

**华安安康灵活配置混合型证券投资基金**  
**2022 年中期报告**  
**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>6</b>  |
| 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>                          | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>14</b> |
| 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 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>48</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 48        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 48        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 49        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 52        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 53        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 53        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 53        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 53        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 53        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 54        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 54        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>56</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 56        |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 56        |
| 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 ..... | 56        |
| <b>9 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>56</b> |
| <b>10 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>57</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 57        |
| 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 .....  | 57        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 57        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 57        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 57        |
| 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 .....     | 57        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 57        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 61        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>62</b> |
| <b>12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>62</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 62        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 62        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 62        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                    |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称            | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金   |                    |
| 基金简称            | 华安安康灵活配置混合          |                    |
| 基金主代码           | 002363              |                    |
| 交易代码            | 002363              |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                    |
| 基金合同生效日         | 2018 年 8 月 9 日      |                    |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司          |                    |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 10,125,286,027.27 份 |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安安康灵活配置混合 A        | 华安安康灵活配置混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 002363              | 002364             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,087,692,423.49 份  | 2,037,593,603.78 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略   | <p>本基金为混合型基金，在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例；当市场环境发生变化时，本基金将依托仓位弹性优势并借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，对大类资产配置比例进行及时调整。</p> <p>此外，本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。                                                                                                                                                                                                                   |

### 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   | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名   | 杨牧云          | 郭明           |
|      | 联系电话 | 021-38969999 | 010-66105799 |

|        |                                         |                      |                     |
|--------|-----------------------------------------|----------------------|---------------------|
| 负责人    | 电子邮箱                                    | service@huaan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |                                         | 4008850099           | 95588               |
| 传真     |                                         | 021-68863414         | 010-66105798        |
| 注册地址   | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道8号国金中心二期31<br>—32层 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号  |                     |
| 办公地址   | 中国（上海）自由贸易试验区<br>世纪大道8号国金中心二期31<br>—32层 | 北京市西城区复兴门内大街55<br>号  |                     |
| 邮政编码   |                                         | 200120               | 100140              |
| 法定代表人  |                                         | 朱学华                  | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                 |
|---------------------|---------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn                |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、<br>32 层 |

## 2.5 其他相关资料

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

# 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |                 |
|---------------|--------------------------------------|-----------------|
|               | 华安安康灵活配置混合<br>A                      | 华安安康灵活配置混合 C    |
| 本期已实现收益       | -198,827,709.54                      | -61,085,427.86  |
| 本期利润          | -457,708,004.14                      | -142,645,129.18 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0500                              | -0.0587         |
| 本期加权平均净值利润率   | -2.94%                               | -3.58%          |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.33%                               | -2.62%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)                |                 |

|              | 华安安康灵活配置混合 A          | 华安安康灵活配置混合 C     |
|--------------|-----------------------|------------------|
| 期末可供分配利润     | 5,270,432,343.20      | 1,203,547,399.48 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6517                | 0.5907           |
| 期末基金资产净值     | 13,869,514,280.70     | 3,366,633,506.89 |
| 期末基金份额净值     | 1.7149                | 1.6523           |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |                  |
|              | 华安安康灵活配置混合 A          | 华安安康灵活配置混合 C     |
| 基金份额累计净值增长率  | 63.17%                | 59.49%           |

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：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

华安安康灵活配置混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 2.58%    | 0.25%       | 5.58%      | 0.64%         | -3.00% | -0.39% |
| 过去三个月      | 1.49%    | 0.35%       | 3.84%      | 0.86%         | -2.35% | -0.51% |
| 过去六个月      | -2.33%   | 0.36%       | -5.46%     | 0.87%         | 3.13%  | -0.51% |
| 过去一年       | 3.51%    | 0.29%       | -7.69%     | 0.75%         | 11.20% | -0.46% |
| 过去三年       | 40.52%   | 0.37%       | 13.11%     | 0.75%         | 27.41% | -0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 63.17%   | 0.38%       | 24.90%     | 0.79%         | 38.27% | -0.41% |

华安安康灵活配置混合 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 2.53%    | 0.25%       | 5.58%      | 0.64%         | -3.05% | -0.39% |
| 过去三个月      | 1.34%    | 0.35%       | 3.84%      | 0.86%         | -2.50% | -0.51% |
| 过去六个月      | -2.62%   | 0.36%       | -5.46%     | 0.87%         | 2.84%  | -0.51% |
| 过去一年       | 2.90%    | 0.29%       | -7.69%     | 0.75%         | 10.59% | -0.46% |
| 过去三年       | 38.07%   | 0.37%       | 13.11%     | 0.75%         | 24.96% | -0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.49%   | 0.38%       | 24.90%     | 0.79%         | 34.59% | -0.41% |

|      |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|

### 3.2.2 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

华安安康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

(2018 年 8 月 9 日至 2022 年 6 月 30 日)

华安安康灵活配置混合 A



华安安康灵活配置混合 C



## 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 |        |                  |
| 石雨欣 | 本基金的基金 | 2016-02-0       | -    | 15 年   | 硕士研究生，15 年相关行业从业 |

|    |          |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----|----------|------------|---|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 经理       | 1          |   |      | <p>经验,曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司,历任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月至 2017 年 6 月担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2018 年 8 月,担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 8 月起,同时担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起,同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月至 2018 年 9 月,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 6 月,同时担任华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 2 月,同时担任华安安盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起,同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 陆奔 | 本基金的基金经理 | 2018-09-25 | - | 10 年 | <p>硕士研究生,10 年基金行业从业经历。2011 年加入华安基金,历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 9 月起,担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月至 2019 年 1 月,同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2020 年 2 月,同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>资基金的基金经理。2020 年 1 月起,同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起,同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起,同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起,同时担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起,同时担任华安兴安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起,同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年欧美经济继续复苏，俄乌冲突进一步加剧全球通胀格局，通胀水平持续创历史新高，美联储开始加息缩表，美债利率大幅上行，全球风险偏好下降。上半年局部疫情对经济回升产生了一定扰动，经济增长压力有所加大，国内宏观政策以稳定经济增长为首要任务，货币政策和财政政策更加积极。货币政策方面继续保持充裕的流动性，同时央行分别下调公开市场操作利率及 5 年期 LPR 利率，资金利率中枢有所下移。财政方面推动了较大规模的留底退税政策，释放了充裕的流动性，同时加快专项债的发行及转换为实物工作量。社融开始逐步回升，经济逐步好转，CPI 略有回升，但总体的通胀压力依然可控。债券短端收益率受资金面推动持续下行，中长端收益率受经济回升压力和海外通胀制约保持区间震荡，信用债整体表现优于利率债。期内中债综合全价(总值)指数上涨 0.38%。

从权益市场来看，2022 上半年宏观事件对市场冲击较大，如美联储加息、俄乌冲突、疫情扰动等，但整体看有惊无险，体现出国内经济和资本市场的韧性。随着超跌后的市场修复，市场风格也从价值向成长切换，周期也有不错的表现。

报告期内，本基金继续按照“固收+”策略布局投资，适度控制仓位，保持均衡风格，稳健参与市场结构性机会。债券部分以高等级信用债配置为主，阶段性参与中长久期利率债的交易机会，灵活调整组合久期，积极防范信用风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，华安安康灵活配置混合 A 份额净值为 1.7149 元，C 份额净值为 1.6523 元；华安安康灵活配置混合 A 份额净值增长率为-2.33%，C 份额净值增长率为-2.62%，同期业绩比较基准增长率为-5.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，随着疫情影响逐步减弱，政策重心重回稳增长，为配合各项政策措施的落地实施，货币政策有望继续保持相对宽松的格局，但资金面可能受信贷回升出现一定扰动，预计总体的利率中枢不会出现较大幅度调整。房地产政策边际放松仍在继续，在房住不炒的大背景不变及居民杠杆率相对较高的制约下，预计本轮地产的回升幅度可能有限。因此，下半年债市可能面临小幅的波动风险，但预计调整幅度有限，债市投资继续以票息策略为主。对于权益市场，我们认为市场核心矛盾在国内经济复苏的幅度和持续性，以及海外通胀压力和紧缩政策的力度。整体而言，我们倾向于认为市场右侧的基础尚不牢靠，将按照涨跌不惊、聚焦选股的方式来应对。穿越周期最好的办法就是长期理性主义，当下的 A 股就是践行这一理念的窗口，不少优质个股都有一个中期角度相对不错的价格。

本基金下一阶段投资会维持均衡风格，选股更注重中期视角，一定程度上淡化择时，保持中性仓位，在控制波动的前提下适度提高持股集中度。债券部分继续保持高等级信用债配置为主，注重票息收益，灵活控制债券久期，严控信用风险。

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的利益。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：华安安康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产          | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日   | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|--------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         | -                        | -                        |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 321,029,361.73           | 281,737,029.15           |
| 结算备付金       |         | 1,328,547.95             | 46,773,386.52            |
| 存出保证金       |         | 2,021,060.32             | 519,918.80               |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 14,749,865,857.10        | 15,348,092,837.22        |
| 其中：股票投资     |         | 3,353,860,908.02         | 3,420,011,837.22         |
| 基金投资        |         | -                        | -                        |
| 债券投资        |         | 11,396,004,949.08        | 11,928,081,000.00        |
| 资产支持证券投资    |         | -                        | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                        | -                        |
| 其他投资        |         | -                        | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                        | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | 2,301,319,553.48         | 1,795,300,000.00         |
| 应收清算款       |         | 54,250,626.66            | -                        |
| 应收股利        |         | -                        | -                        |
| 应收申购款       |         | 12,218,117.24            | 519,062,647.87           |
| 递延所得税资产     |         | -                        | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.5 | -                        | 128,077,201.61           |
| <b>资产总计</b> |         | <b>17,442,033,124.48</b> | <b>18,119,563,021.17</b> |

| 负债和净资产      | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |
| 应付清算款       |         | -                      | 79,783,636.70            |
| 应付赎回款       |         | 177,783,690.61         | 59,023,149.97            |
| 应付管理人报酬     |         | 13,065,932.06          | 11,176,997.70            |
| 应付托管费       |         | 2,903,540.51           | 2,483,777.29             |
| 应付销售服务费     |         | 1,713,181.79           | 1,538,725.15             |
| 应付投资顾问费     |         | -                      | -                        |
| 应交税费        |         | 886,210.03             | 617,844.25               |
| 应付利润        |         | -                      | -                        |
| 递延所得税负债     |         | -                      | -                        |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 9,532,781.89           | 5,116,991.77             |
| 负债合计        |         | 205,885,336.89         | 159,741,122.83           |
| <b>净资产：</b> |         |                        |                          |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 10,125,286,027.27      | 10,304,065,745.50        |
| 其他综合收益      |         | -                      | -                        |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 7,110,861,760.32       | 7,655,756,152.84         |
| 净资产合计       |         | 17,236,147,787.59      | 17,959,821,898.34        |
| 负债和净资产总计    |         | 17,442,033,124.48      | 18,119,563,021.17        |

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 10,125,286,027.27 份。其中 A 类基金份额净值 1.7149 元，份额总额 8,087,692,423.49 份；C 类基金份额净值 1.6523 元，份额总额 2,037,593,603.78 份。

（2）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：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安康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 30 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<br>2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |          | <b>-481,008,289.61</b>             | <b>66,543,962.29</b>               |
| 1.利息收入                     |          | 17,240,103.43                      | 15,936,052.62                      |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9  | 2,131,684.94                       | 231,855.13                         |
| 债券利息收入                     |          | -                                  | 14,634,128.73                      |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                                  | -                                  |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 15,108,418.49                      | 1,070,068.76                       |
| 证券出借利息收入                   |          | -                                  | -                                  |
| 其他利息收入                     |          | -                                  | -                                  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -170,724,673.60                    | 57,802,402.04                      |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10 | -394,765,679.93                    | 55,133,253.86                      |
| 基金投资收益                     |          | -                                  | -                                  |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.11 | 186,074,329.42                     | 294,731.37                         |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                                  | -                                  |
| 贵金属投资收益                    |          | -                                  | -                                  |
| 衍生工具收益                     |          | -                                  | -                                  |
| 股利收益                       | 6.4.7.12 | 37,966,676.91                      | 2,374,416.81                       |
| 其他投资收益                     |          | -                                  | -                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.13 | -340,439,995.92                    | -7,975,236.38                      |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                                  | -                                  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.14 | 12,916,276.48                      | 780,744.01                         |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>119,344,843.71</b>              | <b>12,504,302.06</b>               |
| 1. 管理人报酬                   |          | 87,323,529.67                      | 6,579,803.02                       |
| 2. 托管费                     |          | 19,405,228.85                      | 1,462,178.47                       |
| 3. 销售服务费                   |          | 11,903,117.88                      | 1,219,035.50                       |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                                  | -                                  |
| 5. 利息支出                    |          | -                                  | 4,746.52                           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                                  | 4,746.52                           |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.15 | -                                  | -                                  |
| 7.税金及附加                    |          | 546,188.89                         | 37,026.73                          |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.16 | 166,778.42                         | 3,201,511.82                       |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-600,353,133.32</b>             | <b>54,039,660.23</b>               |
| 减：所得税费用                    |          | -                                  | -                                  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-600,353,133.32</b>             | <b>54,039,660.23</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>-600,353,133.32</b>             | <b>54,039,660.23</b>               |

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

期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安安康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 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期                              |                |                   |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------|----------------|-------------------|-------------------|
|                                          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |                   |                   |
|                                          | 实收基金                            | 其他综合<br>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）                          | 10,304,065,745.50               | -              | 7,655,756,152.84  | 17,959,821,898.34 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 10,304,065,745.50               | -              | 7,655,756,152.84  | 17,959,821,898.34 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -178,779,718.23                 | -              | -544,894,392.52   | -723,674,110.75   |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -              | -600,353,133.32   | -600,353,133.32   |
| （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）      | -178,779,718.23                 | -              | 55,458,740.80     | -123,320,977.43   |
| 其中：1.基金申购款                               | 4,688,635,591.97                | -              | 3,336,267,165.27  | 8,024,902,757.24  |
| 2.基金赎回款                                  | -4,867,415,310.20               | -              | -3,280,808,424.47 | -8,148,223,734.67 |
| （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）                          | 10,125,286,027.27               | -              | 7,110,861,760.32  | 17,236,147,787.59 |

| 项目 | 上年度可比期间 |
|----|---------|
|----|---------|

|                                          | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |                 |                  |
|------------------------------------------|---------------------------------|----------------|-----------------|------------------|
|                                          | 实收基金                            | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润           | 实收基金             |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 1,131,804,997.22                | -              | 660,519,970.34  | 1,792,324,967.56 |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 1,131,804,997.22                | -              | 660,519,970.34  | 1,792,324,967.56 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -151,335,849.40                 | -              | -30,723,853.47  | -182,059,702.87  |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -              | 54,039,660.23   | 54,039,660.23    |
| （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）      | -151,335,849.40                 | -              | -84,763,513.70  | -236,099,363.10  |
| 其中：1.基金申购款                               | 396,738,031.25                  | -              | 240,356,575.39  | 637,094,606.64   |
| 2.基金赎回款                                  | -548,073,880.65                 | -              | -325,120,089.09 | -873,193,969.74  |
| （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）                          | 980,469,147.82                  | -              | 629,796,116.87  | 1,610,265,264.69 |

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：朱学华，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安安康灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由华安安康保本混合型证券投资基金转型而成，华安安康保本混合型证券投资基金系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[2016]64 号《关于准予华安安康保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2016 年 2 月 1 日生效，首次

设立募集规模为 5,200,093,669.16 份基金份额。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及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华安安康保本混合型证券投资基金基金合同》及《华安安康保本混合型证券投资基金保本到期安排及转型为华安安康灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，本基金自 2018 年 8 月 9 日起转型为非保本的混合型证券投资基金并更名为华安安康灵活配置混合型证券投资基金。

本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、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：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其

信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》

（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买

入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：以摊余成本计量的金融资产：银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 281,737,029.15 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 77,661.99 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 281,814,691.14 元。结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 46,773,386.52 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 21,048.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 46,794,434.52 元。存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 519,918.80 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 234.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 520,152.80 元。买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,795,300,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 -735,748.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,794,564,251.89 元。应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 128,077,201.61 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 77,661.99 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 21,048.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 234.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 128,714,005.73 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 -735,748.11 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 15,348,092,837.22 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 128,714,005.73 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 15,476,806,842.95 元。除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人作为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得

有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 321,029,361.73         |
| 等于：本金  | 320,941,681.39         |
| 加：应计利息 | 87,680.34              |
| 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     | 321,029,361.73         |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |                  |                 |
|-------------------|------------------------|--------------|------------------|-----------------|
|                   | 成本                     | 应计利息         | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票                | 3,540,402,486.68       | -            | 3,353,860,908.02 | -186,541,578.66 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -            | -                | -               |
| 债券                | 150,896,163.01         | 2,583,682.20 | 153,365,682.20   | -114,163.01     |
| 交易所市              |                        |              |                  |                 |

|        |       |                   |                |                   |                 |
|--------|-------|-------------------|----------------|-------------------|-----------------|
|        | 场     |                   |                |                   |                 |
|        | 银行间市场 | 11,075,720,021.81 | 146,344,266.88 | 11,242,639,266.88 | 20,574,978.19   |
|        | 合计    | 11,226,616,184.82 | 148,927,949.08 | 11,396,004,949.08 | 20,460,815.18   |
| 资产支持证券 |       | -                 | -              | -                 | -               |
| 基金     |       | -                 | -              | -                 | -               |
| 其他     |       | -                 | -              | -                 | -               |
| 合计     |       | 14,767,018,671.50 | 148,927,949.08 | 14,749,865,857.10 | -166,080,763.48 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,033,866,000.00       | -         |
| 银行间市场 | 1,267,453,553.48       | -         |
| 合计    | 2,301,319,553.48       | -         |

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 23,642.99              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 9,265,166.57           |
| 其中：交易所市场    | 9,223,736.19           |
| 银行间市场       | 41,430.38              |
| 应付利息        | -                      |

|         |              |
|---------|--------------|
| 预提信息披露费 | 179,507.37   |
| 预提审计费   | 64,464.96    |
| 合计      | 9,532,781.89 |

#### 6.4.7.7 实收基金

华安安康灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                   |
|---------------|----------------------|-------------------|
|               | 2022年1月1日至2022年6月30日 |                   |
|               | 基金份额                 | 账面金额              |
| 上年度末          | 8,072,756,041.15     | 8,072,756,041.15  |
| 本期申购          | 2,949,993,577.30     | 2,949,993,577.30  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,935,057,194.96    | -2,935,057,194.96 |
| 本期末           | 8,087,692,423.49     | 8,087,692,423.49  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

华安安康灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                   |
|---------------|----------------------|-------------------|
|               | 2022年1月1日至2022年6月30日 |                   |
|               | 基金份额                 | 账面金额              |
| 上年度末          | 2,231,309,704.35     | 2,231,309,704.35  |
| 本期申购          | 1,738,642,014.67     | 1,738,642,014.67  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,932,358,115.24    | -1,932,358,115.24 |
| 本期末           | 2,037,593,603.78     | 2,037,593,603.78  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安安康灵活配置混合 A

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分            | 未实现部分           | 未分配利润合计          |
|------|------------------|-----------------|------------------|
| 上年度末 | 5,441,737,793.12 | 659,478,351.53  | 6,101,216,144.65 |
| 本期利润 | -198,827,709.54  | -258,880,294.60 | -457,708,004.14  |

|                |                   |                |                   |
|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 27,522,259.62     | 110,791,457.08 | 138,313,716.70    |
| 其中：基金申购款       | 1,993,355,559.96  | 176,381,391.57 | 2,169,736,951.53  |
| 基金赎回款          | -1,965,833,300.34 | -65,589,934.49 | -2,031,423,234.83 |
| 本期已分配利润        | -                 | -              | -                 |
| 本期末            | 5,270,432,343.20  | 511,389,514.01 | 5,781,821,857.21  |

## 华安安康灵活配置混合 C

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分          | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 上年度末           | 1,377,099,096.99  | 177,440,911.20 | 1,554,540,008.19  |
| 本期利润           | -61,085,427.86    | -81,559,701.32 | -142,645,129.18   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -112,466,269.65   | 29,611,293.75  | -82,854,975.90    |
| 其中：基金申购款       | 1,073,285,831.03  | 93,244,382.71  | 1,166,530,213.74  |
| 基金赎回款          | -1,185,752,100.68 | -63,633,088.96 | -1,249,385,189.64 |
| 本期已分配利润        | -                 | -              | -                 |
| 本期末            | 1,203,547,399.48  | 125,492,503.63 | 1,329,039,903.11  |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,882,461.67                          |
| 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 | 236,624.31                            |
| 其他        | 12,598.96                             |
| 合计        | 2,131,684.94                          |

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -394,765,679.93                       |
| 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 | -394,765,679.93 |
|----|-----------------|

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 4,703,069,590.84                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,083,020,262.16                      |
| 减：交易费用     | 14,815,008.61                         |
| 买卖股票差价收入   | -394,765,679.93                       |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 185,577,066.10             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 497,263.32                 |
| 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                           | 186,074,329.42             |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 10,554,169,102.84          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,437,514,242.17          |
| 减：应计利息总额               | 116,073,223.34             |
| 减：交易费用                 | 84,374.01                  |
| 买卖债券差价收入               | 497,263.32                 |

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

|               |               |
|---------------|---------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 37,966,676.91 |
| 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            | 37,966,676.91 |

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -340,439,995.92            |
| ——股票投资                     | -335,863,265.77            |
| ——债券投资                     | -4,576,730.15              |
| ——资产支持证券投资                 | -                          |
| ——基金投资                     | -                          |
| ——贵金属投资                    | -                          |
| ——其他                       | -                          |
| 2.衍生工具                     | -                          |
| ——权证投资                     | -                          |
| 3.其他                       | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -340,439,995.92            |

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 12,389,065.45              |
| 转换费收入   | 527,211.03                 |
| 合计      | 12,916,276.48              |

#### 6.4.7.15 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 64,464.96                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |

|       |            |
|-------|------------|
| 银行汇划费 | 24,206.09  |
| 账户维护费 | 18,000.00  |
| 其他费用  | 600.00     |
| 合计    | 166,778.42 |

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

根据本基金管理人于 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经基金管理人股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2022】469 号文核准，基金管理人股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的本公司 15% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 国泰君安证券股份有限公司         | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>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<br>有限公司 | 1,707,651,001.33 | 17.00% | 199,569,703.61 | 10.36% |

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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30日 |                  | 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<br>比例 | 成交金额                 | 占当期债券成交总额的<br>比例 |
| 国泰君安证券股份有<br>限公司 | 1,874,718.65         | 2.21%            | 9,876.43             | 0.63%            |

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称            | 本期                              |            |              |              |
|------------------|---------------------------------|------------|--------------|--------------|
|                  | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |            |              |              |
|                  | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有<br>限公司 | 1,558,978.72                    | 16.90%     | 1,558,978.72 | 16.90%       |
| 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<br>限公司 | 181,868.78                      | 10.23%     | 62,261.83    | 3.76%        |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 87,323,529.67                  | 6,579,803.02                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 33,082,150.49                  | 2,831,696.95                        |

注：注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.90% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,405,228.85                  | 1,462,178.47                        |

注：注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              |            |
|--------------------|----------------------------|--------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |              |            |
|                    | 华安安康灵活配置<br>混合 A           | 华安安康灵活配置混合 C | 合计         |
| 国泰君安证券股份有<br>限公司   | -                          | 115,778.09   | 115,778.09 |
| 华安基金管理有限公          | -                          | 300,278.07   | 300,278.07 |

|                |                                 |             |            |
|----------------|---------------------------------|-------------|------------|
| 司              |                                 |             |            |
| 中国工商银行股份有限公司   | -                               | 230,702.88  | 230,702.88 |
| 合计             | -                               | 646,759.04  | 646,759.04 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |             |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |             |            |
|                | 华安安康灵活配置混合A                     | 华安安康灵活配置混合C | 合计         |
| 国泰君安证券股份有限公司   | -                               | 1,151.66    | 1,151.66   |
| 华安基金管理有限公司     | -                               | 110,994.74  | 110,994.74 |
| 中国工商银行股份有限公司   | -                               | 76,790.67   | 76,790.67  |
| 合计             | -                               | 188,937.07  | 188,937.07 |

注：注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times C$  类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |        |      |                    |          |       |      |
|---------------------------------|--------|------|--------------------|----------|-------|------|
| 银行间市场                           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购              |          | 基金正回购 |      |
| 交易的各关联方名称                       | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额               | 利息收入     | 交易金额  | 利息支出 |
| 国泰君安证券股份有限公司                    | -      | -    | 100,000.00<br>0.00 | 5,671.23 | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |      |                    |          |       |      |
| 银行间市场                           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购              |          | 基金正回购 |      |

| 交易的各关联方名称 | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
|-----------|------|------|------|------|------|------|
| -         | -    | -    | -    | -    | -    | -    |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |             | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |             |
|-------------------|----------------------------|-------------|---------------------------------|-------------|
|                   | 华安安康灵活配置混合A                | 华安安康灵活配置混合C | 华安安康灵活配置混合A                     | 华安安康灵活配置混合C |
| 期初持有的基金份额         | 57,112,913.36              | -           | -                               | -           |
| 期间申购/买入总份额        | -                          | -           | -                               | -           |
| 期间因拆分变动份额         | -                          | -           | -                               | -           |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                          | -           | -                               | -           |
| 期末持有的基金份额         | 57,112,913.36              | -           | -                               | -           |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.56%                      | -           | -                               | -           |

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

华安安康灵活配置混合 A

份额单位：份

| 关联方名称            | 华安安康灵活配置混合A本期末<br>2022年6月30日 |                  | 华安安康灵活配置混合A上年度末<br>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 |
| 华安未来资产管理（上海）有限公司 | 57,112,913.36                | 0.56%            | 57,112,913.36                  | 0.55%            |

##### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国工商银行 | 321,029,361.73             | 1,882,461.67 | 81,091,518.30                   | 193,322.86 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日      |        |      |       |            |            |
|--------------------------------------------|--------|------|-------|------------|------------|
| 关联方名称                                      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式  | 基金在承销期内买入  |            |
|                                            |        |      |       | 数量（单位：股/张） | 总金额        |
| 国泰君安证券股份有限公司                               | 688234 | 天岳先进 | 网下申购  | 6,759.00   | 562,375.50 |
| 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<br>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  |
| 国泰君安                                       | 123104 | 卫宁转债 | 老股东配售 | 83.00      | 8,300.00   |

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

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

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |           |         |        |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------|-----------|---------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期       | 流通受限类型  | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301219               | 腾远钴业 | 2022-05-24 | 1-6 个月(含) | 新股限售-送股 | -      | 87.82  | 257.00   | -         | 22,569.74 | -  |
| 301200               | 大族数控 | 2022-02-18 | 1-6 个月(含) | 新股限售    | 76.56  | 51.92  | 857.00   | 65,611.92 | 44,495.44 | -  |
| 301206               | 三元生物 | 2022-01-26 | 1-6 个月(含) | 新股限售    | 109.30 | 45.69  | 630.00   | 68,859.00 | 28,784.70 | -  |
| 301207               | 华兰疫苗 | 2022-02-10 | 1-6 个月(含) | 新股限售    | 56.88  | 56.42  | 569.00   | 32,364.72 | 32,102.98 | -  |
| 301206               | 三元生物 | 2022-06-17 | 1-6 个月(含) | 新股限售-送股 | -      | 45.69  | 315.00   | -         | 14,392.35 | -  |
| 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 | -  |
| 301219               | 腾远钴业 | 2022-03-10 | 1-6 个月(含) | 新股限售    | 173.98 | 87.82  | 321.00   | 55,847.58 | 28,190.22 | -  |
| 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 | -  |
| 301103               | 何氏眼科 | 2022-06-01 | 1-6 个月(含) | 新股限售-送股 | -      | 32.02  | 117.00   | -         | 3,746.34  | -  |
| 300834               | 星辉环材 | 2022-01-06 | 1-6 个月(含) | 新股限售    | 55.57  | 30.03  | 635.00   | 35,286.95 | 19,069.05 | -  |

|        |      |            |               |      |       |       |          |           |           |   |
|--------|------|------------|---------------|------|-------|-------|----------|-----------|-----------|---|
| 301256 | 华融化学 | 2022-03-14 | 1-6 个月<br>(含) | 新股限售 | 8.05  | 10.08 | 1,831.00 | 14,739.55 | 18,456.48 | - |
| 301123 | 奕东电子 | 2022-01-14 | 1-6 个月<br>(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<br>(含) | 新股限售 | 42.50 | 32.02 | 390.00   | 16,575.00 | 12,487.80 | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022-01-21 | 1-6 个月<br>(含) | 新股限售 | 39.30 | 37.93 | 418.00   | 16,427.40 | 15,854.74 | - |
| 301117 | 佳缘科技 | 2022-01-07 | 1-6 个月<br>(含) | 新股限售 | 46.80 | 54.44 | 262.00   | 12,261.60 | 14,263.28 | - |
| 301130 | 西点药业 | 2022-02-16 | 1-6 个月<br>(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<br>(含) | 新股限售 | 20.08 | 20.34 | 373.00   | 7,489.84  | 7,586.82  | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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。本基金通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在

基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 321,029,361.73   | -                | -             | -                | 321,029,361.73    |
| 结算备付金                  | 1,328,547.95     | -                | -             | -                | 1,328,547.95      |
| 存出保证金                  | 2,021,060.32     | -                | -             | -                | 2,021,060.32      |
| 交易性金融资产                | 4,602,912,060.83 | 6,772,683,042.77 | 20,409,845.48 | 3,353,860,908.02 | 14,749,865,857.10 |
| 买入返售金融资产               | 2,301,319,553.48 | -                | -             | -                | 2,301,319,553.48  |
| 应收清算款                  | -                | -                | -             | 54,250,626.66    | 54,250,626.66     |
| 应收申购款                  | -                | -                | -             | 12,218,117.24    | 12,218,117.24     |
| 其他资产                   | -                | -                | -             | -                | -                 |
| 资产总计                   | 7,228,610,584.31 | 6,772,683,042.77 | 20,409,845.48 | 3,420,329,651.92 | 17,442,033,124.48 |
| 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                            | -                | -                | -              | 177,783,690.61   | 177,783,690.61    |
| 应付管理人报酬                          | -                | -                | -              | 13,065,932.06    | 13,065,932.06     |
| 应付托管费                            | -                | -                | -              | 2,903,540.51     | 2,903,540.51      |
| 应付销售服务费                          | -                | -                | -              | 1,713,181.79     | 1,713,181.79      |
| 应交税费                             | -                | -                | -              | 886,210.03       | 886,210.03        |
| 应付利润                             | -                | -                | -              | -                | -                 |
| 递延所得税负债                          | -                | -                | -              | -                | -                 |
| 其他负债                             | -                | -                | -              | 9,532,781.89     | 9,532,781.89      |
| 负债总计                             | -                | -                | -              | 205,885,336.89   | 205,885,336.89    |
| 利率敏感度缺口                          | 7,228,610,584.31 | 6,772,683,042.77 | 20,409,845.48  | 3,214,444,315.03 | 17,236,147,787.59 |
| <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>     | <b>1-5 年</b>     | <b>5 年以上</b>   | <b>不计息</b>       | <b>合计</b>         |
| 资产                               |                  |                  |                |                  |                   |
| 银行存款                             | 281,737,029.15   | -                | -              | -                | 281,737,029.15    |
| 结算备付金                            | 46,773,386.52    | -                | -              | -                | 46,773,386.52     |
| 存出保证金                            | 519,918.80       | -                | -              | -                | 519,918.80        |
| 交易性金融资产                          | 3,517,257,000.00 | 8,008,874,000.00 | 401,950,000.00 | 3,420,011,837.22 | 15,348,092,837.22 |
| 买入返售金融资产                         | 1,795,300,000.00 | -                | -              | -                | 1,795,300,000.00  |
| 应收清算款                            | -                | -                | -              | -                | -                 |
| 应收申购款                            | -                | -                | -              | 519,062,647.87   | 519,062,647.87    |
| 其他资产                             | -                | -                | -              | 128,077,201.61   | 128,077,201.61    |
| 资产总计                             | 5,641,587,334.47 | 8,008,874,000.00 | 401,950,000.00 | 4,067,151,686.70 | 18,119,563,021.17 |
| 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                            | -                | -                | -              | 79,783,636.70    | 79,783,636.70     |

|         |                  |                  |                |                  |                   |
|---------|------------------|------------------|----------------|------------------|-------------------|
| 应付赎回款   | -                | -                | -              | 59,023,149.97    | 59,023,149.97     |
| 应付管理人报酬 | -                | -                | -              | 11,176,997.70    | 11,176,997.70     |
| 应付托管费   | -                | -                | -              | 2,483,777.29     | 2,483,777.29      |
| 应付销售服务费 | -                | -                | -              | 1,538,725.15     | 1,538,725.15      |
| 应交税费    | -                | -                | -              | 617,844.25       | 617,844.25        |
| 应付利润    | -                | -                | -              | -                | -                 |
| 递延所得税负债 | -                | -                | -              | -                | -                 |
| 其他负债    | -                | -                | -              | 5,116,991.77     | 5,116,991.77      |
| 负债总计    | -                | -                | -              | 159,741,122.83   | 159,741,122.83    |
| 利率敏感度缺口 | 5,641,587,334.47 | 8,008,874,000.00 | 401,950,000.00 | 3,907,410,563.87 | 17,959,821,898.34 |

#### 6.4.13.4.1.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                    | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 39,078,722.98                   | 59,433,358.47            |
|    | 市场利率上行 25 个基点      | -38,926,615.97                  | -58,827,842.69           |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所

持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 3,353,860,90<br>8.02   | 19.46                | 3,420,011,837<br>.22     | 19.04                |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 其他            | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 合计            | 3,353,860,90<br>8.02   | 19.46                | 3,420,011,837<br>.22     | 19.04                |

#### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                       | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准增加 5%           | 328,118,535.03                  | 243,500,677.84           |
|    | 业绩比较基准减少 5%           | -328,118,535.03                 | -243,500,677.84          |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|-------------------------|
| 第一层次          | 3,353,505,481.19       | 3,418,102,257.28        |
| 第二层次          | 11,396,004,949.08      | 11,928,086,504.49       |
| 第三层次          | 355,426.83             | 1,904,075.45            |
| 合计            | 14,749,865,857.10      | 15,348,092,837.22       |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 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              | 3,353,860,908.02  | 19.23        |
|    | 其中：股票             | 3,353,860,908.02  | 19.23        |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 11,396,004,949.08 | 65.34        |
|    | 其中：债券             | 11,396,004,949.08 | 65.34        |
|    | 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          | 2,301,319,553.48  | 13.19        |
|    | 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      | 322,357,909.68    | 1.85         |
| 8  | 其他各项资产            | 68,489,804.22     | 0.39         |
| 9  | 合计                | 17,442,033,124.48 | 100.00       |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 2,680,509.00     | 0.02         |
| C  | 制造业              | 2,069,212,131.17 | 12.01        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | 36,292.74        | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 56,901.00        | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 279,150,677.68   | 1.62  |
| J | 金融业             | 584,945,479.52   | 3.39  |
| K | 房地产业            | 197,175,051.86   | 1.14  |
| L | 租赁和商务服务业        | 11,320,398.00    | 0.07  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 43,980,014.56    | 0.26  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 14,655,545.80    | 0.09  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -                | -     |
| P | 教育              | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 150,647,906.69   | 0.87  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -                | -     |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 3,353,860,908.02 | 19.46 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 300613 | 富瀚微   | 3,291,703  | 279,136,414.40 | 1.62         |
| 2  | 000977 | 浪潮信息  | 8,321,600  | 220,355,968.00 | 1.28         |
| 3  | 601567 | 三星医疗  | 15,582,871 | 206,940,526.88 | 1.20         |
| 4  | 000001 | 平安银行  | 12,301,090 | 184,270,328.20 | 1.07         |
| 5  | 300143 | 盈康生命  | 13,271,513 | 150,631,672.55 | 0.87         |
| 6  | 601166 | 兴业银行  | 7,023,124  | 139,760,167.60 | 0.81         |
| 7  | 600690 | 海尔智家  | 5,063,100  | 139,032,726.00 | 0.81         |
| 8  | 000858 | 五粮液   | 648,180    | 130,886,987.40 | 0.76         |
| 9  | 600887 | 伊利股份  | 3,209,600  | 125,013,920.00 | 0.73         |
| 10 | 600030 | 中信证券  | 5,707,920  | 123,633,547.20 | 0.72         |
| 11 | 000002 | 万科 A  | 5,483,000  | 112,401,500.00 | 0.65         |
| 12 | 300733 | 西菱动力  | 4,617,600  | 102,233,664.00 | 0.59         |
| 13 | 600398 | 海澜之家  | 19,518,767 | 92,714,143.25  | 0.54         |
| 14 | 002291 | 星期六   | 4,384,100  | 86,629,816.00  | 0.50         |
| 15 | 002236 | 大华股份  | 5,244,300  | 86,111,406.00  | 0.50         |
| 16 | 000776 | 广发证券  | 4,091,300  | 76,507,310.00  | 0.44         |
| 17 | 000069 | 华侨城 A | 11,156,288 | 72,404,309.12  | 0.42         |
| 18 | 600869 | 远东股份  | 14,010,200 | 72,152,530.00  | 0.42         |
| 19 | 000661 | 长春高新  | 285,700    | 66,688,094.00  | 0.39         |
| 20 | 002821 | 凯莱英   | 210,300    | 60,776,700.00  | 0.35         |
| 21 | 600958 | 东方证券  | 5,952,412  | 60,774,126.52  | 0.35         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 22 | 300760 | 迈瑞医疗 | 185,700   | 58,161,240.00 | 0.34 |
| 23 | 603267 | 鸿远电子 | 421,300   | 56,593,229.00 | 0.33 |
| 24 | 603337 | 杰克股份 | 2,305,978 | 49,532,407.44 | 0.29 |
| 25 | 300633 | 开立医疗 | 1,591,500 | 47,792,745.00 | 0.28 |
| 26 | 601222 | 林洋能源 | 5,479,300 | 45,752,155.00 | 0.27 |
| 27 | 603259 | 药明康德 | 422,700   | 43,956,573.00 | 0.26 |
| 28 | 002009 | 天奇股份 | 2,342,773 | 43,341,300.50 | 0.25 |
| 29 | 603313 | 梦百合  | 3,416,720 | 41,000,640.00 | 0.24 |
| 30 | 002409 | 雅克科技 | 687,300   | 38,152,023.00 | 0.22 |
| 31 | 600893 | 航发动力 | 825,372   | 37,562,679.72 | 0.22 |
| 32 | 002831 | 裕同科技 | 1,099,000 | 32,475,450.00 | 0.19 |
| 33 | 002025 | 航天电器 | 455,300   | 31,789,046.00 | 0.18 |
| 34 | 300566 | 激智科技 | 1,487,100 | 26,916,510.00 | 0.16 |
| 35 | 300308 | 中际旭创 | 683,700   | 21,228,885.00 | 0.12 |
| 36 | 300806 | 斯迪克  | 740,352   | 21,018,593.28 | 0.12 |
| 37 | 300567 | 精测电子 | 472,735   | 20,422,152.00 | 0.12 |
| 38 | 002859 | 洁美科技 | 655,900   | 18,050,368.00 | 0.10 |
| 39 | 603027 | 千禾味业 | 1,006,118 | 17,405,841.40 | 0.10 |
| 40 | 002034 | 旺能环境 | 713,860   | 14,655,545.80 | 0.09 |
| 41 | 688120 | 华海清科 | 56,205    | 13,961,322.00 | 0.08 |
| 42 | 600038 | 中直股份 | 307,300   | 13,889,960.00 | 0.08 |
| 43 | 300920 | 润阳科技 | 593,500   | 12,677,160.00 | 0.07 |
| 44 | 601888 | 中国中免 | 48,600    | 11,320,398.00 | 0.07 |
| 45 | 300696 | 爱乐达  | 250,320   | 11,001,564.00 | 0.06 |
| 46 | 001979 | 招商蛇口 | 789,518   | 10,603,226.74 | 0.06 |
| 47 | 600519 | 贵州茅台 | 4,200     | 8,589,000.00  | 0.05 |
| 48 | 300305 | 裕兴股份 | 420,600   | 5,964,108.00  | 0.03 |
| 49 | 603187 | 海容冷链 | 121,832   | 4,452,959.60  | 0.03 |
| 50 | 601899 | 紫金矿业 | 287,300   | 2,680,509.00  | 0.02 |
| 51 | 600383 | 金地集团 | 131,400   | 1,766,016.00  | 0.01 |
| 52 | 002531 | 天顺风能 | 66,988    | 1,104,632.12  | 0.01 |
| 53 | 688690 | 纳微科技 | 3,477     | 280,976.37    | 0.00 |
| 54 | 300957 | 贝泰妮  | 853       | 185,553.09    | 0.00 |
| 55 | 301219 | 腾远钴业 | 578       | 50,759.96     | 0.00 |
| 56 | 301200 | 大族数控 | 857       | 44,495.44     | 0.00 |
| 57 | 301206 | 三元生物 | 945       | 43,177.05     | 0.00 |
| 58 | 601089 | 福元医药 | 1,749     | 36,816.45     | 0.00 |
| 59 | 301207 | 华兰疫苗 | 569       | 32,102.98     | 0.00 |
| 60 | 600029 | 南方航空 | 3,900     | 28,509.00     | 0.00 |
| 61 | 603871 | 嘉友国际 | 1,680     | 28,392.00     | 0.00 |
| 62 | 001323 | 慕思股份 | 573       | 28,111.38     | 0.00 |
| 63 | 301201 | 诚达药业 | 353       | 25,253.62     | 0.00 |
| 64 | 301263 | 泰恩康  | 682       | 21,401.16     | 0.00 |
| 65 | 301122 | 采纳股份 | 301       | 21,181.37     | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 66 | 300834 | 星辉环材 | 635   | 19,069.05 | 0.00 |
| 67 | 301256 | 华融化学 | 1,831 | 18,456.48 | 0.00 |
| 68 | 301123 | 奕东电子 | 656   | 16,655.84 | 0.00 |
| 69 | 301103 | 何氏眼科 | 507   | 16,234.14 | 0.00 |
| 70 | 301235 | 华康医疗 | 418   | 15,854.74 | 0.00 |
| 71 | 301166 | 优宁维  | 253   | 14,891.58 | 0.00 |
| 72 | 301189 | 奥尼电子 | 435   | 14,489.85 | 0.00 |
| 73 | 301117 | 佳缘科技 | 262   | 14,263.28 | 0.00 |
| 74 | 301190 | 善水科技 | 575   | 13,644.75 | 0.00 |
| 75 | 301130 | 西点药业 | 237   | 8,934.90  | 0.00 |
| 76 | 301228 | 实朴检测 | 373   | 7,586.82  | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 000001 | 平安银行 | 268,880,214.21 | 1.50            |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 175,407,106.45 | 0.98            |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 161,607,882.75 | 0.90            |
| 4  | 000977 | 浪潮信息 | 157,246,973.35 | 0.88            |
| 5  | 000792 | 盐湖股份 | 143,021,842.88 | 0.80            |
| 6  | 002466 | 天齐锂业 | 142,706,250.51 | 0.79            |
| 7  | 000002 | 万科 A | 134,591,398.69 | 0.75            |
| 8  | 000768 | 中航西飞 | 129,897,117.22 | 0.72            |
| 9  | 000630 | 铜陵有色 | 119,192,657.00 | 0.66            |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 118,511,561.62 | 0.66            |
| 11 | 600711 | 盛屯矿业 | 118,115,918.74 | 0.66            |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 114,603,413.03 | 0.64            |
| 13 | 600893 | 航发动力 | 107,160,996.39 | 0.60            |
| 14 | 601567 | 三星医疗 | 102,566,168.37 | 0.57            |
| 15 | 000762 | 西藏矿业 | 101,945,897.32 | 0.57            |
| 16 | 601166 | 兴业银行 | 101,479,661.80 | 0.57            |
| 17 | 603993 | 洛阳钼业 | 97,137,564.00  | 0.54            |
| 18 | 000776 | 广发证券 | 96,586,557.80  | 0.54            |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 92,400,046.44  | 0.51            |
| 20 | 300014 | 亿纬锂能 | 92,398,123.04  | 0.51            |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------------|
| 1  | 000792 | 盐湖股份 | 230,506,453.00 | 1.28               |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 198,868,521.28 | 1.11               |
| 3  | 002460 | 赣锋锂业 | 162,571,015.69 | 0.91               |
| 4  | 000933 | 神火股份 | 162,530,747.33 | 0.90               |
| 5  | 000768 | 中航西飞 | 147,271,854.46 | 0.82               |
| 6  | 601600 | 中国铝业 | 136,423,250.72 | 0.76               |
| 7  | 601377 | 兴业证券 | 131,533,350.70 | 0.73               |
| 8  | 002466 | 天齐锂业 | 126,732,550.28 | 0.71               |
| 9  | 000630 | 铜陵有色 | 120,629,617.00 | 0.67               |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 117,086,338.72 | 0.65               |
| 11 | 600893 | 航发动力 | 109,885,006.79 | 0.61               |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 106,675,715.27 | 0.59               |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 100,577,083.78 | 0.56               |
| 14 | 601888 | 中国中免 | 100,493,825.17 | 0.56               |
| 15 | 600711 | 盛屯矿业 | 89,841,128.64  | 0.50               |
| 16 | 603993 | 洛阳钼业 | 86,511,159.04  | 0.48               |
| 17 | 000762 | 西藏矿业 | 85,449,981.06  | 0.48               |
| 18 | 000002 | 万科 A | 77,551,893.18  | 0.43               |
| 19 | 600036 | 招商银行 | 75,311,143.52  | 0.42               |
| 20 | 603229 | 奥翔药业 | 73,443,082.93  | 0.41               |

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 5,352,732,598.73 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 4,703,069,590.84 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -    | -            |
| 2  | 央行票据 | -    | -            |

|    |           |                   |       |
|----|-----------|-------------------|-------|
| 3  | 金融债券      | 1,556,576,566.03  | 9.03  |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,334,204,419.18  | 7.74  |
| 4  | 企业债券      | 153,365,682.20    | 0.89  |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,973,865,849.86  | 11.45 |
| 6  | 中期票据      | 7,712,196,850.99  | 44.74 |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                 | -     |
| 8  | 同业存单      | -                 | -     |
| 9  | 其他        | -                 | -     |
| 10 | 合计        | 11,396,004,949.08 | 66.12 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量(张)     | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 210411    | 21 农发 11      | 2,500,000 | 254,129,452.05 | 1.47         |
| 2  | 210407    | 21 农发 07      | 2,300,000 | 234,393,630.14 | 1.36         |
| 3  | 102102156 | 21 中石集 MTN003 | 2,000,000 | 204,834,980.82 | 1.19         |
| 4  | 210208    | 21 国开 08      | 2,000,000 | 204,779,013.70 | 1.19         |
| 5  | 102100709 | 21 苏交通 MTN002 | 2,000,000 | 204,322,695.89 | 1.19         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

2021 年 9 月 29 日，平安银行因违规办理转口贸易收付汇、违规办理个人财产对外转移等违法违规事项，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检[2021]40 号）责令改正，给予警告、并处罚款人民币 187 万元、没收违法所得 1.58 万元的行政处罚。2022 年 3 月 21 日，平安银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕24 号）给予罚款 400 万元的行政处罚。

2021 年 7 月 21 日，兴业银行因违规办理内保外贷业务等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局（闽汇罚〔2021〕5 号）责令改正、给予警告、没收违法所得和罚款合计 300.10537 万元人民币

的行政处罚。2021 年 8 月 13 日，兴业银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行（银罚字〔2021〕26 号）给予罚款 5 万元的行政处罚。2022 年 3 月 21 日，兴业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报贸易融资业务 EAST 数据、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕22 号）给予罚款 350 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

#### 7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 2,021,060.32  |
| 2  | 应收清算款 | 54,250,626.66 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 12,218,117.24 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 68,489,804.22 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别         | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构            |        |                  |        |
|--------------|----------|-----------|------------------|--------|------------------|--------|
|              |          |           | 机构投资者            |        | 个人投资者            |        |
|              |          |           | 持有份额             | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 华安安康灵活配置混合 A | 197,989  | 40,849.20 | 2,159,053,416.53 | 26.70% | 5,928,639,006.96 | 73.30% |
| 华安安康灵活配置混合 C | 228,079  | 8,933.72  | 323,786,146.25   | 15.89% | 1,713,807,457.53 | 84.11% |
| 合计           | 426,068  | 23,764.48 | 2,482,839,562.78 | 24.52% | 7,642,446,464.49 | 75.48% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别         | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华安安康灵活配置混合 A | 2,931,286.11 | 0.04%    |
|                  | 华安安康灵活配置混合 C | 287,702.32   | 0.01%    |
|                  | 合计           | 3,218,988.43 | 0.03%    |

### 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、基金投资和研究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

| 项目                            | 华安安康灵活配置混合 A     | 华安安康灵活配置混合 C     |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2018 年 8 月 9 日）基金份额总额 | 467,323,966.62   | 101,632,986.94   |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 8,072,756,041.15 | 2,231,309,704.35 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 2,949,993,577.30 | 1,738,642,014.67 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,935,057,194.96 | 1,932,358,115.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 8,087,692,423.49 | 2,037,593,603.78 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|        |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安证券 | 1      | 1,707,651,001.33 | 17.00%       | 1,558,978.72 | 16.90%     | -  |
| 华泰证券   | 1      | 1,609,508,163.12 | 16.02%       | 1,466,749.86 | 15.90%     | -  |
| 中信证券   | 1      | 1,241,256,394.70 | 12.35%       | 1,155,981.72 | 12.53%     | -  |

|        |   |                  |        |              |        |   |
|--------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 民生证券   | 1 | 1,146,567,949.09 | 11.41% | 1,057,098.32 | 11.46% | - |
| 东吴证券   | 1 | 1,025,559,364.15 | 10.21% | 936,314.14   | 10.15% | - |
| 德邦证券   | 1 | 836,504,447.54   | 8.33%  | 779,047.36   | 8.45%  | - |
| 招商证券   | 1 | 598,218,221.90   | 5.95%  | 551,142.57   | 5.98%  | - |
| 东方财富   | 1 | 595,918,961.55   | 5.93%  | 543,557.95   | 5.89%  | - |
| 华创证券   | 1 | 435,188,529.65   | 4.33%  | 405,287.56   | 4.39%  | - |
| 广发证券   | 1 | 407,453,132.25   | 4.06%  | 371,311.92   | 4.03%  | - |
| 申港证券   | 1 | 159,737,151.41   | 1.59%  | 147,166.93   | 1.60%  | - |
| 华西证券   | 1 | 159,172,981.95   | 1.58%  | 134,565.00   | 1.46%  | - |
| 国金证券   | 2 | 114,506,107.97   | 1.14%  | 106,638.26   | 1.16%  | - |
| 中金公司   | 1 | 10,626,556.64    | 0.11%  | 9,895.88     | 0.11%  | - |
| 银河证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 财富里昂   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中泰证券   | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 华融证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 恒泰证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 申万宏源   | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 安信证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中银国际   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 川财证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 瑞银证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 天风证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 开源证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中信建投   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 红塔证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 信达证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 东北证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 长江证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 国信证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 广发华福证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 华金证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中金财富证券 | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 北京高华证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 兴业证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 东兴证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 国都证券   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 上海证券   | 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：

无

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易         |              | 回购交易             |              | 权证交易 |              |
|--------|--------------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
|        | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安证券 | 1,874,718.65 | 2.21%        | -                | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -            | -            | -                | -            | -    | -            |
| 中信证券   | -            | -            | 3,107,714,000.00 | 49.43%       | -    | -            |
| 民生证券   | 23,373,412.0 | 27.56%       | 2,058,800,       | 32.74%       | -    | -            |

|        |                   |        |                      |        |   |   |
|--------|-------------------|--------|----------------------|--------|---|---|
|        | 0                 |        | 000.00               |        |   |   |
| 东吴证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 德邦证券   | 4,858,685.90      | 5.73%  | -                    | -      | - | - |
| 招商证券   | 1,602,700.00      | 1.89%  | -                    | -      | - | - |
| 东方财富   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 华创证券   | 3,098,000.00      | 3.65%  | -                    | -      | - | - |
| 广发证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 申港证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 华西证券   | -                 | -      | 1,120,900,<br>000.00 | 17.83% | - | - |
| 国金证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 中金公司   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 银河证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 财富里昂   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 中泰证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 华融证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 恒泰证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 申万宏源   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 安信证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 中银国际   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 川财证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 瑞银证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 天风证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 开源证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 中信建投   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 红塔证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 信达证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 东北证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 长江证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 国信证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 广发华福证券 | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 华金证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 中金财富证券 | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 北京高华证券 | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 兴业证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 东兴证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 国都证券   | -                 | -      | -                    | -      | - | - |
| 上海证券   | 50,007,472.6<br>1 | 58.96% | -                    | -      | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                     | 法定披露方式                  | 法定披露日期     |
|----|------------------------------------------|-------------------------|------------|
| 1  | 华安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-06 |
| 2  | 华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（天岳先进）       | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-06 |
| 3  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别份额相互转换业务的公告  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-13 |
| 4  | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告         | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-21 |
| 5  | 华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告     | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-26 |
| 6  | 关于华安旗下部分基金增加农业银行为销售机构的公告                 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-01-27 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别份额相互转换业务的公告  | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-02-12 |
| 8  | 华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（万控智造）       | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-04 |
| 9  | 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 |
| 10 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（泰恩康）        | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-23 |
| 11 | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告             | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-03-30 |
| 12 | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告         | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-04-21 |
| 13 | 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 |
| 14 | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金更新                      | 中国证监会基金电子披              | 2022-05-30 |

|    |                                           |                         |            |
|----|-------------------------------------------|-------------------------|------------|
|    | 的招募说明书(2022 年第 1 号)                       | 露网站和公司网站等指定媒介           |            |
| 15 | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金(华安安康灵活配置混合 A)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-05-30 |
| 16 | 华安安康灵活配置混合型证券投资基金(华安安康灵活配置混合 C)基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2022-05-30 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日