

华安添禧一年持有期混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安添禧一年混合
基金主代码	010522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 4 日
报告期末基金份额总额	324,127,162.24 份
投资目标	本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，给出股票、债券和货币市场工具等大类资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。

业绩比较基准	中证 800 指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×85%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安添禧一年混合 A	华安添禧一年混合 C
下属分级基金的交易代码	010522	010523
报告期末下属分级基金的份额总额	309,170,068.60 份	14,957,093.64 份

§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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)	
	华安添禧一年混合 A	华安添禧一年混合 C
1.本期已实现收益	1,722,686.79	61,463.27
2.本期利润	4,362,874.10	174,628.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0125	0.0106
4.期末基金资产净值	310,344,609.55	14,904,637.08
5.期末基金份额净值	1.0038	0.9965

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。

3.2 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

1、华安添禧一年混合 A：

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 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.01%	0.20%	1.07%	0.12%	-0.06%	0.08%
过去六个月	0.50%	0.19%	0.86%	0.15%	-0.36%	0.04%
过去一年	1.94%	0.19%	0.15%	0.17%	1.79%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.38%	0.17%	-1.00%	0.17%	1.38%	0.00%

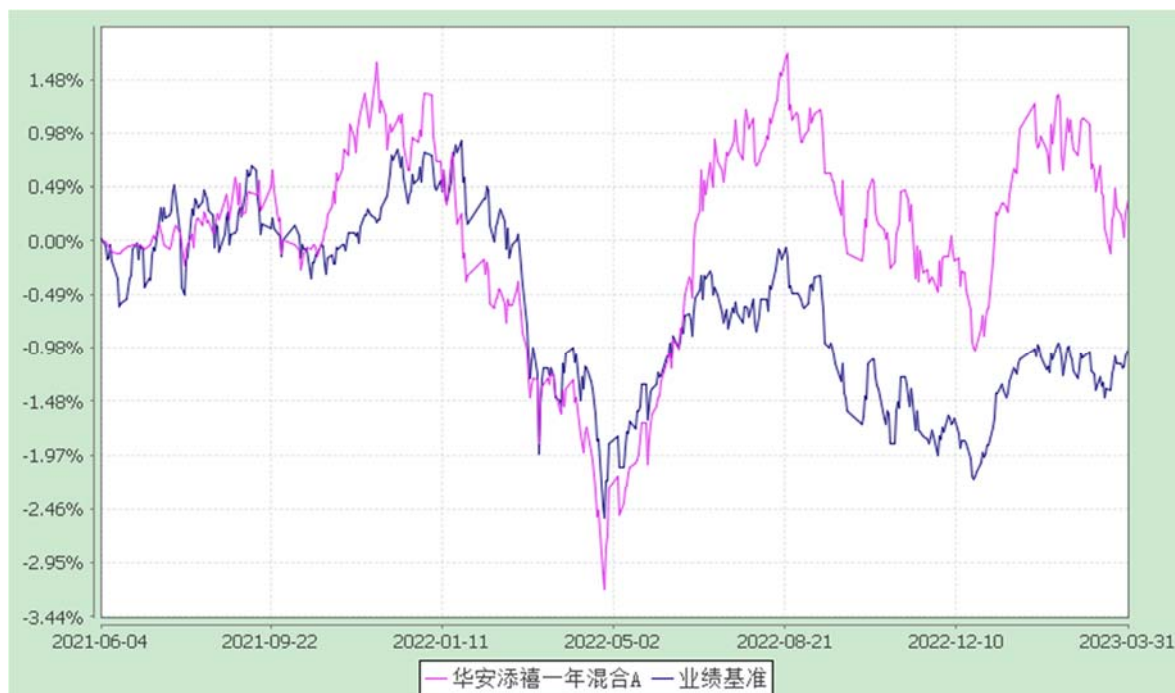
2、华安添禧一年混合 C：

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 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.91%	0.20%	1.07%	0.12%	-0.16%	0.08%
过去六个月	0.30%	0.19%	0.86%	0.15%	-0.56%	0.04%
过去一年	1.53%	0.19%	0.15%	0.17%	1.38%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-0.35%	0.17%	-1.00%	0.17%	0.65%	0.00%

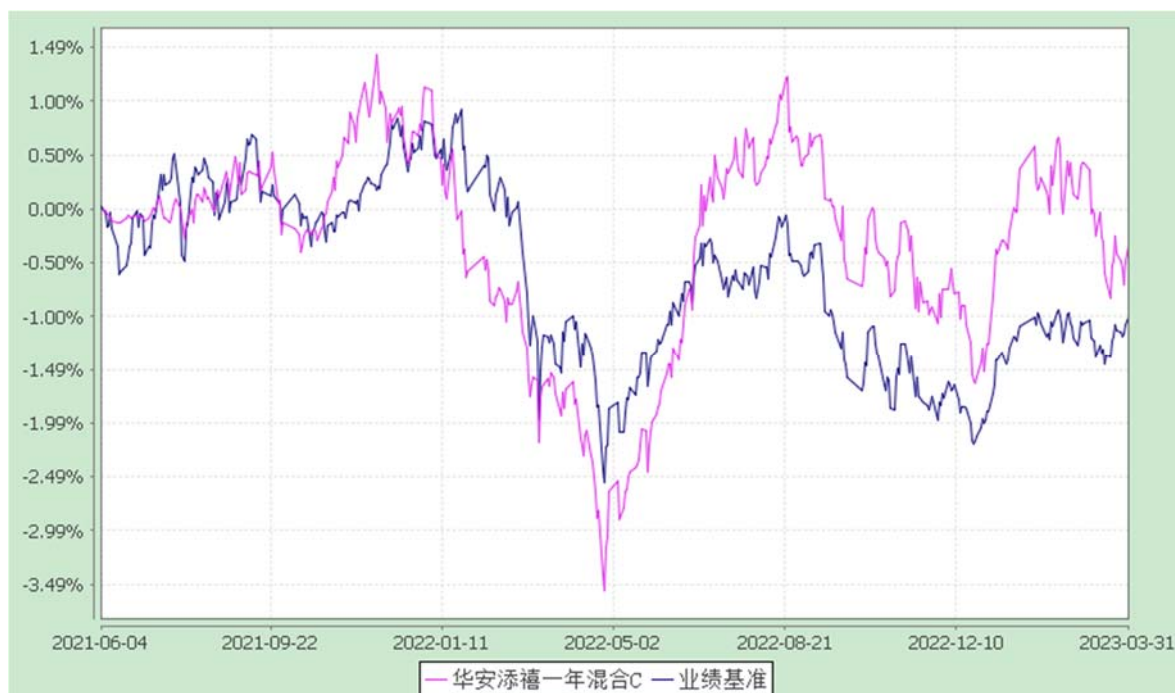
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安添禧一年持有期混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021 年 6 月 4 日至 2023 年 3 月 31 日)

1. 华安添禧一年混合 A：



2. 华安添禧一年混合 C:



§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	证券从业	说明
----	----	------------	------	----

		限		年限	
		任职日期	离任日期		
舒灏	本基金的基金经理	2021-06-04	-	14 年	<p>硕士研究生，14 年证券、基金行业从业经验。曾任海通证券股份有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 7 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2022 年 3 月，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起，同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起，同时担任华安安利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起，同时担任华安鼎安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
郑可成	本基金的基金经理、固定收益部副总监	2021-06-04	2023-03-28	21 年	<p>硕士研究生，21 年证券基金从业经历。曾任闽发证券有限责任公司高级研究员，益民基金管理有限公司基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月至 2023 年 3 月，担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月至 2023 年 3 月，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月至 2019 年 2 月，同时担任华安</p>

				<p>信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月至 2019 年 4 月，同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2023 年 3 月，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月至 2019 年 12 月，同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月至 2022 年 5 月，同时担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2018 年 6 月，同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2019 年 12 月同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月至 2018 年 5 月，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月至 2018 年 1 月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 月，同时担任华安添禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金</p>
--	--	--	--	--

					<p>的基金经理。2017 年 2 月至 2022 年 9 月,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 8 月,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 3 月,同时担任华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金的基金经理。2021 年 3 月至 2023 年 3 月,同时担任华安添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月至 2023 年 3 月,同时担任华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
周益鸣	本基金的基金经理	2023-03-28	-	14 年	<p>硕士, 14 年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010 年 6 月加入华安基金, 历任集中交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2018 年 6 月起,担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2020 年 10 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。2019 年 7 月至 2021 年 3 月,同时担任华安安业债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月,同时担任华安和债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起,同时担任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 4 月至 2021 年 5 月,同时担任华安安敦债券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 3 月去,同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经</p>

					理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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

2022 年底我国疫情防控政策优化后，2023 年初我国经济得到一定修复，A 股各指数从 22 年底开始迎来阶段性上涨，持续到 2023 年 1 月底。此后市场上涨趋缓，上证综指 2-3 月基本横盘，沪深 300、创业板指数都有所下跌。下跌原因我们认为有两点：一是海外经济扰动，美元加息，以及硅谷银行破产等事件引发市场对金融风险的担忧；二是市场对国内经济复苏持续性的观望态度。

从行情结构看，一季度市场热点主要在科技板块和“中特估”相关行业。在 ChatCPT 为代表的的人工智能概念持续上涨。在一带一路、中国特色估值体系概念催化下，相关央企也进行了一轮补涨行情。

今年一季度债券市场利率整体是先上后下的走势，与之对应的是市场对于宏观经济的判断在强预期和弱现实之间摇摆。春节之前，随着北京等地出行消费的恢复，市场对于全年的经济预期有所上调，利率在此期间小幅走高，但节后随着消费数据并没有超预期上行，同时部分城市二手房带看量和成交在 3 月有所下降，导致利率走势重新回归到弱现实的轨道上。由于去年四季度信用债调整幅度较大，今年以来信用利差得以压缩，因此一季度信用债表现整体强于利率债。可转债类资产在一季度有不错的表现，受益于股市的上涨而上行，同时转股溢价率并没有出现明显的压缩，维持在相对高位，我们认为支撑溢价率高位震荡的重要因素是相对偏低的利率环境。

本基金 2023 年一季度整体维持了中性偏高仓位，仓位仍主要集中在军工板块。从基本面看，军工板块主要公司的订单和需求仍稳健增长，未来几年的行业需求确定，业绩值得期待，也是国家政策重点支持的板块，目前估值已经具备较强的投资价值。

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 A 类份额净值为 1.0038 元，本报告期份额净值增长率为 1.01%；本基金 C 类份额净值为 0.9965 元，本报告期份额净值增长率为 0.91%。同期业绩比较基准增长率为 1.07%。

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 2023 年，我们判断指数下跌空间很有限，一是因为目前 A 股整体估值处于历史较低水平，相对其他大类资产具备较好的估值优势；二是国内经济处于触底回升阶段，在地产政策逐渐松绑，疫情政策有序放开的背景下，2023 年经济将逐步回暖，年初货币政策和财政政策也有望维持相对宽松的水平，在此背景下，指数下跌空间有限。

市场风格上，去年下半年以来，市场整体维持轮动态势，去年四季度在疫情政策优化、地产政策密集出台的背景下，大消费和大金融板块表现突出，今年一季度在人工智能一系列事件刺激下，科技股相对强势。市场轮动表现的原因有两点：一是经济虽处于复苏阶段，但尚未传导到上市公司业绩，此轮经济周期的强度还存在较大争议；二是之前热门赛道基本面出现反复，市场没有一致看好的方向。目前市场依然处于这种状态，因此我们判断市场风格仍有可能出现切换。

目前人工智能相关题材受市场关注度较高，这可能是长期影响全社会生产力的重大因素，也是我国政策重点支持的方向，长期想象空间的确很大，对很多行业也会造成深远的影响。但国内

相关公司短期还难以看到业绩兑现，受益情况还多停留在理论测算上，经过一轮估值的大幅提升后，行情持续性还有待观察。目前我们已经看到地产销售、新开工等数据出现好转迹象，进入二季度，我们将进一步观察经济是否有超预期复苏的可能。如果传统经济领域数据出现超预期的强势，市场风格可能再次切换。

因此，我们目前对高科技和传统行业都将保持密切关注，落实到具体行业上，我们还是要寻找景气度向上，且具备长期成长空间的行业，2023 年我们看好的几个方向：一是军工，相比其他成长板块，军工的业绩确定性更高，估值也具备优势；二是部分景气度向上的高端制造行业，如部分计算机子行业，油气装备等；三是地产及相关产业链行业。

展望二季度债市，首先是海外经济和金融环境依然存在较大不确定性。美国近期的就业和制造业数据都开始有所下滑，同时 SVB 事件导致银行存款大幅流向货币市场基金，但货币市场基金的投资会使得资金再度回流到银行体系，并没有完全消除风险。再看国内方面，需要观察房地产销售数据能否持续改善。而消费方面，由于去年二季度的低基数效应，叠加近期出入境旅游等限制政策的放松，预计会有不错的增长。整体看，国内经济向好的概率偏大，债券市场利率下行空间可能有限。

未来本基金将维持中性偏高仓位，采用均衡配置的策略，力求在控制回撤的情况下，取得较高投资收益。

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 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	60,360,371.78	18.41
	其中：股票	60,360,371.78	18.41
2	固定收益投资	260,655,226.52	79.48
	其中：债券	260,655,226.52	79.48

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,786,705.92	1.76
7	其他各项资产	1,150,150.21	0.35
8	合计	327,952,454.43	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

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	2,536,456.00	0.78
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,190,373.70	11.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,884,480.00	0.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,855,516.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,138,373.08	3.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,314,243.00	0.40
L	租赁和商务服务业	4,440,930.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,360,371.78	18.56

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300795	米奥会展	76,700	4,440,930.00	1.37
2	000521	长虹美菱	772,400	4,186,408.00	1.29
3	002179	中航光电	69,048	3,734,115.84	1.15
4	603529	爱玛科技	38,600	2,753,338.00	0.85
5	002463	沪电股份	124,400	2,673,356.00	0.82
6	600536	中国软件	38,200	2,629,306.00	0.81
7	300525	博思软件	108,600	2,546,670.00	0.78
8	001322	箭牌家居	122,600	2,530,464.00	0.78
9	002508	老板电器	73,600	2,087,296.00	0.64
10	600809	山西汾酒	7,400	2,015,760.00	0.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,047,290.41	3.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	250,420,316.91	76.99
	其中：政策性金融债	250,420,316.91	76.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	187,619.20	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	260,655,226.52	80.14
----	----	----------------	-------

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	210203	21 国开 03	900,000	91,882,327.87	28.25
2	200208	20 国开 08	700,000	71,995,517.81	22.14
3	220206	22 国开 06	700,000	71,070,501.37	21.85
4	018008	国开 1802	150,000	15,471,969.86	4.76
5	019688	22 国债 23	100,000	10,047,290.41	3.09

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

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。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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	47,314.67
2	应收证券清算款	1,102,835.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,150,150.21

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安添禧一年混合A	华安添禧一年混合C
本报告期期初基金份额总额	405,866,868.19	18,095,491.07
报告期期间基金总申购份额	162,179.04	9.94
减：报告期期间基金总赎回份额	96,858,978.63	3,138,407.37
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	309,170,068.60	14,957,093.64

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安添禧一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安添禧一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安添禧一年持有期混合型证券投资基金托管协议》

8.2 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>。

8.3 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