.96	0.00
111	301092	争光股份	323	10,161.58	0.00
112	301189	奥尼电子	305	10,159.55	0.00
113	301123	奕东电子	397	10,079.83	0.00
114	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
115	301108	洁雅股份	227	8,982.39	0.00
116	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
117	300834	星辉环材	292	8,768.76	0.00
118	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
119	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
120	301198	喜悦智行	341	7,689.55	0.00
121	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
122	301098	金埔园林	307	7,444.75	0.00
123	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
124	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
125	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
126	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
127	301053	远信工业	155	3,620.80	0.00
128	301068	大地海洋	144	3,477.60	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	300759	康龙化成	36,188,296.90	6.49
2	603369	今世缘	22,248,954.36	3.99
3	000932	华菱钢铁	17,978,913.00	3.22
4	300347	泰格医药	17,766,522.11	3.19
5	002812	恩捷股份	16,610,485.00	2.98
6	000651	格力电器	15,854,468.96	2.84
7	600985	淮北矿业	15,848,888.00	2.84
8	600123	兰花科创	15,627,662.00	2.80
9	603501	韦尔股份	14,980,684.00	2.69
10	600782	新钢股份	13,448,647.00	2.41
11	000568	泸州老窖	13,370,009.00	2.40



12	601699	潞安环能	12,732,410.08	2.28
13	688008	澜起科技	12,617,435.15	2.26
14	300015	爱尔眼科	12,520,808.88	2.25
15	300613	富瀚微	12,194,957.71	2.19
16	688131	皓元医药	12,105,584.49	2.17
17	600763	通策医疗	12,095,196.00	2.17
18	300911	亿田智能	11,725,712.05	2.10
19	000933	神火股份	11,699,655.98	2.10
20	603986	兆易创新	11,265,722.47	2.02

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	601888	中国中免	27,254,728.00	4.89
2	603501	韦尔股份	26,423,633.00	4.74
3	002415	海康威视	24,984,995.01	4.48
4	603259	药明康德	23,579,423.00	4.23
5	600782	新钢股份	22,478,414.00	4.03
6	000333	美的集团	20,820,117.00	3.73
7	688200	华峰测控	19,334,735.75	3.47
8	600519	贵州茅台	19,316,233.00	3.46
9	600123	兰花科创	18,935,384.47	3.40
10	002142	宁波银行	18,512,498.80	3.32
11	600985	淮北矿业	17,805,938.00	3.19
12	000568	泸州老窖	17,148,335.31	3.08
13	600808	马钢股份	16,822,692.00	3.02
14	300760	迈瑞医疗	16,777,286.60	3.01
15	000932	华菱钢铁	16,118,583.00	2.89
16	601699	潞安环能	15,191,072.64	2.72
17	000651	格力电器	15,068,534.00	2.70
18	000933	神火股份	12,694,568.00	2.28
19	300759	康龙化成	12,562,111.00	2.25
20	002812	恩捷股份	12,506,714.00	2.24
21	300408	三环集团	12,139,799.00	2.18
22	688111	金山办公	11,852,301.75	2.13
23	600009	上海机场	11,805,736.00	2.12

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	643,791,766.05
卖出股票的收入（成交）总额	652,634,047.98

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资金收付，被国家外汇管理局宁波市分局（甬外管罚〔2021〕7 号）责令改正，给予罚款 100 万元、没收违法所得 1048476.65 元的行政处罚。2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、占压财政存款等违法违规事项，被中国人民银行宁波市中心支行（甬银处罚字〔2021〕2 号）给予警告，并处罚款 286.2 万元的行政处罚。2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕57 号）给予罚款人民币 275 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。2021 年 12 月 29 日，宁波银行因信用卡业务管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕81 号）给予罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分的行政处罚。2022 年 4 月 11 日，宁波银行因代理保险销售不规范，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2022〕30 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚。2022 年 4 月 11 日，宁波银行因信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2022〕28 号）给予罚款人民币 220 万元的行政处罚。2022 年 4 月 21 日，宁波银行因薪酬管理不到位、关联交易管理不规范等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2022〕35 号）给予罚款人民币 270 万元的行政处罚。2022 年 5 月 27 日，宁波银行因非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2022〕44 号）给予罚款人民币 290 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他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 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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	192,581.30
2	应收清算款	3,071,411.06

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	194,192.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,458,185.13

#### 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不存在流通受限情况。

## 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

份额级别	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
华安升级主题混合 A	42,127	5,095.76	5,186,206.07	2.42%	209,482,736.08	97.58%
华安升级主题混合 C	39	1,722.41	0.00	0.00%	67,174.18	100.00%
合计	42,166	5,092.64	5,186,206.07	2.42%	209,549,910.26	97.58%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华安升级主题混合 A	536,689.34	0.25%
	华安升级主题混合 C	0.00	0.00%
	合计	536,689.34	0.25%

### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华安升级主题混合 A	-
	华安升级主题混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华安升级主题混合 A	10~50
	华安升级主题混合 C	-
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只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

项目	华安升级主题混合 A	华安升级主题混合 C
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	225,761,090.41	-
本报告期基金总申购份额	25,033,388.47	128,995.61
减：本报告期基金总赎回份额	36,125,536.73	61,821.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	214,668,942.15	67,174.18

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## 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：

2022 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告》，范伟隽先生离任本基金管理人的首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 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	
中信建投	2	250,889,215.43	19.42%	233,649.62	19.57%	-
国泰君安证券	2	239,083,279.18	18.50%	218,441.56	18.30%	-
诚通证券	2	143,648,575.11	11.12%	133,779.87	11.21%	-
申万宏源	2	131,171,638.63	10.15%	119,559.98	10.02%	-
方正证券	3	127,705,764.01	9.88%	116,749.86	9.78%	-
中信证券	1	124,639,704.82	9.65%	116,076.66	9.72%	-
国盛证券	1	119,881,062.84	9.28%	111,646.22	9.35%	-
长江证券	2	64,581,213.58	5.00%	60,143.38	5.04%	-
中金公司	1	48,392,899.72	3.74%	45,066.99	3.78%	-
天风证券	2	26,142,378.70	2.02%	23,823.97	2.00%	-
西南证券	1	8,437,975.00	0.65%	7,735.78	0.65%	-
光大证券	2	6,815,507.00	0.53%	6,279.17	0.53%	-
银河证券	1	824,416.87	0.06%	767.77	0.06%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

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，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

（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：

2022 年 1 月完成租用托管在建设银行的国泰君安北交所 720216 交易单元。

**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
中信建投	2,542.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-



华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（天岳先进）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
3	华安升级主题混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-21
4	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（万控智造）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-04
6	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-15
7	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（泰恩康）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-23
8	华安升级主题混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-30
9	华安升级主题混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-21
10	关于旗下部分基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-27
11	华安升级主题混合型证券投资基金基金合同更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-27
12	华安升级主题混合型证券投资基金托管协议更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2022-04-27

		定媒介	
13	华安升级主题混合型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-27
14	华安升级主题混合型证券投资基金（华安升级主题混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-27
15	华安升级主题混合型证券投资基金（华安升级主题混合 C）基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-27
16	华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-30
17	华安升级主题混合型证券投资基金更新的招募说明书(2022 年第 2 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-30
18	华安升级主题混合型证券投资基金（华安升级主题混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-30
19	华安升级主题混合型证券投资基金（华安升级主题混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

## 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

二〇二二年八月三十日