

**华安智联混合型证券投资基金（LOF）**  
**(原华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基**  
**金转型)**

**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>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.1.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）	5
2.1.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	5
2.2 基金产品说明	6
2.2.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）	6
2.2.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标	8
3.1.2 基金净值表现	8
3.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	9
3.2.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2.2 基金净值表现	9
<b>4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验	11
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.3.1 公平交易制度的执行情况	14
4.3.2 异常交易行为的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	15
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析	15
4.4.2 报告期内基金的业绩表现	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
<b>5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	19
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	19
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>19</b>
6.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）	19
6.1.1 资产负债表	19
6.1.2 利润表	20
6.1.3 净资产（基金净值）变动表	22

6.1.4 报表附注 .....	23
6.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 .....	46
6.2.1 资产负债表 .....	46
6.2.2 利润表 .....	47
6.2.3 净资产（基金净值）变动表 .....	49
6.2.4 报表附注 .....	50
<b>7 投资组合报告 .....</b>	<b>75</b>
7.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF） .....	75
7.1.1 期末基金资产组合情况 .....	75
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	75
7.1.3 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 .....	76
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	78
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	79
7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	80
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	80
7.1.8 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 .....	80
7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	80
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	80
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	80
7.2.1 投资组合报告附注 .....	81
7.3 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 .....	81
7.3.1 期末基金资产组合情况 .....	81
7.3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	82
7.3.3 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 .....	83
7.3.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	85
7.3.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	86
7.3.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	87
7.3.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	87
7.3.8 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 .....	87
7.3.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	87
7.3.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	87
7.3.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	88
7.4.1 投资组合报告附注 .....	88
<b>8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>89</b>
8.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF） .....	89
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	89
8.1.2 期末上市基金前十名持有人 .....	89
8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	89
8.1.4 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 .....	90
8.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 .....	90
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	90
8.2.2 期末上市基金前十名持有人 .....	90
8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	91
8.2.4 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 .....	91
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>91</b>

9.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF） .....	91
9.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 .....	91
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>92</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	92
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 .....	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
10.4 基金投资策略的改变 .....	92
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	92
10.6 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	92
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	92
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	92
10.8.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF） .....	92
10.8.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 .....	95
10.9 其他重大事件 .....	98
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>98</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>99</b>
12.1 备查文件目录 .....	99
12.2 存放地点 .....	99
12.3 查阅方式 .....	99

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

基金名称	华安智联混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	华安智联混合（LOF）
场内简称	华安智联
基金主代码	501073
交易代码	501073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年6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	517,747,784.98份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

基金名称	华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安科创主题混合

场内简称	华安科创
基金主代码	501073
交易代码	501073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月11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	988,565,281.49份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。 本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.2.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采取相对灵活的资产配置策略。</p> <p>本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。</p> <p>本基金管理人根据多因素框架的分析结果，给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。</p> <p>本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪科创板企业所处行业，努力探寻具备长期价值增长潜力的科创板上市公司。采用定性分析与定量分析相结合、自上而下与自下而上相结合、书面资料与实地调研相结合的方式，系统地审视与判断投资机遇。</p>

业绩比较基准	<p>（一）封闭运作期内</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×40%+中债综合指数收益率×60%。</p> <p>（二）封闭运作期届满转为开放式运作后</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p>

### 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	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

##### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年6月14日至2022年6月30日)
本期已实现收益	-5,578,289.72
本期利润	9,063,841.26
加权平均基金份额本期利润	0.0142
本期加权平均净值利润率	1.35%
本期基金份额净值增长率	1.69%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	32,964,801.95
期末可供分配基金份额利润	0.0637
期末基金资产净值	551,952,219.80
期末基金份额净值	1.0661
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.69%

##### 3.1.2 基金净值表现

###### 3.1.2.1 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	1.69%	0.48%	1.15%	0.21%	0.54%	0.27%
过去三个月	1.69%	0.48%	1.15%	0.21%	0.54%	0.27%
过去六个月						
过去一年						
过去三年						
自基金合同生效起至今	1.69%	0.48%	1.15%	0.21%	0.54%	0.27%

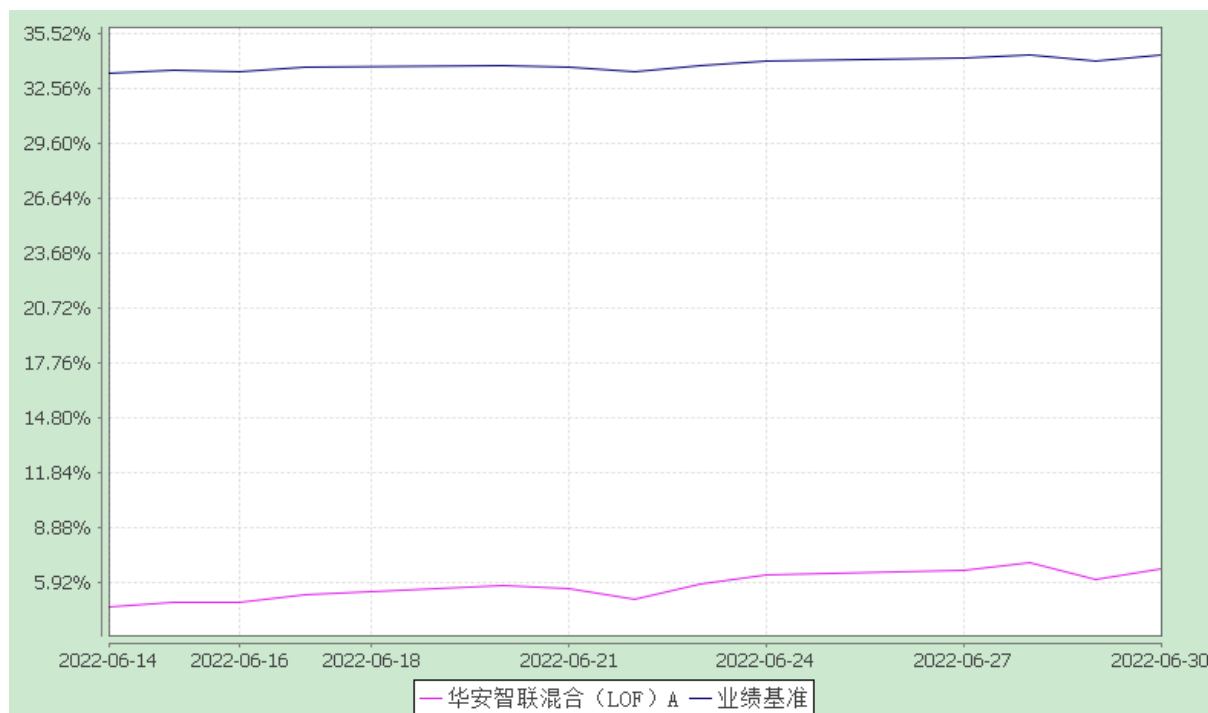
###### 3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安智联混合型证券投资基金（LOF）

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

(2022年6月14日至2022年6月30日)





### 3.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

#### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日至2022年6月13日)
本期已实现收益	-66,887,225.23
本期利润	-126,285,029.72
加权平均基金份额本期利润	-0.1277
本期加权平均净值利润率	-11.89%
本期基金份额净值增长率	-10.87%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月13日)
期末可供分配利润	38,308,656.86
期末可供分配基金份额利润	0.0388
期末基金资产净值	1,036,424,019.39
期末基金份额净值	1.0484
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月13日)
基金份额累计净值增长率	4.84%

#### 3.2.2 基金净值表现

##### 3.2.2.1 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	1.97%	0.57%	3.77%	0.60%	-1.80%	-0.03%
过去三个月	-3.53%	0.80%	-0.79%	0.88%	-2.74%	-0.08%
过去六个月	-12.74%	0.79%	-8.33%	0.75%	-4.41%	0.04%
过去一年	-11.03%	0.73%	-7.63%	0.66%	-3.40%	0.07%
过去三年	4.84%	0.44%	31.14%	0.67%	-26.30%	-0.23%
自基金合同生效起至今	4.84%	0.44%	33.24%	0.67%	-28.40%	-0.23%

注：过去一个月指 2022 年 5 月 12 日至 2022 年 6 月 13 日，过去三个月指 2022 年 3 月 12 日至 2022 年 6 月 13 日，过去六个月指 2021 年 12 月 12 日至 2022 年 6 月 13 日，过去一年指 2021 年 6 月 12 日至 2022 年 6 月 13 日，过去三年指 2019 年 6 月 12 日至 2022 年 6 月 13 日。自基金合同生效起至今指 2019 年 6 月 11 日至 2022 年 6 月 13 日

### 3.2.2.2 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

华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置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

(2019 年 6 月 11 日至 2022 年 6 月 13 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		
谢昌旭	本基金的 基金经理	2019-06-11	2022-03-28	9 年	硕士研究生，9 年基金及相关行业从业经验。曾任融通基金管理有限公司研究员、平安养老保险股份有限公司权益投资经理。2018 年 9 月加入华安基金，2018 年 10 月起至 2022 年 3 月，担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2022 年 3 月，同时担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2022 年 3 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 8 月，同时担任华安安华灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月至 2022

					年 3 月，同时担任华安医疗创新混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 8 月，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
朱才敏	本基金的基金经理	2021-03-08	-	14 年	金融工程硕士，具有基金从业资格，14 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届毕业生进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014 年 11 月至 2017 年 7 月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 11 月至 2022 年 2 月，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理，2014 年 11 月起，同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2018 年 10 月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月至 2018 年 1 月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2017 年 12 月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金

					<p>经理。2019 年 5 月至 2022 年 2 月，同时担任华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2021 年 3 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019 年 8 月至 2021 年 3 月，同时担任华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p>
李欣	本基金的基金经理	2022-03-28	-	12 年	<p>硕士研究生，12 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，历任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 11 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安科技动力混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起，同时担任华安科技创新混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华</p>

					安汇宏精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起，再次担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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，煤炭、建筑装饰、石油石化、社会服务、交通运输等行业涨幅居前。全球地缘政治动荡和化石能源资本开支的下滑，导致石油、天然气、煤炭的国际价格出现较大幅度的上涨，结合上半年大部分时间市场风险偏好处于下行或较低位置，市场资金对煤炭、石油石化等受益于全球能源通胀且供需格局较为稳定的行业较为青睐。社会服务、交通运输等行业的产能供给受到疫情影响出现了收缩和向头部企业集中，行业内上市公司的长期竞争格局和盈利变量趋于优化，也受到了市场的认可。同时，“稳增长”相关行业表现出很强的韧性。另一方面，计算机、电子、传媒、国防军工、环保等行业跌幅较大。美联储加息缩表对全球科技股的风险偏好和估值都造成了比较大的影响，同时，互联网、传媒等行业的监管整改处于持续进行中，半导体行业在经历了疫情后需求结构性增长和供应链“梗阻”所导致的涨价周期后出现了行业景气的弱化。

新能源等行业在上半年内呈现出显著的“V”型走势，一季度的联储加息预期、疫情影响等因素对

其估值和短期业绩预期产生了负面影响，股价回调较多，但 4 月底以来，因其快速恢复和屡屡上修的全球行业需求基本面，股价出现了显著上涨和超额收益。

抗疫与产业链恢复进程是影响上半年市场走势和各行业结构性表现的重要因素。新能源、半导体、电力电子、汽车供应链等上下游影响大、在全球产业链中具有重要地位的行业，经受住了疫情对连续生产、物流、供应链的考验，提高了其抗风险能力和长期竞争力。

本基金在报告期内，在恪守基金合同、坚持投资理念的基础上，因应疫情防控和产业链恢复等经营环境演进，根据各行业的产业发展和上市公司基本面变化，在投资上也做了必要的调整。我们认为，能源、信息、健康是社会发展的本质性、基础性的支撑和需求，是值得长期研究和投资的重要方向，但在不同的时间段，各行业的产业要素如技术进步、原材料成本、竞争格局、下游应用范围等在不断的变化和演进，各公司的个体化竞争要素也在变化，因此我们需要经过严谨和全面的研究在投资端做出慎重而及时的变化。

本基金在确定投资标的和投资比例时，参考基金合同中对资产配置策略的相关表述。债券方面，保持对利率债和高等级信用债的基本配置，动态调整组合久期和杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金于 2022 年 6 月 14 日转型。转型后截至 2022 年 6 月 30 日本基金份额净值为 1.0661 元；转型后份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准增长率为 1.15%。

转型前截至 2022 年 6 月 13 日，本基金份额净值为 1.0484 元；转型前本报告期份额净值增长率为-10.87%，同期业绩比较基准增长率为-7.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人认为，就宏观经济而言，国内和海外尤其是美国的形势对比将发生转换。就 2022 年上半年而言，中国经济面临的压力集中释放，包括疫情、输入性通胀、互联网与教育等行业的调整周期等；同时美国经济增长较为强劲，就业、消费等均较为强势。而展望 2022 年下半年和 2023 年上半年，国内经济环境会有多重正面因素的叠加，包括线下消费的恢复，输入性通胀影响的边际减少，更为重要的是，二十大及两会的召开，将在极大程度上稳定市场今后中长期的政策预期，增强国际资本对我国资产的长期信心。而美国经济面临从通胀转向滞涨的风险，持续加息和缩表对其国内经济的压力可能会持续增加，从而对美联储较为鹰派的货币政策形成掣肘。

但与此同时，随着国内经济在疫情后的恢复以及内外部压力的缓解，国内货币政策的边际变化亦值得高度关注。在此情况之下，我们认为，市场以结构性机会为主。

全球能源变局是近年来最大的产业变革机会。发电、输配电、用电这三大环节的变革分别对应着光伏风电、智能电网、新能源车的产业机会。在光伏风电领域，上游关键原料价格的坚韧性有可



能超市场预期，从而产生估值提升的机会；分布式户用系统相对于集中式系统具有更高的成长速度；储能系统的渗透率将快速提升。而与此同时，光伏、风电等新能源发电在电源端有输出不稳定的固有特性，从而对调峰调频、无功补偿等电力设备带来巨大的需求；新能源车渗透率提升进程屡超预期，对电池、电控、充电桩等设备和系统带来了前所未有的机遇，推动了功率半导体、功率被动器件、磁性材料、高压连接器等上游行业的快速发展。

半导体行业在周期性和成长性双重因素的影响下，有望在今年下半年出现积极的变化。周期性角度，半导体代工厂订单边际放松、半导体的渠道价格松动大约从 2022 年初开始，根据历史经验，周期下行时间段约为一年左右的概率较大，而 A 股半导体估值对景气转弱预期的反映从 2021 年下半年即开始，应当说预期是比较充分的。成长性角度，新能源车的“三电”、BMS（电池管理）系统以及逆变器和新型电力系统对功率半导体、隔离与驱动芯片、模拟前端和 SOC（系统级芯片）带来了新的市场空间；智能网联汽车推动了各类光电传感器、接口芯片、智能驾驶和智能座舱用到的处理器等芯片的快速增长。HPC 高性能计算和 AIOT 智能物联网等领域对半导体成长性增长的动力持续存在。半导体设备、材料、EDA 软件等领域的国产替代进程顺利，相应公司的成长性较为坚实。

全球产业链的重构和再平衡过程值得高度重视。我们注意到，欧美主要国家都把制造业尤其是科技产业的供应链安全性和自主性问题提到了前所未有的高度。美国与欧洲政府都宣布将斥巨资扶持其境内的半导体产业链尤其是制造企业。这一举动显然主要不是从效率与成本的角度出发，而是对产业安全、地缘政治有更多的考量。美国对生物医药行业存在同样的政策取向。上个世纪以来，跨国公司、资本流动、产业链分工等一整套体系构建了一个在全球范围内进行产业分工、提升运行效率的分工合作模式，各个参与方受益其中，达成了彼此的平衡点。但近年来在各种因素的推动下，这一模式在逐渐改变，正在寻找新的平衡点。我们重视在完善本土供应链方面取得突破并具有优势的公司，即使它们距离全球一流仍有很大差距，时间站在它们这边。

医药健康领域，创新药产业链仍是长期确定的方向。疫情以来，mRNA 疫苗、小分子新冠特效药等均加速了药物创新各个环节的速度。创新药涉及到比较多的未知领域，必然有风险，疫情期间的客观形势促进了社会对创新药的认知和接纳程度。我们看好创新药制药企业，以及 CRO、CDMO 等产业链。标准化的医药器械、耗材、药品、服务受到集采的价格压力，我们看好那些通过创新实现进口替代、创造差异化疗效，从而维持和放大长期价值的医药公司。我们将结合对各种市场干扰因素变量的观察，考虑行业的投资机会。

我们也看好高端制造、军工、受益于疫情后复苏的社会服务与交通运输等方向，限于篇幅原因，就不一一展开了。

管理人注重对基金合同的全面、深入的理解和把握。基金合同中指出，本基金封闭运作期届满

转为开放式后，采取相对灵活的资产配置策略，采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。债券操作上，我们将动态调整组合杠杆水平和久期，维持高信用等级策略。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

#### 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合规守信、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 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

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
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.1.4.7.1	178,570,783.24
结算备付金		-
存出保证金		135,956.52
交易性金融资产	6.1.4.7.2	203,182,636.88
其中：股票投资		197,910,512.63
基金投资		-
债券投资		5,272,124.25
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	220,020,112.27
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		28,310.94
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.5	-

资产总计		601,937,799.85
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日
<b>负 债：</b>		-
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		32,717,071.40
应付赎回款		15,482,762.30
应付管理人报酬		657,017.39
应付托管费		134,976.54
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		13,401.57
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.6	980,350.85
<b>负债合计</b>		<b>49,985,580.05</b>
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.1.4.7.7	517,747,784.98
其他综合收益		-
未分配利润	6.1.4.7.8	34,204,434.82
<b>净资产合计</b>		<b>551,952,219.80</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>601,937,799.85</b>

注：（1）报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0661 元，基金份额总额 517,747,784.98 份。

（2）本基金由华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型而成，转型日为 2022 年 6 月 14 日。

（3）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。

## 6.1.2 利润表

会计主体：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 6 月 14 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年6月14日至 2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		<b>9,349,842.99</b>
1.利息收入	6.1.4.7.9	250,830.41
其中：存款利息收入		64,095.52
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		186,734.89
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6.1.4.7.10	-5,874,517.05
其中：股票投资收益		-5,929,701.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.11	8.57
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.12	-
股利收益	6.1.4.7.13	55,176.15
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.14	14,642,130.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.15	331,398.65
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>286,001.73</b>
1. 管理人报酬		213,978.41
2. 托管费		61,136.70
3. 销售服务费		-
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		0.04
8. 其他费用	6.1.4.7.16	10,886.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,063,841.26</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,063,841.26</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>9,063,841.26</b>

注：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》中的利润表格式的要求进行列示：2021年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.1.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022年6月14日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年6月14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）	988,565,281.49		47,858,737.90	1,036,424,019.39
二、本期期初净资产（基金净值）	988,565,281.49		47,858,737.90	1,036,424,019.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-470,817,496.51	-	-13,654,303.08	-484,471,799.59
（一）、综合收益总额	-	-	9,063,841.26	9,063,841.26
（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）	-470,817,496.51	-	-22,749,753.9	-493,535,640.85
其中：1.基金申购款	546,612.32	-	31,609.56	578,221.88
2.基金赎回款	-471,364,108.83	-	-22,749,753.90	-494,113,862.73
（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）	517,747,784.98	-	34,204,434.82	551,952,219.80

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.1.4 报表附注

### 6.1.4.1 基金基本情况

华安智联混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是根据《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,由华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华安科创主题混合基金”)转型而来。

根据《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作期为基金合同生效日(含)起至3年后的年度对日止的期间。封闭运作期届满后转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”。根据本基金的基金管理人于2022年6月11日发布的《关于华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及转型相关安排的公告》,华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作期于2022年6月13日届满,自2022年6月14日起自动转为上市开放式基金(LOF),并接受场外、场内申购赎回,基金名称将变更为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”。经与基金托管人协商一致,并报中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)备案,基金管理人于对基金合同、托管协议进行了修订,修订后的《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《华安智联混合型证券投资基金(LOF)托管协议》自2022年6月14日起生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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。

本基金在上海证券交易所(以下简称“上交所”)挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《华安智联混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书》,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的

有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货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)。本基金的投资组合比例：股票资产投资比例为 0%-45%。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，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

#### 6.1.4.2 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》、《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间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 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.1.4.4.3 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。

### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或

负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益方式包括现金分红与红利再投资，其中登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类别的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资，登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.1.4.4.12 外币交易

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.1.4.5.2 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。

##### **6.1.4.5.3 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。

#### **6.1.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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) 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。

(4) 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。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 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	178,570,783.24
等于：本金	178,550,767.47
加：应计利息	20,015.77
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	178,570,783.24

#### 6.1.4.7.2 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	204,300,987.34	-	197,910,512.63	-6,390,474.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	14,288.65	5,272,124.25	68,149.71
	银行间市场	-	-	-
	合计	14,288.65	5,272,124.25	68,149.71
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	209,490,673.23	14,288.65	203,182,636.88	-6,322,325.00

#### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	220,020,112.27	-
银行间市场	-	-



合计	220,020,112.27	-

#### 6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.1.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.1.4.7.6 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	735.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	750,519.71
其中：交易所市场	745,255.72
银行间市场	5,263.99
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	49,588.57
合计	980,350.85

#### 6.1.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年6月14日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	988,565,281.49	988,565,281.49
本期申购	546,612.32	546,612.32
本期赎回（以“-”号填列）	471,364,108.83	471,364,108.83
本期末	517,747,784.98	517,747,784.98

#### 6.1.4.7.8 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	-	-	-
本期初	135,710,419.11	38,433,348.51	174,143,767.62
本期利润	-72,465,514.95	-44,755,673.51	-117,221,188.46
本期基金份额交易产生的变动数	-30,280,102.21	7,561,957.87	-22,718,144.34
其中：基金申购款	34,935.19	-3,325.63	31,609.56
基金赎回款	-30,315,037.40	7,565,283.50	-22,749,753.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,964,801.95	1,239,632.87	34,204,434.82

#### 6.1.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年6月14日至2022年6月30日
活期存款利息收入	63,991.97
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	-0.21
其他	103.76
合计	64,095.52

#### 6.1.4.7.10 股票投资收益

##### 6.1.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年6月14日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,929,701.77
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	-5,929,701.77

##### 6.1.4.7.10.2 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6月14日至2022年6月30日

卖出股票成交总额	40,898,643.03
减：卖出股票成本总额	46,687,085.41
减：交易费用	141,259.39
买卖股票差价收入	-5,929,701.77

#### 6.2.4.7.11 债券投资收益

##### 6.2.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年6月14日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	8.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）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	8.57

#### 6.1.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.1.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.1.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.1.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年6月14日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	55,176.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	55,176.15

#### 6.1.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年6月14日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	14,642,130.98
——股票投资	14,627,986.87
——债券投资	14,144.11
——资产支持证券投资	-
——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	14,642,130.98

#### 6.1.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年6月14日至2022年6月30日
基金赎回费收入	331,398.65
合计	331,398.65

#### 6.1.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年6月14日至2022年6月30日
审计费	4,657.49
信息披露费	5,589.09
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行汇划费	640.00
其他费用	-
合计	10,886.58

#### 6.1.4.8 关联方关系

##### 6.1.4.8.1 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。

#### 6.1.4.8.2 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
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
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

注：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。

#### 6.1.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.9.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年6月14日至2022年6月30日	
	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	25,401,000.21	25.44%

##### 6.1.4.9.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年6月14日至2022年6月30日	
	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限公司	0.00	0.00%

##### 6.1.4.9.3 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6月14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	23,402.17	25.30%	169,571.76	22.75%

##### 6.1.4.9.4 关联方报酬

###### 6.1.4.9.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年6月14日至2022年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	213,978.41
其中：支付销售机构的客户维护费	60,779.89

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.1.4.9.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年6月14日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	61,136.70

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 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.1.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.9.5.1 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

份额单位：份

关联方名称	华安智联混合（LOF）本期末 2022年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	19,626,438.51	3.79%

##### 6.1.4.9.6 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6月14日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	357,141,566.48	253,042.63

#### 6.1.4.10 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.10.1 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

6.1.4.10.1.1 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
688171	纬德信息	2022-01-20	1-6个月(含)	新股限售	28.68	22.77	2,821.00	80,906.28	64,234.17	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月(含)	新股限售	76.56	51.92	640.00	48,998.40	33,228.80	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股限售	72.77	45.69	641.00	46,671.10	29,287.29	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月(含)	新股限售	56.88	56.42	490.00	27,871.20	27,645.80	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6个月(含)	新股限售	96.90	87.82	288.00	27,836.80	25,292.16	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股限售	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	-
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	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股限售	55.57	30.03	614.00	34,119.98	18,438.42	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月(含)	新股限售	37.23	25.39	656.00	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	32.69	32.02	507.00	16,575.00	16,234.14	-
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	-
301111	佳缘	2022-	1-6个月(含)	新股	46.80	54.44	262.00	12,261	14,263	-

7	科技	01-07	月 (含)	限售				.60	.28	
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	-
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	-

#### 6.1.4.10.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

#### 6.1.4.11 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

##### 6.1.4.11.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

##### 6.1.4.11.2 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。

#### **6.1.4.11.2.1 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.1.4.11.2.2 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.1.4.11.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.1.4.11.3 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。

#### **6.1.4.11.3.1 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。

#### **6.1.4.11.4 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。

##### **6.1.4.11.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

#### 6.1.4.11.4.1.1 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	178,570,783.24	-	-	-	178,570,783.24
存出保证金	135,956.52	-	-	-	135,956.52
交易性金融资产	5,272,124.25	-	-	197,910,512.63	203,182,636.88
买入返售金融资产	220,020,112.27	-	-	-	220,020,112.27
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	28,310.94	28,310.94
资产总计	403,998,976.28	-	-	197,938,823.57	601,937,799.85
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	-	-	-	32,717,071.40	32,717,071.40
应付赎回款	-	-	-	15,482,762.30	15,482,762.30
应付管理人报酬	-	-	-	657,017.39	657,017.39
应付托管费	-	-	-	134,976.54	134,976.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13,401.57	13,401.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	980,350.85	980,350.85
负债总计	-	-	-	49,985,580.05	49,985,580.05

利率敏感度缺口	403,998,976.28	-	-	147,953,243.52	551,952,219.80
---------	----------------	---	---	----------------	----------------

#### 6.1.4.11.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022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0.96%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.1.4.11.4.2 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。

#### 6.1.4.11.4.3 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。本基金股票资产投资比例为0%-45%，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，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

#### 6.1.4.11.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	197,910,512.63	35.86
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-

合计	197,910,512.63	35.86
----	----------------	-------

#### 6.1.4.11.4.3.2 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：人民币元）
		本期末 2022年6月30日
	业绩比较基准上升5%	53,320,000.00
	业绩比较基准下降5%	-53,320,000.00

### 6.1.5 公允价值

#### 6.1.5.1 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。

#### 6.1.5.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.1.5.2.1 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	上期末
	2022年6月14日至2022年6月30日	2022年6月13日
第一层次	197,804,544.33	170,820,276.91
第二层次	5,014,143.56	-
第三层次	363,948.99	440,228.87
合计	203,182,636.88	171,260,505.78

##### 6.1.5.2.2 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。

### 6.1.5.3 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。

### 6.1.5.4 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。

## 6.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月13日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月13日	上期末 2021年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.2.4.7.1	866,438,835.89	25,533,625.94
结算备付金		1,890.57	504,488.24
存出保证金		136,386.17	148,642.42
交易性金融资产	6.2.4.7.2	171,260,505.78	1,139,088,693.74
其中：股票投资		171,019,369.02	512,669,539.22
基金投资		-	-
债券投资		241,136.76	626,419,154.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,037,837,618.41</b>	<b>1,165,275,450.34</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上期末</b>

		2022年6月13日	2021年12月31日
<b>负债：</b>		-	-
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		6,451.20	-
应付赎回款			-
应付管理人报酬		443,038.98	1,196,185.44
应付托管费		73,839.84	199,364.26
应付销售服务费			-
应付投资顾问费			-
应交税费		13,401.19	56,972.84
应付利润			-
递延所得税负债			-
其他负债	6.2.4.7.6	876,867.81	1,113,878.69
<b>负债合计</b>		<b>1,413,599.02</b>	<b>2,566,401.23</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.2.4.7.7	988,565,281.49	988,565,281.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.2.4.7.8	47,858,737.90	174,143,767.62
<b>净资产合计</b>		<b>1,036,424,019.39</b>	<b>1,162,709,049.11</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>1,037,837,618.41</b>	<b>1,165,275,450.34</b>

(1) 报告截至日 2022 年 6 月 13 日，基金份额净值 1.0484 元，基金份额总额 988,565,281.49 份。

(2) 本基金自 2022 年 6 月 14 日转型为华安智联混合型证券投资基金（LOF）基金。

(3) 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。

## 6.2.2 利润表

会计主体：华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 13 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 13 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

<b>一、营业总收入</b>		<b>-119,444,417.70</b>	<b>75,330,620.78</b>
1.利息收入	6.2.4.7.9	479,392.80	18,762,536.04
其中：存款利息收入		194,105.38	163,903.34
债券利息收入		-	18,524,397.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		285,287.42	74,235.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6.2.4.7.10	-60,526,006.01	17,490,426.00
其中：股票投资收益		-71,097,700.15	18,265,218.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.11	9,027,489.69	-1,204,037.22
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.12	-	-
股利收益	6.2.4.7.13	1,544,204.45	429,244.68
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.14	-59,397,804.49	39,077,658.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,840,612.02</b>	<b>8,923,694.43</b>
1. 管理人报酬		5,736,888.00	6,806,241.28
2. 托管费		956,147.98	1,134,373.57
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	346,247.20
其中：卖出回购金融资产支出		-	346,247.20
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		27,524.30	66,446.21
8. 其他费用	6.2.4.7.16	120,051.74	570,386.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-126,285,029.72</b>	<b>66,406,926.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-126,285,029.72</b>	<b>66,406,926.35</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>-126,285,029.72</b>	<b>66,406,926.35</b>

注：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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”



金额。

### 6.2.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月13日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月13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)	988,565,281.49		174,143,767.62	1,162,709,049.11
二、本期期初净资产(基金净值)	988,565,281.49		174,143,767.62	1,162,709,049.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-126,285,029.72	-126,285,029.72
(一)、综合收益总额	-	-	-126,285,029.72	-126,285,029.72
(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)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	988,565,281.49	-	47,858,737.90	1,036,424,019.39

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：

基金管理公司负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(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[2019]第935号《关于准予华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合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人民币988,565,281.49元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0346号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年6月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为988,565,281.49份基金份额,无认购资金利息折合的基金份额。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《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内,本基金不办理申购、赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后,投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”,并接受场外、场内申购赎回。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]286号文核准同意,本基金323,941,884.00份基金份额于2019年12月20日在上交所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金于封闭运作期内投资于国内依法发行上市的股票(含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货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)。本基金于封闭运作期的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的0%-100%;投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%;在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金于封闭运作期的业绩比较基准为:中国战略新兴产业成份指数收益率 $\times$ 40%+中债综合指数收益率 $\times$ 60%。

#### 6.2.4.2 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》、《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年1月1日至2022年6月13日止期间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06月13日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月13日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.2.4.4 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。

##### 6.2.4.4.1 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。

#### 6.2.4.4.2 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。

#### 6.2.4.4.3 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。

## 6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.2.4.5.1 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927,734,899.30元、12,423,744.91元、1,466,248.35元、3,000,505.68元、45,951,964.42元和2,423,285.04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927,830,214.83元、12,429,335.61元、1,466,908.15元、0.00元、45,951,964.42元和2,423,285.04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2,877,020,097.90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2,879,919,037.55元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、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133,787,513.26元、2,871,673.17元、4,798,153.22元、799,692.19元、16,090,748.63元和253,897.08元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、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133,787,513.26元、2,871,673.17元、4,798,153.22元、799,692.19元、16,090,748.63元和253,897.08元。于2021年12月31日,本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售

金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。（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。

#### 6.2.4.5.2 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。

#### 6.2.4.5.3 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。

#### 6.2.4.6 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。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月13日
活期存款	866,438,835.89
等于: 本金	866,289,305.26
加: 应计利息	149,530.63
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	866,438,835.89

##### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月13日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		192,037,830.60	-	171,019,369.02	-21,018,461.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	187,000.00	131.16	241,136.76	54,005.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	187,000.00	131.16	241,136.76	54,005.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		192,224,830.60	131.16	171,260,505.78	-20,964,455.98

#### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.2.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.2.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月13日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	658,018.45
其中：交易所市场	652,754.46
银行间市场	5,263.99
应付利息	-

预提信息披露费	173,918.28
预提审计费	44,931.08
合计	876,867.81

#### 6.2.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月13日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	988,565,281.49	988,565,281.49
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	988,565,281.49	988,565,281.49

#### 6.2.4.7.8 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
本期初	135,710,419.11	38,433,348.51	174,143,767.62
本期利润	-66,887,225.23	-59,397,804.49	-126,285,029.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,823,193.88	-20,964,455.98	47,858,737.90

#### 6.2.4.7.9 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13日	
	活期存款利息收入	189,050.66
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	4,082.11	
其他	972.61	
合计	194,105.38	

#### 6.2.4.7.10 股票投资收益

#### 6.2.4.7.10.1 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13日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,097,700.15
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-71,097,700.15

#### 6.2.4.7.10.2 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13日
卖出股票成交总额	463,884,239.39
减：卖出股票成本总额	533,788,522.73
减：交易费用	1,193,416.81
买卖股票差价收入	-71,097,700.15

#### 6.2.4.7.11 债券投资收益

##### 6.2.4.7.11.1 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13日
债券投资收益——利息收入	7,735,401.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,292,087.84
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	9,027,489.69

##### 6.2.4.7.11.2 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13日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	732,082,292.34

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	717,122,233.33
减：应收利息总额	13,665,435.63
减：交易费用	2,535.54
买卖债券差价收入	1,292,087.84

#### 6.2.4.7.11.2 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.2.4.7.12 贵金属投资收益

无。

#### 6.2.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.2.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.2.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.2.4.7.14 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13日
股票投资产生的股利收益	1,544,204.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,544,204.45

#### 6.2.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月13日
1.交易性金融资产	-59,397,804.49
——股票投资	-58,466,350.67
——债券投资	-931,453.82
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
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	-59,397,804.49

#### 6.2.4.7.16 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13日
审计费	44,931.08
信息披露费	53,918.28
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
银行汇划费	2,602.38
其他费用	600.00
合计	120,051.74

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

###### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.2.4.10.1.1 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13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	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	160,397,262.14	22.66%	139,500,850.21	42.78%

#### 6.2.4.10.1.2 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13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 限公司	0.00	0.00%	88,181.00	0.17%

#### 6.2.4.10.1.3 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13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	146,169.59	22.39%	146,169.59	22.39%
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	127,127.52	42.47%	87,640.08	33.73%

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 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 13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	5,736,888.00	6,806,241.28
其中：支付销售机构的客户维护费	1,238,927.13	1,495,393.14

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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 × 1.20% / 当年天数。

#### 6.2.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月13日	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	956,147.98	1,134,373.57

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 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.2.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.3.1 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

份额单位：份

关联方名称	本期末2022年6月13日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰君安证券股份有限公司	19,626,438.51	1.99%	19,626,438.51	1.99%

##### 6.2.4.10.4 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	
	2022年1月1日至2022年6月13日		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	1,732,877,671.78	155,162.70	84,283,961.65	159,462.50

##### 6.2.4.10.5 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13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	5,262.00	437,819.18
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

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本报告期内无利润分配情况。

#### 6.2.4.12 期末(2022年6月13日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 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

6.2.4.12.1.1 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
688171	纬德信息	2022-01-20	1-6个月	新股限售	28.68	22.54	2,821.00	80,906.28	63,585.34	-

			(含)							
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月(含)	新股限售	76.56	51.66	640.00	48,998.40	33,062.40	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	1-6个月(含)	新股限售	116.88	70.23	462.00	53,998.56	32,446.26	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股限售	72.77	65.69	427.00	46,671.10	28,049.63	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6个月(含)	新股限售	96.90	95.65	288.00	27,836.80	27,547.20	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股限售	72.69	65.92	353.00	25,659.57	23,269.76	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月(含)	新股限售	56.88	41.04	490.00	27,871.20	20,109.60	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股限售	50.31	65.37	301.00	15,143.31	19,676.37	-
301096	百诚医药	2021-12-13	1-6个月(含)	新股限售	79.60	69.64	272.00	21,651.20	18,942.08	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股限售	55.57	28.65	614.00	34,119.98	17,591.10	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	8.05	8.99	1,831.00	14,739.55	16,460.69	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月(含)	新股限售	37.23	24.91	656.00	24,422.88	16,340.96	-
301166	优宁维	2021-12-21	1-6个月(含)	新股限售	86.06	57.67	253.00	21,773.18	14,590.51	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	32.69	28.68	507.00	16,575.00	14,540.76	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	1-6个月(含)	新股限售	46.80	55.15	262.00	12,261.60	14,449.30	-
30123	华康	2022-	1-6个月	新股	39.30	33.35	418.00	16,427	13,940	-

5	医疗	01-21	月 (含)	限售				.40	.30	
30118 9	奥尼 电子	2021- 12-21	1-6个 月 (含)	新股 限售	66.18	31.78	435.00	28,788 .30	13,824 .30	-
30126 3	泰恩 康	2022- 03-22	1-6个 月 (含)	新股 限售	19.93	19.95	682.00	13,592 .26	13,605 .90	-
30119 0	善水 科技	2021- 12-17	1-6个 月 (含)	新股 限售	27.85	23.26	575.00	16,013 .75	13,374 .50	-
30113 0	西点 药业	2022- 02-16	1-6个 月 (含)	新股 限售	22.55	37.31	237.00	5,344. 35	8,842. 47	-
30113 8	华研 精机	2021- 12-08	1-6个 月 (含)	新股 限售	26.17	29.33	285.00	7,458. 45	8,359. 05	-
30122 8	实朴 检测	2022- 01-21	1-6个 月 (含)	新股 限售	20.08	20.43	373.00	7,489. 84	7,620. 39	-

#### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.2.4.12.3.1 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。

##### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所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。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

##### 6.2.4.13.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **6.2.4.13.2 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。

##### **6.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、短期融资券、政策性金融债。

##### **6.2.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **6.2.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资**

未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.2.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.2.4.13.2.5 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.2.4.13.3 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于约定开放日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。

##### 6.2.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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。

#### 6.2.4.13.4 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。

##### 6.2.4.13.4.1 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、存出保证金和债券投资等，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。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 13日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	866,438,835.89	-	-	-	866,438,835.89
结算备付金	1,890.57	-	-	-	1,890.57
存出保证金	136,386.17	-	-	-	136,386.17
交易性金融资产	241,136.76	-	-	171,019,369.02	171,260,505.78
应收清算款	-	-	-	-	-
资产总计	866,818,249.39	-	-	171,019,369.02	1,037,837,618.41

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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	443,038.98	443,038.98
应付托管费	-	-	-	73,839.84	73,839.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13,401.19	13,401.19
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	876,867.81	876,867.81
负债总计	-	-	-	1,407,147.82	1,407,147.82
利率敏感度缺口	866,818,249.39	-	-	169,612,221.20	1,036,430,470.59
上年度末 2021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	25,530,954.50	-	-	-	25,530,954.50
结算备付金	504,261.34	-	-	-	504,261.34
存出保证金	148,575.62	-	-	-	148,575.62
交易性金融资产	446,375,000.00	171,536,000.00	-	512,669,539.22	1,130,580,539.22
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	8,511,119.66	8,511,119.66
资产总计	472,558,791.46	171,536,000.00	-	521,180,658.88	1,165,275,450.34
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,196,185.44	1,196,185.44
应付托管费	-	-	-	199,364.26	199,364.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	56,972.84	56,972.84
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,113,878.69	1,113,878.69
负债总计	-	-	-	2,566,401.23	2,566,401.23
利率敏感度缺口	472,558,791.46	171,536,000.00	-	518,614,257.65	1,162,709,049.11

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月13日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	-	1,134,329.10
	市场利率上升25个基点	-	-1,129,848.96

注：于2022年6月13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0.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.2.4.13.4.2 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。

#### 6.2.4.13.4.3 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，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。本基金股票资产投资比例为基金资产的0%-100%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

#### 6.2.4.13.4.3.1 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13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	171,019,369.02	16.50	512,669,539.22	44.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	171,019,369.02	16.50	512,669,539.22	44.09

#### 6.2.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2022年6月13日	上年度末 2021年12月31日

	业绩比较基准上升 5%	48,900,000.00	31,030,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-48,900,000.00	-31,030,000.00

## 6.2.5 公允价值

### 6.2.5.1 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。

### 6.2.5.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.2.5.2.1 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 2022年1月1日至2022年6月13日	上期末 2021年12月31日
第一层次	170,820,276.91	507,529,864.26
第二层次	-	617,916,504.49
第三层次	440,228.87	5,134,170.47
合计	171,260,505.78	1,130,580,539.22

#### 6.2.5.2.2 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。

### 6.2.5.3 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。

### 6.2.5.4 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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年6月14日-2022年6月30日）

#### 7.1.1 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	197,910,512.63	32.88
	其中：股票	197,910,512.63	32.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,272,124.25	0.88
	其中：债券	5,272,124.25	0.88
	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	220,020,112.27	36.55
	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	178,570,783.24	29.67
8	其他各项资产	164,267.46	0.03
9	合计	601,937,799.85	100.00

#### 7.1.2 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	-	-
C	制造业	185,461,321.49	33.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	717,500.00	0.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	55,681.56	0.01

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,300,617.40	1.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,182,915.36	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	8,951.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,609,733.78	0.47
R	文化、体育和娱乐业	573,792.00	0.10
S	综合	-	-
T	合计	197,910,512.63	35.86

### 7.1.3 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	300750	宁德时代	37,400	19,971,600.00	3.62
2	300782	卓胜微	112,360	15,168,600.00	2.75
3	300274	阳光电源	142,300	13,980,975.00	2.53
4	600438	通威股份	219,500	13,139,270.00	2.38
5	600366	宁波韵升	1,006,400	12,680,640.00	2.30
6	300014	亿纬锂能	98,165	9,571,087.50	1.73
7	002460	赣锋锂业	58,365	8,678,875.50	1.57
8	603986	兆易创新	59,500	8,461,495.00	1.53
9	002475	立讯精密	181,300	6,126,127.00	1.11
10	688153	唯捷创芯	112,052	5,714,652.00	1.04
11	688297	中无人机	105,192	5,594,110.56	1.01
12	002709	天赐材料	87,800	5,448,868.00	0.99
13	600884	杉杉股份	179,600	5,337,712.00	0.97
14	688003	天准科技	156,010	5,148,330.00	0.93
15	300327	中颖电子	101,920	5,076,635.20	0.92
16	300613	富瀚微	56,598	4,799,510.40	0.87
17	002938	鹏鼎控股	145,300	4,389,513.00	0.80
18	688301	奕瑞科技	8,870	4,195,864.80	0.76
19	002371	北方华创	15,100	4,184,512.00	0.76
20	601689	拓普集团	57,400	3,927,882.00	0.71
21	002236	大华股份	233,100	3,827,502.00	0.69

22	688162	巨一科技	52,149	2,973,014.49	0.54
23	603501	韦尔股份	15,800	2,733,874.00	0.50
24	002008	大族激光	80,100	2,653,713.00	0.48
25	002410	广联达	44,500	2,422,580.00	0.44
26	600563	法拉电子	11,000	2,256,760.00	0.41
27	300035	中科电气	59,400	1,660,230.00	0.30
28	688608	恒玄科技	10,949	1,506,582.40	0.27
29	600763	通策医疗	7,200	1,255,968.00	0.23
30	300015	爱尔眼科	26,408	1,182,286.16	0.21
31	300604	长川科技	24,220	1,093,533.00	0.20
32	300316	晶盛机电	13,800	932,742.00	0.17
33	002001	新和成	38,544	879,188.64	0.16
34	002353	杰瑞股份	20,900	842,270.00	0.15
35	002597	金禾实业	18,500	801,605.00	0.15
36	300012	华测检测	34,000	789,140.00	0.14
37	603690	至纯科技	18,700	753,610.00	0.14
38	688029	南微医学	8,368	729,689.60	0.13
39	600021	上海电力	70,000	717,500.00	0.13
40	002595	豪迈科技	31,500	703,710.00	0.13
41	000739	普洛药业	32,300	666,672.00	0.12
42	688261	东微半导	2,645	639,984.20	0.12
43	300413	芒果超媒	17,200	573,792.00	0.10
44	688107	安路科技	7,821	537,302.70	0.10
45	300747	锐科激光	13,725	533,902.50	0.10
46	002690	美亚光电	17,420	377,665.60	0.07
47	688105	诺唯赞	4,362	370,333.80	0.07
48	301200	大族数控	6,396	344,052.80	0.06
49	301219	腾远钴业	2,880	265,000.32	0.05
50	688306	均普智能	47,094	260,429.82	0.05
51	301256	华融化学	18,308	196,408.08	0.04
52	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.03
53	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.02
54	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.02
55	688288	鸿泉物联	3,429	77,804.01	0.01
56	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.01
57	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.01
58	301177	迪阿股份	462	34,280.40	0.01
59	301206	三元生物	641	29,287.29	0.01
60	301207	华兰疫苗	490	27,645.80	0.01
61	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
62	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
63	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00

64	300834	星辉环材	614	18,438.42	0.00
65	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
66	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
67	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
68	601012	隆基绿能	189	12,593.07	0.00
69	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
70	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
71	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
72	603456	九洲药业	96	4,963.20	0.00
73	002466	天齐锂业	12	1,497.60	0.00
74	300996	普联软件	1	29.55	0.00

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002415 SZ	海康威视	29,790,154.34	5.40
2	688008 SH	澜起科技	19,259,996.48	3.49
3	688153 SH	唯捷创芯	18,275,032.95	3.31
4	300760 SZ	迈瑞医疗	16,649,816.00	3.02
5	603688 SH	石英股份	16,248,363.00	2.94
6	688039 SH	当虹科技	14,769,581.58	2.68
7	300274 SZ	阳光电源	13,901,152.49	2.52
8	603259 SH	药明康德	13,046,357.90	2.36
9	300327 SZ	中颖电子	13,031,489.44	2.36
10	600366 SH	宁波韵升	12,850,346.00	2.33
11	300782 SZ	卓胜微	10,872,940.11	1.97
12	603986 SH	兆易创新	10,789,632.72	1.95
13	600438 SH	通威股份	10,539,690.28	1.91
14	688036 SH	传音控股	10,385,123.22	1.88
15	601012 SH	隆基绿能	9,089,409.20	1.65
16	688122 SH	西部超导	8,949,878.04	1.62
17	002475 SZ	立讯精密	6,384,136.00	1.16
18	600884 SH	杉杉股份	5,744,862.10	1.04
19	002709 SZ	天赐材料	5,695,096.00	1.03
20	688297 SH	中无人机	5,692,476.86	1.03

##### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例（%）
1	002415 SZ	海康威视	32,029,899.03	5.80
2	300750 SZ	宁德时代	28,317,859.62	5.13
3	002049 SZ	紫光国微	25,231,229.00	4.57
4	603259 SH	药明康德	23,956,260.00	4.34
5	688008 SH	澜起科技	19,306,258.68	3.50
6	300760 SZ	迈瑞医疗	18,917,025.00	3.43
7	002594 SZ	比亚迪	18,815,341.94	3.41
8	688122 SH	西部超导	18,533,454.67	3.36
9	300363 SZ	博腾股份	18,389,305.26	3.33
10	603606 SH	东方电缆	17,361,716.05	3.15
11	601012 SH	隆基绿能	17,159,070.86	3.11
12	002371 SZ	北方华创	16,280,337.00	2.95
13	300327 SZ	中颖电子	15,487,964.24	2.81
14	603688 SH	石英股份	15,106,568.00	2.74
15	002241 SZ	歌尔股份	13,954,613.00	2.53
16	002475 SZ	立讯精密	13,613,517.70	2.47
17	688036 SH	传音控股	13,317,045.48	2.41
18	688039 SH	当虹科技	12,258,156.24	2.22
19	688153 SH	唯捷创芯	12,206,577.11	2.21
20	002916 SZ	深南电路	10,555,403.00	1.91

#### 7.1.4.3 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	58,950,242.15
卖出股票的收入（成交）总额	40,898,643.03

#### 7.1.5 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	5,014,143.56	0.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	257,980.69	0.05
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	5,272,124.25	0.96

### 7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	163516	20 北控 02	50,000	5,014,143.56	0.91
2	113053	隆 22 转债	1,870	257,980.69	0.05

### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.1.8 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投资。

### 7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。



### 7.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.1.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.2 市场中性策略执行情况

### 7.2.1 投资组合报告附注

7.2.1.1 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。

7.2.1.2 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。

### 7.2.1.3 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	135,956.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,310.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	164,267.46

### 7.2.1.4 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。

### 7.2.1.5 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投资中不存在流通受限情况。

## 7.3 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2022年1月1日-2022年6月13日）

### 7.3.1 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	171,019,369.02	16.48
	其中：股票	171,019,369.02	16.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	241,136.76	0.02
	其中：债券	241,136.76	0.02
	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	866,440,726.46	83.49
8	其他各项资产	136,386.17	0.01
9	合计	1,037,837,618.41	100.00

### 7.3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.3.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	154,805,807.26	14.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	672,700.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	60,642.67	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,544,097.20	1.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,166,179.81	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	8,169.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	2,156,504.48	0.21
R	文化、体育和娱乐业	605,268.00	0.06
S	综合	-	-
T	合计	171,019,369.02	16.50

### 7.3.3 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	300750	宁德时代	37,400	16,569,322.00	1.60
2	002594	比亚迪	45,400	15,835,520.00	1.53
3	300782	卓胜微	67,600	12,837,240.00	1.24
4	300014	亿纬锂能	109,065	10,860,692.70	1.05
5	688153	唯捷创芯	174,814	8,861,321.66	0.85
6	002460	赣锋锂业	58,365	7,996,005.00	0.77
7	603986	兆易创新	59,500	7,954,555.00	0.77
8	300327	中颖电子	145,620	7,623,207.00	0.74
9	600438	通威股份	123,600	6,622,488.00	0.64
10	002475	立讯精密	181,300	6,046,355.00	0.58
11	603501	韦尔股份	32,300	5,240,998.00	0.51
12	002236	大华股份	333,000	5,178,150.00	0.50
13	600570	恒生电子	113,540	4,770,950.80	0.46
14	300613	富瀚微	70,798	4,351,953.06	0.42
15	002938	鹏鼎控股	145,300	4,194,811.00	0.40
16	002371	北方华创	15,100	4,002,104.00	0.39
17	600893	航发动力	90,500	3,753,940.00	0.36
18	688301	奕瑞科技	8,870	3,698,790.00	0.36
19	601689	拓普集团	57,400	3,604,720.00	0.35
20	002409	雅克科技	56,600	3,101,680.00	0.30
21	688162	巨一科技	52,149	2,880,710.76	0.28
22	002008	大族激光	80,100	2,495,115.00	0.24
23	002410	广联达	44,500	2,322,900.00	0.22
24	002025	航天电器	33,000	2,297,790.00	0.22
25	688608	恒玄科技	10,949	1,768,263.50	0.17
26	300604	长川科技	24,220	1,068,344.20	0.10
27	600763	通策医疗	7,200	1,026,000.00	0.10
28	300015	爱尔眼科	26,408	973,662.96	0.09
29	002353	杰瑞股份	20,900	925,870.00	0.09
30	002001	新和成	38,544	857,218.56	0.08
31	300316	晶盛机电	13,800	825,792.00	0.08

32	300012	华测检测	34,000	763,980.00	0.07
33	002597	金禾实业	18,500	754,800.00	0.07
34	603690	至纯科技	18,700	716,397.00	0.07
35	000739	普洛药业	32,300	689,282.00	0.07
36	688029	南微医学	8,368	677,975.36	0.07
37	600021	上海电力	70,000	672,700.00	0.06
38	300628	亿联网络	8,600	663,662.00	0.06
39	002595	豪迈科技	31,500	654,255.00	0.06
40	688261	东微半导	2,645	651,701.55	0.06
41	300413	芒果超媒	17,200	605,268.00	0.06
42	688107	安路科技	7,821	479,583.72	0.05
43	300747	锐科激光	13,725	459,375.75	0.04
44	688105	诺唯赞	4,362	361,697.04	0.03
45	301200	大族数控	6,396	346,419.04	0.03
46	002690	美亚光电	17,420	336,206.00	0.03
47	301219	腾远钴业	2,880	292,864.32	0.03
48	688306	均普智能	47,094	257,133.24	0.02
49	301256	华融化学	18,308	191,940.74	0.02
50	301103	何氏眼科	5,065	156,841.52	0.02
51	688267	中触媒	3,390	127,464.00	0.01
52	688115	思林杰	2,153	83,148.86	0.01
53	688288	鸿泉物联	3,429	78,867.00	0.01
54	688171	纬德信息	2,821	63,585.34	0.01
55	688071	华依科技	1,101	40,902.15	0.00
56	301177	迪阿股份	462	32,446.26	0.00
57	301206	三元生物	427	28,049.63	0.00
58	301201	诚达药业	353	23,269.76	0.00
59	688039	当虹科技	553	20,234.27	0.00
60	301207	华兰疫苗	490	20,109.60	0.00
61	301122	采纳股份	301	19,676.37	0.00
62	301096	百诚医药	272	18,942.08	0.00
63	300834	星辉环材	614	17,591.10	0.00
64	301123	奕东电子	656	16,340.96	0.00
65	301166	优宁维	253	14,590.51	0.00
66	301117	佳缘科技	262	14,449.30	0.00
67	301235	华康医疗	418	13,940.30	0.00
68	301189	奥尼电子	435	13,824.30	0.00
69	301263	泰恩康	682	13,605.90	0.00
70	301190	善水科技	575	13,374.50	0.00
71	601012	隆基绿能	189	11,479.86	0.00
72	301130	西点药业	237	8,842.47	0.00
73	301138	华研精机	285	8,359.05	0.00

74	301199	迈赫股份	402	8,200.80	0.00
75	300774	倍杰特	444	8,169.60	0.00
76	301193	家联科技	297	7,814.07	0.00
77	301228	实朴检测	373	7,620.39	0.00
78	603456	九洲药业	96	4,479.36	0.00
79	002466	天齐锂业	12	1,414.32	0.00
80	300996	普联软件	1	24.43	0.00

### 7.3.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.3.4.1 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	002415	海康威视	29,790,154.34	2.56
2	688008	澜起科技	19,259,996.48	1.66
3	688153	唯捷创芯	18,275,032.95	1.57
4	300760	迈瑞医疗	16,649,816.00	1.43
5	603688	石英股份	16,248,363.00	1.40
6	688039	当虹科技	14,769,581.58	1.27
7	603259	药明康德	13,046,357.90	1.12
8	300327	中颖电子	13,031,489.44	1.12
9	603986	兆易创新	10,789,632.72	0.93
10	688036	传音控股	10,385,123.22	0.89
11	300782	卓胜微	10,319,096.04	0.89
12	601012	隆基绿能	9,089,409.20	0.78
13	688122	西部超导	8,949,878.04	0.77
14	002475	立讯精密	6,384,136.00	0.55
15	688301	奕瑞科技	5,438,701.13	0.47
16	002236	大华股份	5,124,914.85	0.44
17	002241	歌尔股份	5,077,672.18	0.44
18	300014	亿纬锂能	4,996,517.00	0.43
19	600438	通威股份	4,995,173.28	0.43
20	002008	大族激光	3,880,116.00	0.33

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。

#### 7.3.4.2 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	002415	海康威视	32,029,899.03	2.75

2	300750	宁德时代	28,317,859.62	2.44
3	002049	紫光国微	25,231,229.00	2.17
4	603259	药明康德	23,956,260.00	2.06
5	688008	澜起科技	19,306,258.68	1.66
6	300760	迈瑞医疗	18,917,025.00	1.63
7	688122	西部超导	18,533,454.67	1.59
8	300363	博腾股份	18,389,305.26	1.58
9	603606	东方电缆	17,361,716.05	1.49
10	601012	隆基绿能	17,159,070.86	1.48
11	002371	北方华创	16,280,337.00	1.40
12	603688	石英股份	15,106,568.00	1.30
13	002241	歌尔股份	13,954,613.00	1.20
14	002475	立讯精密	13,613,517.70	1.17
15	688036	传音控股	13,317,045.48	1.15
16	300327	中颖电子	13,305,428.84	1.14
17	688039	当虹科技	12,236,196.61	1.05
18	002916	深南电路	10,555,403.00	0.91
19	002013	中航机电	9,749,903.00	0.84
20	688153	唯捷创芯	9,106,050.85	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。

### 7.3.4.3 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	250,604,703.20
卖出股票的收入（成交）总额	463,884,239.39

注：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。

### 7.3.5 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	241,136.76	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	241,136.76	0.02

### 7.3.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113053	隆 22 转债	1,870	241,136.76	0.02

### 7.3.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.3.8 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投资。

### 7.3.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.3.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.3.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.3.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 7.3.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.3.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 7.3.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.3.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 7.4 市场中性策略执行情况

#### 7.4.1 投资组合报告附注

7.4.1.1 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。

7.4.1.2 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。

#### 7.4.1.3 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	136,386.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,386.17

#### 7.4.1.4 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。

#### 7.4.1.5 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投资中不存在流通受限情况。



## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年6月14日-2022年6月30日）

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
60,078	8,617.93	54,956,224.45	10.61%	462,791,560.53	89.39%

#### 8.1.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	23,130,283.00	19.03%
2	国投泰康信托有限公司—国投飞天·财富宝证券投资集合资金信托计划	5,343,724.00	4.40%
3	张远勇	4,504,400.00	3.71%
4	何树红	3,847,154.00	3.16%
5	龚晖	2,759,573.00	2.27%
6	吕华	1,930,100.00	1.59%
7	夏凤文	1,844,177.00	1.52%
8	厦门鑫然能源开发有限公司	1,500,000.00	1.23%
9	张能鸿	1,359,122.00	1.12%
10	宁波万坤投资管理合伙企业（有限合伙）—万坤东方点睛8号多策略灵活配置私募证券	1,280,016.00	1.05%

#### 8.1.3 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	130,783.19	0.03%

### 8.1.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

## 8.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2022年1月1日-2022年6月13日）

### 8.2.1 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
77,553	12,746.96	181,059,926.45	18.32%	807,505,355.04	81.68%

### 8.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈鸣宇	41,102,163.00	12.73%
2	上海铂绅投资中心（有限 合伙）—铂绅十三号证券 投资私募基金	26,074,803.00	8.07%
3	中国人寿保险股份有限公司	24,660,198.00	7.64%
4	陈绪潇	8,498,344.00	2.63%
5	杨巧伟	7,948,137.00	2.46%
6	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽夏天量化套利2 号私募证券投资基金	6,077,047.00	1.88%
7	周杰杰	5,689,119.00	1.76%
8	国投泰康信托有限公司— 国投飞天·财富宝证券投资 集合资金信托计划	5,343,724.00	1.65%

9	陈建燕	5,207,286.00	1.61%
10	张远勇	4,735,000.00	1.47%

### 8.2.3 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	130,787.06	0.01%

### 8.2.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：本公司高级管理人员、基金投资和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

### 9.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年6月14日-2022年6月30日）

单位：份

基金合同生效日（2022年6月14日）基金份额总额	988,565,281.49
本报告期期初基金份额总额	988,565,281.49
本报告期基金总申购份额	546,612.32
减：本报告期基金总赎回份额	471,364,108.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	517,747,784.98

### 9.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2022年1月1日-2022年6月13日）

单位：份

基金合同生效日（2019年6月11日）基金份额总额	988,565,281.49
本报告期期初基金份额总额	988,565,281.49
本报告期基金总申购份额	-

减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	988,565,281.49

## 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年6月14日-2022年6月30日）

10.8.1.1 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	
国泰君安证券	2	25,401,000.21	25.44%	23,402.17	25.30%	-
方正证券	3	23,479,549.49	23.52%	21,631.81	23.39%	-
长江证券	2	20,553,548.66	20.58%	19,141.68	20.69%	-
国盛证券	1	18,913,118.00	18.94%	17,613.52	19.04%	-
中金公司	1	9,700,501.00	9.72%	9,034.54	9.77%	-
中信建投	2	1,801,167.82	1.80%	1,677.54	1.81%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	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。

### 10.8.1.2 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

国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	125,000,000.00	11.36%	-	-
国盛证券	5,002,685.89	100.00 %	80,000,000.00	7.27%	-	-
中金公司	-	-	280,000,000.00	25.45%	-	-
中信建投	-	-	615,000,000.00	55.91%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2022年1月1日-2022年6月13日)

### 10.8.2.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
国泰君安证券	2	160,397,262.14	22.66%	0.22	-	-
中信建投	2	127,375,927.20	18.00%	0.18	-	-
天风证券	2	126,776,451.61	17.91%	0.18	-	-
中金公司	1	115,491,662.30	16.32%	0.16	-	-
方正证券	3	78,497,567.08	11.09%	0.11	-	-
国盛证券	1	52,104,213.35	7.36%	0.07	-	-
中泰证券	1	23,920,187.24	3.38%	0.03	-	-
长江证券	2	12,984,574.31	1.83%	0.02	-	-
广发证券	1	10,288,307.01	1.45%	0.01	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	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，最大限度地调动物体资源，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。

### 10.8.2.2 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	62,271,827.40	60.62%	-	-	-	-
天风证券	30,194,560.27	29.40%	-	-	-	-

国盛证券	10,251,731.50	9.98%	-	-	-	-
------	---------------	-------	---	---	---	---

## 10.9 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公司固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
3	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
4	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
5	关于华安智联混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-06-11
6	华安智联混合型证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-06-11
7	华安智联混合型证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-06-11
8	华安智联混合型证券投资基金（LOF）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	2022-06-14
9	华安智联混合型证券投资基金（LOF）招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-06-14

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 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

#### 11.1.1 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。

### 11.2 华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

#### 11.2.1 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、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 5、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 6、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 7、中国证监会批准华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 8、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；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 10、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 11、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