

**华安大中华升级股票型证券投资基金**  
**2020 年中期报告**  
**2020 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	36
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	47
7.7 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	47
7.8 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	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	47
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	47
7.11 投资组合报告附注	47
<b>8 基金份额持有人信息</b>	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
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 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>11 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
11.1 备查文件目录 .....	57
11.2 存放地点 .....	57
11.3 查阅方式 .....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安大中华升级股票型证券投资基金
基金简称	华安大中华升级股票（QDII）
基金主代码	040021
交易代码	040021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 17 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,021,352.67 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金以价值和成长投资理念为导向，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。</p> <p>行业层面以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索。通过对于经济结构调整的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标。</p> <p>个股方面通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究，考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘受益于中国地区经济升级，并具备中长期持续增长或阶段性高速增长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。</p>
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险品种。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛珍	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66594319
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京西城区复兴门内大街1号

	世纪大道8号国金中心二期31 -32层	
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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	朱学华	刘连舸

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

## 2.5 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	基金管理人的办公场所及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	-3,105,742.32
本期利润	-514,766.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0112
本期加权平均净值利润率	-0.84%
本期基金份额净值增长率	-0.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-2,671,344.98

期末可供分配基金份额利润	-0.0636
期末基金资产净值	59,263,699.55
期末基金份额净值	1.410
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	41.00%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.85%	1.21%	7.87%	1.12%	2.98%	0.09%
过去三个月	16.63%	1.34%	14.50%	1.31%	2.13%	0.03%
过去六个月	-0.14%	1.96%	0.78%	1.77%	-0.92%	0.19%
过去一年	10.68%	1.51%	10.59%	1.37%	0.09%	0.14%
过去三年	3.22%	1.39%	19.84%	1.18%	-16.62%	0.21%
自基金合同生效起至今	41.00%	1.31%	43.48%	1.12%	-2.48%	0.19%

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

华安大中华升级股票型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2011年5月17日至2020年6月30日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		



翁启森	本基金的基金经理，副总经理，首席投资官	2011-05-17	-	25 年	工业工程学硕士，25 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2014 年 3 月至 2016 年 9 月同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015 年 2 月至 2016 年 9 月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任公司总经理助理。2015 年 3 月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部副总监	2011-05-17	-	16 年	博士研究生，16 年证券、基金从业经历，持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司

				<p>司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2016年9月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年3月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年2月同时担任华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016年6月至2018年2月同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017年2月至2019年8月，同时担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月至2018年9月，同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月至2019年8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。2017年8月至2019年8月，担任华安大安全主题灵活配置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CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经</p>
--	--	--	--	---

					理。
--	--	--	--	--	----

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，在经历了全球新冠疫情导致的经济衰退和全球流动性危机，叠加石油价格战，引发全球风险资产大幅杀跌后，在泛滥的流动性和宏观复苏预期的支撑下，风险资产价格出现快速反弹，呈现 V 型走势。

期内，标普 500 指数下跌 2.63%，斯托克 50 指数下跌 12.27%，MSCI 新兴市场指数下跌 9.42%，沪深 300 上涨 1.64%，香港市场，由于国安法事件，市场出现震荡，期内恒生指数下跌 11.64%，恒生国企指数下跌 10.90%，台股期内下跌 0.56%。

在报告期内，基于我们对于疫情后中美两大经济体复苏路径的判断，我们看好业绩受益美国消

费复苏的出口类股，以及受益于中国基建投资的周期类股。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.410 元，本报告期份额净值增长率为-0.14%，同期业绩比较基准增长率为 0.78%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2020 年港股，我们认为结构性行情将持续。流动性的宽松和环比复苏的宏观基本面，是年初以来港股结构性行情的两大基本因素，目前来看，并未发生逆转。中国流动性在边际收紧，已经过了最宽松的时候，但是出于打击资金空转目的，而非转向，外围虽然宽松的加速度在下行，但宽松的方向未变；北京疫情二次爆发，和美国部分州疫情恶化，我们认为不会导致经济重回停滞，宏观环比复苏的预期不变。叠加港股估值仍处于较低位置，我们认为后期港股存在估值修复行情。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值不存在连续超过 20 个工作日低于 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安大中华升级股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安大中华升级股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,343,345.24	4,081,453.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	56,061,955.87	68,747,827.70
其中：股票投资		56,061,955.87	68,747,827.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		618,601.63	210,155.91
应收利息	6.4.7.5	168.61	290.92
应收股利		396,207.95	34,453.94
应收申购款		161,069.19	16,411.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>60,581,348.49</b>	<b>73,090,593.21</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,153,722.32	345,662.69
应付管理人报酬		72,689.29	90,918.75
应付托管费		14,537.84	18,183.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	76,699.49	149,310.90
<b>负债合计</b>		<b>1,317,648.94</b>	<b>604,076.05</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.8	42,021,352.67	51,330,402.84
未分配利润	6.4.7.9	17,242,346.88	21,156,114.32
<b>所有者权益合计</b>		<b>59,263,699.55</b>	<b>72,486,517.16</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>60,581,348.49</b>	<b>73,090,593.21</b>

## 6.2 利润表

会计主体：华安大中华升级股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>168,618.49</b>	<b>6,891,122.73</b>
1.利息收入		3,456.33	3,065.91
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,456.33	3,065.91
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,460,655.79	-373,305.97
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-3,152,738.21	-1,366,383.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	85,025.74
股利收益	6.4.7.12	692,082.42	908,051.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	2,590,976.10	7,297,358.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		29,161.40	-39,375.44
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	5,680.45	3,379.26
<b>减：二、费用</b>		<b>683,384.71</b>	<b>831,732.31</b>
1. 管理人报酬		460,101.57	594,439.98
2. 托管费		92,020.27	118,888.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	32,551.82	35,877.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.16	98,711.05	82,527.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-514,766.22</b>	<b>6,059,390.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-514,766.22</b>	<b>6,059,390.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安大中华升级股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元



项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	51,330,402.84	21,156,114.32	72,486,517.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-514,766.22	-514,766.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,309,050.17	-3,399,001.22	-12,708,051.39
其中：1.基金申购款	3,317,667.58	1,052,391.26	4,370,058.84
2.基金赎回款	-12,626,717.75	-4,451,392.48	-17,078,110.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	42,021,352.67	17,242,346.88	59,263,699.55
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	63,880,933.48	11,922,142.89	75,803,076.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,059,390.42	6,059,390.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,495,577.61	-1,990,762.30	-7,486,339.91
其中：1.基金申购款	1,675,667.20	491,240.96	2,166,908.16
2.基金赎回款	-7,171,244.81	-2,482,003.26	-9,653,248.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	58,385,355.87	15,990,771.01	74,376,126.88

注：报告附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安大中华升级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]第 328 号《关于核准华安大中华升级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《华安大中华升级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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 434,522,995.91 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 178 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 434,578,142.49 份基金份额,其中认购资金利息折合 55,146.58 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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为大中华地区企业,包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场(如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场)发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于东亚及东盟区域市场,包括韩国、印尼、马来西亚、菲律宾、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等;投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票资产不低于基金资产的 60%,其中不低于 85%的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业,不高于 15%的股票资产投资于东亚及东盟区域市场;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:MSCI 金龙净总收益指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2020 年 8 月 25 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安大中华升级股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 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的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,343,345.24
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,343,345.24

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	63,340,375.63	56,061,955.87	-7,278,419.76
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	63,340,375.63	56,061,955.87	-7,278,419.76
----	---------------	---------------	---------------

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	168.61
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	168.61

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,114.89
应付证券出借违约金	-
预提费用	75,584.60
合计	76,699.49

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,330,402.84	51,330,402.84
本期申购	3,317,667.58	3,317,667.58
本期赎回（以“-”号填列）	-12,626,717.75	-12,626,717.75
本期末	42,021,352.67	42,021,352.67

#### 6.4.7.9 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	165.95	21,155,948.37	21,156,114.32
本期利润	-3,105,742.32	2,590,976.10	-514,766.22
本期基金份额交易产生的变动数	434,231.39	-3,833,232.61	-3,399,001.22
其中：基金申购款	-205,828.18	1,258,219.44	1,052,391.26
基金赎回款	640,059.57	-5,091,452.05	-4,451,392.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,671,344.98	19,913,691.86	17,242,346.88

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	-
其他	1.29
合计	3,456.33

#### 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	18,022,196.69
买卖股票差价收入	-3,152,738.21

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	692,082.42
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	692,082.42

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	2,590,976.10
——股票投资	2,590,976.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	2,590,976.10

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,680.45
合计	5,680.45

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	32,551.82
银行间市场交易费用	-
合计	32,551.82

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,272.71
其他费用	21,853.74
合计	98,711.05

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易



**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	460,101.57	594,439.98
其中：支付销售机构的客户维护费	218,863.71	280,522.65

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 1.5%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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	92,020.27	118,888.04

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.3%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×0.3% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中银香港	1,852,843.37	-	6,653,037.04	-
中国银行	1,490,501.87	3,455.04	717,235.31	3,061.41

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

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

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
1219 HK	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	2018-08-13	重大事项停牌	0.35	-	-	115,000.00	291,091.26	39,917.33	-
1322 HK	CW GROU	2018-07-11	重大事项停牌	0.21	-	-	618,500.00	1,891,237.05	130,506.37	-

	P HOLDI NGS LTD									
1509 HK	HARM ONICA RE MEDI CAL HOLDI NGS	2019-04 -01	重大事 项停牌	1.86	-	-	157,000.00	771,576.97	292,556.56	-

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险品种。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过

特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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时间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%。本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 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只境外基金不得超过该境外基金总份额的 20%。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%。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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资产净值的 10%。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 10%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每

个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金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 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,343,345.24	-	-	-	3,343,345.24
交易性金融资产	-	-	-	56,061,955.87	56,061,955.87
应收证券清算款	-	-	-	618,601.63	618,601.63
应收股利	-	-	-	396,207.95	396,207.95
应收利息	-	-	-	168.61	168.61
应收申购款	-	-	-	161,069.19	161,069.19
资产总计	3,343,345.24	-	-	57,238,003.25	60,581,348.49
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,153,722.32	1,153,722.32
应付管理人报酬	-	-	-	72,689.29	72,689.29
应付托管费	-	-	-	14,537.84	14,537.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	76,699.49	76,699.49
负债总计	-	-	-	1,317,648.94	1,317,648.94
					4

利率敏感度缺口	3,343,345.24	-	-	55,920,354.31	59,263,699.55
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,081,453.17	-	-	-	4,081,453.17
交易性金融资产	-	-	-	68,747,827.70	68,747,827.70
应收证券清算款	-	-	-	210,155.91	210,155.91
应收股利	-	-	-	34,453.94	34,453.94
应收利息	-	-	-	290.92	290.92
应收申购款	-	-	-	16,411.57	16,411.57
资产总计	4,081,453.17	-	-	69,009,140.04	73,090,593.21
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	345,662.69	345,662.69
应付管理人报酬	-	-	-	90,918.75	90,918.75
应付托管费	-	-	-	18,183.71	18,183.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	149,310.90	149,310.90
负债总计	-	-	-	604,076.05	604,076.05
利率敏感度缺口	4,081,453.17	-	-	68,405,063.99	72,486,517.16

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	8,039.91	1,019,022.40	833,448.71	1,860,511.02
交易性金融资产	14,058.19	43,020,454.77	13,027,442.91	56,061,955.87
应收证券清算款	-	310,975.66	307,625.97	618,601.63
应收股利	-	268,809.42	27,915.93	296,725.35
应收利息	0.85	0.06	-	0.91
资产合计	22,098.95	44,619,262.31	14,196,433.52	58,837,794.78
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	22,098.95	44,619,262.31	14,196,433.52	58,837,794.78
项目	上年度末			
	2019年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				



应收利息	3.91	-	-	3.91
应收证券清算款	-	-	210,155.91	210,155.91
银行存款	15,101.17	1,195,002.99	2,156,842.66	3,366,946.82
交易性金融资产	-	52,102,001.47	16,645,826.23	68,747,827.70
应收股利	-	-	34,453.94	34,453.94
资产合计	15,105.08	53,297,004.46	19,047,278.74	72,359,388.28
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	15,105.08	53,297,004.46	19,047,278.74	72,359,388.28

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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：人民币万元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 294	增加约 362
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 294	减少约 362

#### 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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，利用数量模型工具，分析和比较股票、债券等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。同时，本基金将定期，或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整，以保持基金资产配置的有效性。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能

发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 85% 的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 85% 的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业，不高于 15% 的股票资产投资于东亚及东盟区域市场；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%。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,061,955.87	94.60	68,747,827.70	94.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	56,061,955.87	94.60	68,747,827.70	94.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 340	增加约 392
	业绩比较基准下降 5%	减少约 340	减少约 392

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	56,061,955.87	92.54
	其中：普通股	56,047,897.68	92.52
	存托凭证	14,058.19	0.02
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,343,345.24	5.52
8	其他各项资产	1,176,047.38	1.94
9	合计	60,581,348.49	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	43,020,454.77	72.59
中国台湾	13,027,442.91	21.98
美国	14,058.19	0.02
合计	56,061,955.87	94.60

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	22,784,471.21	38.45
医疗保健	6,137,968.76	10.36
非日常生活消费品	6,115,491.37	10.32
通信服务	5,962,247.53	10.06
金融	4,135,353.54	6.98
工业	3,933,528.74	6.64
原材料	2,783,964.16	4.70
公用事业	2,661,289.17	4.49
房地产	711,387.07	1.20
日常消费品	496,856.56	0.84
能源	339,397.76	0.57
合计	56,061,955.87	94.60

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	TENCEN T HOLDIN GS LTD	腾讯控股	700 HK	香港	中国香港	11,400	5,192,029.50	8.76
2	LARGAN PRECISI ON CO LTD	大立光	3008 TT	台湾	中国台湾	5,000	4,893,222.97	8.26
3	SEMICO DUCTO R MANUFA CTURIN G	中芯国际	981 HK	香港	中国香港	180,500	4,451,649.84	7.51
4	TAIWAN SEMICO DUCTO R MANUFA	台积电	2330 TT	台湾	中国台湾	59,000	4,424,144.36	7.47

	C							
5	KINGSO FT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港	中国香港	83,000	2,733,149.50	4.61
6	CHINA EDUCAT ION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	香港	中国香港	185,000	2,105,570.54	3.55
7	CHINA LONGYU AN POWER GROUP- H	龙源电力	916 HK	香港	中国香港	370,000	1,470,181.68	2.48
8	CHINA MERCH ANTS BANK-H	招商银行	3968 HK	香港	中国香港	43,500	1,416,539.92	2.39
9	CITIC SECURIT IES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港	中国香港	101,500	1,359,189.59	2.29
10	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	香港	中国香港	27,500	1,311,243.12	2.21
11	FLEXIU M INTERC ONNECT INC	台郡科技	6269 TT	台湾	中国台湾	41,907	1,219,820.11	2.06
12	CHINA MEDICA L SYSTEM HOLDIN G	康哲药业	867 HK	香港	中国香港	137,000	1,142,539.89	1.93
13	AVICHIN A INDUST RY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港	中国香港	308,000	987,501.72	1.67
14	FIT HON	鸿腾六零	6088 HK	香港	中国香港	356,000	975,553.92	1.65

	TENG LTD	八八精密科技						
15	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	石药集团	1093 HK	香港	中国香港	72,800	973,537.04	1.64
16	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际	354 HK	香港	中国香港	238,000	921,770.57	1.56
17	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	27 HK	香港	中国香港	19,000	915,495.24	1.54
18	CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	中国中药	570 HK	香港	中国香港	244,000	833,568.81	1.41
19	TRAVEL SKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港	中国香港	66,000	822,315.23	1.39
20	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIALS	中国建材	3323 HK	香港	中国香港	109,000	821,410.92	1.39
21	XINJIANG GOLDWIND SCI-H	金风科技	2208 HK	香港	中国香港	133,742	811,177.54	1.37
22	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP	北控水务集团	371 HK	香港	中国香港	264,000	728,267.44	1.23
23	SUNAC CHINA	融创中国	1918 HK	香港	中国香港	24,000	711,387.07	1.20

	HOLDINGS LTD							
24	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	枫叶教育	1317 HK	香港	中国香港	278,000	599,289.72	1.01
25	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	中车时代电气	3898 HK	香港	中国香港	33,300	599,225.77	1.01
26	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港	中国香港	9,000	594,375.41	1.00
27	CUB ELECPARTS INC	为升	2231 TT	台湾	中国台湾	16,182	589,262.39	0.99
28	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	滔搏	6110 HK	香港	中国香港	62,000	560,669.47	0.95
29	LUYE PHARMAGROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港	中国香港	128,000	554,202.32	0.94
30	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	海螺创业	586 HK	香港	中国香港	17,500	522,716.04	0.88
31	CHANJET INFORMATION TECH-H	畅捷通	1588 HK	香港	中国香港	58,800	502,191.04	0.85
32	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件	1297 HK	香港	中国香港	444,600	454,849.27	0.77
33	CIMC	中集安瑞	3899 HK	香港	中国香港	160,000	448,681.73	0.76

	ENRIC HOLDINGS LTD	科						
34	PW MEDTECH GROUP LTD	普华和顺	1358 HK	香港	中国香港	279,000	420,502.10	0.71
35	MEDIATEK INC	联发科	2454 TT	台湾	中国台湾	3,000	416,133.58	0.70
36	DAWN RAYS PHARMACEUTICAL HOLD	东瑞制药	2348 HK	香港	中国香港	498,000	413,952.74	0.70
37	DONGYUE GROUP	东岳集团	189 HK	香港	中国香港	129,000	371,176.34	0.63
38	BEIJING URBAN CONSTRUCTION-H	城建设计	1599 HK	香港	中国香港	201,000	330,482.59	0.56
39	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	中国香港	2,900	328,473.02	0.55
40	SHANGHAI JINJIANG INTL HO-H	锦江资本	2006 HK	香港	中国香港	234,000	292,830.60	0.49
41	HARMONICARE MEDICAL HOLDINGS	和美医疗	1509 HK	香港	中国香港	157,000	292,556.56	0.49
42	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARM-H	白云山	874 HK	香港	中国香港	16,000	285,870.18	0.48
43	WH	万洲国际	288 HK	香港	中国香港	47,000	285,066.36	0.48



	GROUP LTD							
44	SOFT-WORLD INTL CORP	智冠	5478 TT	台湾	中国台湾	10,000	277,901.52	0.47
45	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	中国光大绿色环保	1257 HK	香港	中国香港	99,000	275,813.21	0.47
46	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股	1099 HK	香港	中国香港	14,400	260,966.15	0.44
47	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	中国东方集团	581 HK	香港	中国香港	134,000	258,266.03	0.44
48	SSY GROUP LTD	石四药集团	2005 HK	香港	中国香港	49,448	238,937.56	0.40
49	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	玉山金控	2884 TT	台湾	中国台湾	32,135	214,020.83	0.36
50	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	同方泰德	1206 HK	香港	中国香港	342,000	206,181.68	0.35
51	BEST PACIFIC INTERNATIONAL H	超盈国际控股	2111 HK	香港	中国香港	204,000	204,975.94	0.35
52	CHINA KEPEI EDUCATION GROUP	中国科培	1890 HK	香港	中国香港	34,000	193,795.43	0.33
53	DIGITAL DOMAIN	数字王国	547 HK	香港	中国香港	4,390,000	188,470.08	0.32

	HOLDING S LTD							
54	CSC FINANCIAL CO LTD-H	中信建投	6066 HK	香港	中国香港	23,500	188,255.42	0.32
55	CONCOR D NEW ENERGY GROUP LTD	协合新能 源	182 HK	香港	中国香港	630,000	187,026.84	0.32
56	SINOPEC KANTON S HOLDING S	中石化冠 德	934 HK	香港	中国香港	68,000	184,478.34	0.31
57	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港	中国香港	64,000	171,872.87	0.29
58	PHARM AESSEN TIA CORP	药华医药	6446 TT	台湾	中国台湾	6,000	168,178.34	0.28
59	OBI PHARMA INC	浩鼎	4174 TT	台湾	中国台湾	6,000	166,740.91	0.28
60	HISENSE HOME APPLIAN CES GR-H	海信家电	921 HK	香港	中国香港	19,000	156,198.24	0.26
61	SPT ENERGY GROUP INC	华油能源	1251 HK	香港	中国香港	530,000	154,919.42	0.26
62	SOFTSTA R ENTERT AINMEN T INC	大字资讯	6111 TT	台湾	中国台湾	8,000	154,091.60	0.26
63	GENOVA TE BIOTEC HNOLOG Y CO	健亚	4130 TT	台湾	中国台湾	17,700	151,382.06	0.26

64	TAIMED BIOLOGI CS INC	中裕新药	4147 TT	台湾	中国台湾	7,000	150,593.88	0.25
65	CHINA TAIPING INSURA NCE HOLD	中国太平	966 HK	香港	中国香港	13,200	149,753.01	0.25
66	DIGITAL CHINA HOLDIN GS LTD	神州控股	861 HK	香港	中国香港	32,000	146,442.70	0.25
67	HUATAI SECURIT IES CO LTD-H	华泰证券	6886 HK	香港	中国香港	12,800	144,279.67	0.24
68	CHINA HARMO NY NEW ENERGY AUT	和谐汽车	3836 HK	香港	中国香港	39,500	138,911.39	0.23
69	CHINA TRAVEL INTL INV HK	香港中旅	308 HK	香港	中国香港	134,000	134,641.06	0.23
70	CW GROUP HOLDIN GS LTD	创达科技 控股	1322 HK	香港	中国香港	618,500	130,506.37	0.22
71	GUANGZ HOU AUTOM OBILE GROUP- H	广汽集团	2238 HK	香港	中国香港	23,200	118,462.21	0.20
72	CHINA ELECTR ONICS CORP HOLDI	中电华大 科技	85 HK	香港	中国香港	132,000	107,310.93	0.18
73	CATCHE R TECHNO LOGY CO LTD	可成科技	2474 TT	台湾	中国台湾	2,000	106,369.20	0.18

74	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	上海医药	2607 HK	香港	中国香港	7,100	84,440.22	0.14
75	OURGAME INTERNATIONAL HOLDING	联众	6899 HK	香港	中国香港	167,000	80,848.57	0.14
76	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	富邦金融控股股份有限公司	2881 TT	台湾	中国台湾	6,000	63,102.81	0.11
77	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	中国通号	3969 HK	香港	中国香港	20,000	60,835.10	0.10
78	COGOBUY GROUP	科通芯城	400 HK	香港	中国香港	37,000	45,288.36	0.08
79	CHINA TITANS ENERGY TECHNOLOGY	泰坦能源技术	2188 HK	香港	中国香港	120,000	41,652.86	0.07
80	TENWOW INTERNATIONAL HOLDING	天喔国际	1219 HK	香港	中国香港	115,000	39,917.33	0.07
81	FORGAME HOLDINGS LTD	云游控股	484 HK	香港	中国香港	13,400	38,311.50	0.06
82	WOWPRIME CORP	王品	2727 TT	台湾	中国台湾	1,682	32,478.35	0.05
83	CHINA	南方航空	1055 HK	香港	中国香港	10,000	31,330.99	0.05

	SOUTHERN AIRLINES CO-H							
84	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	香港	中国香港	12,000	30,253.13	0.05
85	COSMOLADY CHINA HOLDINGS CO	都市丽人	2298 HK	香港	中国香港	63,000	27,622.43	0.05
86	TSAKER CHEMICAL GROUP LTD	彩客化学	1986 HK	香港	中国香港	21,000	21,867.75	0.04
87	WISDOM SPORTS GROUP	智美体育	1661 HK	香港	中国香港	176,000	17,523.43	0.03
88	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	金山软件有限公司	KC US	美国	美国	63	14,058.19	0.02
89	CENTURY SAGE SCIENTIFIC HOLD	世纪睿科	1450 HK	香港	中国香港	270,000	13,071.33	0.02
90	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	香港	中国香港	1,000	5,836.88	0.01

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	LUYE PHARMA GROUP LTD	2186 HK	598,045.50	0.83
2	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	6110 HK	596,393.44	0.82
3	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	586 HK	576,209.83	0.79
4	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	359,514.05	0.50
5	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	321,753.05	0.44
6	FIT HON TENG LTD	6088 HK	150,723.75	0.21
7	CHINA KEPEI EDUCATION GROUP	1890 HK	142,709.14	0.20

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。

#### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,248,839.27	3.10
2	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	1,488,999.33	2.05
3	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,240,222.44	1.71
4	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	1,168,456.98	1.61
5	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	570 HK	1,006,622.61	1.39
6	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	442,057.65	0.61
7	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	425,873.63	0.59
8	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	411,755.04	0.57
9	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	398,388.03	0.55
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	383,459.37	0.53
11	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2884 TT	380,238.00	0.52
12	DONGYUE GROUP	189 HK	357,278.85	0.49
13	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2357 HK	274,804.72	0.38
14	CHINA ELECTRONICS CORP HOLDI	85 HK	268,556.59	0.37
15	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	1297 HK	226,730.61	0.31
16	AIA GROUP LTD	1299 HK	196,608.71	0.27
17	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	696 HK	178,376.88	0.25
18	BEIJING URBAN CONSTRUCTION-H	1599 HK	175,496.58	0.24
19	PHARMAESSENTIA CORP	6446 TT	173,138.83	0.24
20	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	3969 HK	172,573.15	0.24

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。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,745,348.76
卖出收入（成交）总额	14,869,458.48

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	618,601.63
3	应收股利	396,207.95
4	应收利息	168.61
5	应收申购款	161,069.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,176,047.38

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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

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
3,435	12,233.29	0.00	0.00%	42,021,352.67	100.00%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	115,897.12	0.28%

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

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 5 月 17 日）基金份额总额	434,578,142.49
本报告期期初基金份额总额	51,330,402.84
本报告期基金总申购份额	3,317,667.58
减：本报告期基金总赎回份额	12,626,717.75
本报告期基金拆分变动份额	-



本报告期末基金份额总额	42,021,352.67
-------------	---------------

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	4,816,171.79	27.34%	1,839.04	17.83%	-
Instinet Pacific Limited	-	4,634,276.85	26.31%	2,317.17	22.46%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	2,957,310.21	16.79%	1,478.66	14.33%	-
MasterLink Securities Corp	-	2,308,967.85	13.11%	3,232.23	31.33%	-
Goldman Sachs (Asia) Limited	-	1,696,731.30	9.63%	848.38	8.22%	-

Liability Company						
Citigroup Global Market Asia Limited	-	1,201,349.19	6.82%	600.68	5.82%	-
SinoPac Securities Corp.						
UBS Securities Co., Ltd						
Nomura International Plc.						
CCB International Securities Limited						
Yuanta Securities Company Limited.						
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited						
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd						
Barclays Capital Asia Limited.						
Guosen Securities(Hong Kong)						
Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited						
FIRST SHANGHAI SECURITIES LIMITED						
Shenyin Wanguo Securities(HK)						

Ltd.						
China International Capital Corporation (HKS) Ltd						
BOCI Securities Ltd.						
Cathay Securities Corporation						

注：1、券商专用交易单元选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

(1) 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；

(2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(4) 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；

(5) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

QDII 券商选择程序：

(1) 对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券商选择标准和《券商服务评价办法》，对候选券商研究服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增券商申请审核表》

牵头部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增券商，填写《新增券商申请审核表》，对拟新增券商的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选券商名单提交分管领导审批

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

(4) 与相关券商进行开户工作

集中交易部与对应选择券商进行开户工作，完成后，通知信息技术部以及运营部门完成后续相关设置。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
MasterLink Securities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman	-	-	-	-	-	-	-	-

Sachs (Asia ) Limit ed Liabi lity Com pany								
Citigr oup Glob al Mark et Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Sino Pac Secur ities Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Nom ura Inter natio nal Plc.	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB Inter natio nal Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuant a Secur	-	-	-	-	-	-	-	-

ities Com pany Limit ed.								
The Hong kong and Shan ghai Bank ing Corp oratio n Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Parib as Secur ities (Asia ) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Barcl ays Capit al Asia Limit ed.	-	-	-	-	-	-	-	-
Guos en Secur ities( Hong Kong )	-	-	-	-	-	-	-	-
Daiw a Capit al Mark ets	-	-	-	-	-	-	-	-

Hong Kong Limited									
FIRST SHANGHAI SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities(HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-	-

n								
---	--	--	--	--	--	--	--	--

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告.doc	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-04
3	关于华安大中华升级股票型证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定期定额投资的公告.doc	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-02-25
4	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-07
5	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-14
6	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-25
7	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-03-30
8	华安基金关于旗下基金参加中信证券华南股份有限公司优惠活动的公告.doc	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-04-25
9	华安基金关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告.doc	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-05-21
10	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29
11	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站和公司网站	2020-06-29

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



## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十八日