

华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中  
基金（FOF）

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 11 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华安养老目标 2035 三年持有混合发起式（FOF）   |
| 基金主代码      | 016271   |
| 交易代码       | 016271   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2023 年 1 月 11 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 55,860,541.92 份  |
| 投资目标       | 在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。   |
| 投资策略       | <p>本基金为养老目标日期策略基金，基金资产根据华安养老目标日期基金设定的下滑曲线进行动态配置调整，即随着投资人生命周期的变化以及目标日期的临近（本基金为 2035 年），本基金投资风格相应由“进取”，进而转变为“稳健”，最后转变为“保守”，逐步降低权益类资产（包括股票、股票型基金、最近连续四个季度披露的基金定期报告中显示股票投资比例不低于基金资产的 60%或在基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产的 60%的混合型基金）的配置比例，增加固定收益类资产等非权益类资产的配置比例。本基金下滑曲线的设计理念是基于投资人随着年龄增长和退休日期的临近，风险承受能力趋于减弱，对于收益稳健性的偏好趋于提升。我们认为投资人投资养老目标日期基金，在初始阶段追求获利水平和资产增值，因此保持较高的权益类资产目标权重配置中枢；中期阶段追求稳健配置基础上的收益增厚，对于资产</p> |

|               |   |
|---------------|---|
|               | <p>保值需求逐步提高，相应权益类资产目标权重配置中枢逐步下降；最后阶段追求已有资产的保值，固定收益类资产等非权益类资产的配置将占主导地位，投资组合整体风险随着时间的推移逐渐减少，以实现养老金投资积累的到期目标。</p> <p>在实际管理过程中，本基金具体各类资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场阶段性变化，在限定范围内做适度主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的平衡。</p> <p>本基金将在下滑曲线基础上，严格控制基金组合回撤，精选符合本基金投资目标的标的基金，来构建投资组合。基金管理人可以对招募说明书中披露的下滑曲线进行调整，实际投资与预设的下滑曲线可能存在差异。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p><math>[中证 800 指数收益率 \times 90\% + 恒生指数收益率(使用汇率估值折算) \times 10\%] \times X + 中债综合财富(总值)指数收益率 \times (1-X)</math></p> <p>其中, X 值为本基金各阶段权益类资产(包括股票、股票型基金、最近连续四个季度披露的基金定期报告中显示股票投资比例不低于基金资产的 60%或在基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产的 60%的混合型基金)配置中枢。(配置中枢详见基金合同)</p>  |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金为混合型基金中基金（FOF），其风险与预期收益高于债券型基金中基金、货币市场型基金中基金，低于股票型基金中基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则</p>  |

|       |             |
|-------|-------------|
|       | 等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司  |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司  |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2023 年 1 月 11 日（基金合同生效日）-2023 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | -43,759.53  |
| 2.本期利润         | -74,299.93  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0058   |
| 4.期末基金资产净值     | 55,100,986.86                                     |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9864  |

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

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

3、本基金于 2023 年 1 月 11 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|-----------|-----|-----|
|    |        |           |            |           |     |     |

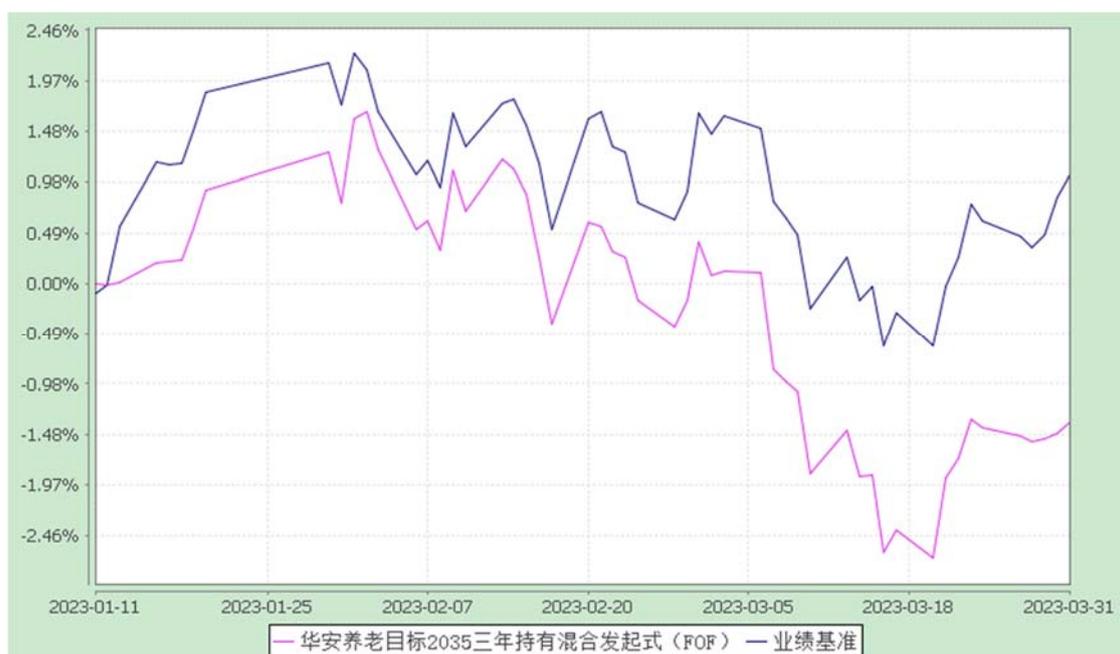
|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
|            |        |       |       | ④     |        |       |
| 过去三个月      | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去六个月      | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去一年       | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去三年       | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去五年       | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | -1.36% | 0.42% | 1.06% | 0.41% | -2.42% | 0.01% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 1 月 11 日至 2023 年 3 月 31 日)



注：1、本基金于 2023 年 1 月 11 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年；

2、根据本基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------|-------------|------|--------|---|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 何移直 | 本基金的基金经理 | 2023-01-11  | -    | 30 年   | 博士研究生，30 年金融相关行业从业经验。曾任东海明珠期货经纪有限公司证券分析师、光彩事业投资管理集团投资主管、中国网络通信股份有限公司高级经理、荷兰 APX 交易所集团数量风险分析师、荷兰 Nidera 交易集团投资风险分析师、金思维投资咨询（上海）有限公司。2010 年 9 月加入华安基金，历任风险管理部高级总监、企业发展部高级总监、专户量化部总监。现任基金组合投资部基金经理。2019 年 4 月起担任华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2020 年 12 月起，同时担任华安平衡养老目标 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | <p>三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2022 年 9 月起，同时担任华安积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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。本基金个别指标因交易所清算款的原因导致不符合基金合同并已于次日调整至合规。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致

不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 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 2 次，未出现异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度，国内疫情封控放开后，出行快速恢复，经济活动强度迅速提升，市场对疫后经济的修复预期一度非常乐观。两会之后，强预期逐渐回落。前两个月的经济数据显示国内经济全面温和复苏，3 月份全面降准政策落地，货币市场宽松为主，流动性充裕。美国通胀回落，但幅度有限，离 2% 的政策目标尚路途遥远。美欧部分银行出现流动性危机，美联储鹰派气氛受到打击，预期的终极利率降低，市场已经押注年末开始降息。

A 股市场整体呈现冲高回落走势。报告期间，万得全 A 指数上涨 6.47%，TMT 行业指数上涨 24.61%。房地产、银行、新能源板块出现小幅下跌。

一季度债券收益率也走出冲高回落的态势，但变动幅度不大。10 年期国债收益率中枢从 2.82% 的低点上行到 2.92%，季末回落到 2.85% 左右的水平。

报告期内基金规模保持平稳，产品处于逐步建仓期，权益市场震荡上行，权益资产配置仓位也逐级抬升，总权益仓位略低于基金合同约定的中枢。配置结构保持与业绩比较基准同步。纯债部分资产以均衡配置为主。固收+部分配置基金

多为中长期收益-风险性价比较好的品种，贡献了一定的超额收益。权益方面，管理人会在今后的操作中，紧密跟踪市场情绪、拥挤度等指标变化，持续优化配置结构，结合行业、风格配置模型，优选配置基金、增加产品的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 3 月 31 日，本基金份额净值为 0.9864 元，本报告期份额净值增长率为-1.36%，同期业绩比较基准增长率为 1.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度以来，国内外经济环境出现了两个重要的变化。国内最重要的变化是疫情封控的全面放开，困扰三年的新冠疫情终于迎来了根本性的放开，PMI 指数全面回升，对经济恢复的预期迅速升温。两会之后，强预期逐渐向弱现实收敛，A 股进入窄幅震荡阶段。

国际上最重要的变化是美联储加息遇到阻力，美欧部分银行相继出现流动性危机，金融系统的安全性问题降低了美联储的鹰派声调，市场抢跑开始交易年内转向到降息进程。

两会结束，新一届政府开局呈现出稳中求进基调，政策层面以延续前阶段财政和货币政策为主，预计经济复苏的斜率较为平缓。

A 股市场中枢较年初有所提升，但幅度不大，估值水平仍处于历史较低分位数，季末外资持续回流反映了 A 股市场的吸引力。

风格配置方面，总体上坚持均衡化的配置思路。在经济平稳复苏的阶段，结构性机会较多，风格配置上价值风格确定性更高。

在行业配置方面，重点关注与数字经济和安全发展关系密切的成长性行业，如科技，医疗，景气度高且具备一定持续性的高端制造行业，以及与经济复苏相关的消费、地产链相关行业。

大宗商品方面，在美债实际收益率回落、美元指数向下的背景下，仍看好黄金等贵金属商品的后续上涨机会。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式证券投资基金。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -            |
|    | 其中：股票             | -             | -            |
| 2  | 基金投资              | 24,983,913.47 | 32.21        |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 15,414,000.00 | 19.87        |
|    | 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      | 33,173,103.47 | 42.76        |
| 8  | 其他各项资产            | 4,001,475.98  | 5.16         |
| 9  | 合计                | 77,572,492.92 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,283.64     |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,000,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | 192.34       |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,001,475.98 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

## §6 基金中基金

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

| 序号 | 基金代码   | 基金名称    | 运作方式 | 持有份额(份)      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|---------|------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 006337 | 华安安浦债券A | 开放式  | 1,866,413.71 | 2,011,060.77 | 3.65%        | 是                      |
| 2  | 511880 | 银华日利货币  | 开放式  | 20,000.00    | 2,010,640.00 | 3.65%        | 否                      |

|    |        | A              |     |              |              |       |   |
|----|--------|----------------|-----|--------------|--------------|-------|---|
| 3  | 510300 | 华泰柏瑞沪深300ETF   | 开放式 | 488,100.00   | 1,976,805.00 | 3.59% | 否 |
| 4  | 510500 | 南方中证500ETF     | 开放式 | 281,600.00   | 1,790,694.40 | 3.25% | 否 |
| 5  | 519782 | 交银裕隆纯债债券 A     | 开放式 | 1,159,148.11 | 1,501,212.72 | 2.72% | 否 |
| 6  | 011321 | 国泰大健康股票 C      | 开放式 | 493,429.60   | 1,454,630.46 | 2.64% | 否 |
| 7  | 519756 | 交银国企改革灵活配置混合 A | 开放式 | 743,383.34   | 1,446,029.27 | 2.62% | 否 |
| 8  | 540002 | 汇丰晋信龙腾混合       | 开放式 | 769,609.94   | 1,437,323.52 | 2.61% | 否 |
| 9  | 002910 | 易方达供给改革混合      | 开放式 | 505,354.98   | 1,394,476.53 | 2.53% | 否 |
| 10 | 511360 | 海富通中证短融 ETF    | 开放式 | 13,000.00    | 1,388,400.00 | 2.52% | 否 |

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2023 年 1 月 11 日（基金合同生效日）-2023 年 3 月 31 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）      | 6,271.35   | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）      | -  | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 3,398.29   | 463.88                          |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 15,988.02  | 2,393.17                        |
| 当期持有基金产生的应支          | 2,888.80   | 555.84                          |

|                 |        |       |
|-----------------|--------|-------|
| 付托管费（元）         |        |       |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | 303.83 | 66.40 |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

## §7 开放式基金份额变动

单位：份

|                         |               |
|-------------------------|---------------|
| 基金合同生效日基金份额总额           | 10,105,117.99 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额   | 45,755,423.93 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | -             |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额  | -             |
| 本报告期期末基金份额总额            | 55,860,541.92 |

## §8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 基金合同生效日管理人持有的本基金份额       | 10,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额   | 45,684,263.96 |
| 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额   | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 55,684,263.96 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 99.68         |

## 8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）       | 交易金额（元）       | 适用费率  |
|----|------|------------|---------------|---------------|-------|
| 1  | 认购   | 2023-01-06 | 10,000,000.00 | 10,001,000.00 | 0.01% |
| 2  | 申购   | 2023-03-29 | 45,684,263.96 | 45,000,000.00 | -     |
| 合计 |      |            | 55,684,263.96 | 55,001,000.00 |       |

## §9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 55,684,263.96 | 99.68%       | 10,000,000.00 | 17.90%       | 三年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 55,684,263.96 | 99.68%       | 10,000,000.00 | 17.90%       | -          |

## §10 影响投资者决策的其他重要信息

### 10.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |      |               |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|--------------------------|------|---------------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间 | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20230111-20230331        | 0.00 | 55,684,263.96 | 0.00 | 55,684,263.96 | 99.68% |

产品特有风险

本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。

## 10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- 2、《华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》
- 3、《华安养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

### 11.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二三年四月二十一日