

# 华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 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         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <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合规守信情况的说明 .....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 10        |
| 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 .....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 13        |
| 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 .....       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 13        |
| 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 ..... | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....      | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 14        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表 .....                              | 17        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 39        |
| 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 .....       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 43        |
| 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 .....      | 43        |
| 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 .....   | 43        |
| 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 .....   | 43        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 43        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 43        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 44        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 45        |
| 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情况 .....   | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 46        |
| 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 .....   | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 48        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>49</b> |
| 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 ..... | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 49        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 50        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 50        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 华安沣荣一年持有混合         |                 |
| 基金主代码           | 016861             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2023 年 6 月 20 日    |                 |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 上海银行股份有限公司         |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 88,200,552.40 份    |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安沣荣一年持有混合 A       | 华安沣荣一年持有混合 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 016861             | 016862          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 41,142,010.17 份    | 47,058,542.23 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险及基金净值波动率的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略   | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、大类资产配置策略</li> <li>2、债券和资产支持证券投资策略</li> <li>3、股票投资策略</li> <li>4、存托凭证投资策略</li> <li>5、股指期货投资策略</li> <li>6、国债期货投资策略</li> <li>7、参与融资业务投资策略</li> </ol> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率×85%+中证 800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%  |
| 风险收益特征 | <p>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。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，将面临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等差异带来的特有风险。</p>  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                 | 基金托管人             |
|---------|------|-----------------------|-------------------|
| 名称      |      | 华安基金管理有限公司            | 上海银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨牧云                   | 周直毅               |
|         | 联系电话 | 021-38969999          | 021-68475608      |
|         | 电子邮箱 | service@huanan.com.cn | custody@boscn.com |
| 客户服务电话  |      | 4008850099            | 95594             |

|       |  |                              |
|-------|--|------------------------------|
| 传真    | 021-68863414                             | 021-68476901                 |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号      |
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层    | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层 |
| 邮政编码  | 200120                                   | 200120                       |
| 法定代表人 | 朱学华                                      | 金煜                           |

## 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          | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层 |

## 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 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层 |

## § 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<br>据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |              |
|-------------------|-------------------------------------|--------------|
|                   | 华安沣荣一年持有混合 A                        | 华安沣荣一年持有混合 C |
| 本期已实现收益           | -149,285.16                         | -438,695.23  |
| 本期利润              | 2,292,716.22                        | 1,190,949.46 |
| 加权平均基金份额<br>本期利润  | 0.0163                              | 0.0138       |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 1.64%                               | 1.39%        |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 1.68%                               | 1.45%        |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |              |

|              |                  |               |
|--------------|------------------|---------------|
| 期末可供分配利润     | 203,693.03       | -20,674.20    |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0050           | -0.0004       |
| 期末基金资产净值     | 41,416,701.63    | 47,114,484.05 |
| 期末基金份额净值     | 1.0067           | 1.0012        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率  | 0.67%            | 0.12%         |

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，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

华安沣荣一年持有混合 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      | 0.08%    | 0.08%       | 0.04%      | 0.08%         | 0.04%  | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.96%    | 0.13%       | 0.96%      | 0.11%         | 0.00%  | 0.02% |
| 过去六个月      | 1.68%    | 0.19%       | 2.19%      | 0.14%         | -0.51% | 0.05% |
| 过去一年       | 0.65%    | 0.16%       | 1.28%      | 0.14%         | -0.63% | 0.02% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 0.67%    | 0.16%       | 1.01%      | 0.14%         | -0.34% | 0.02% |

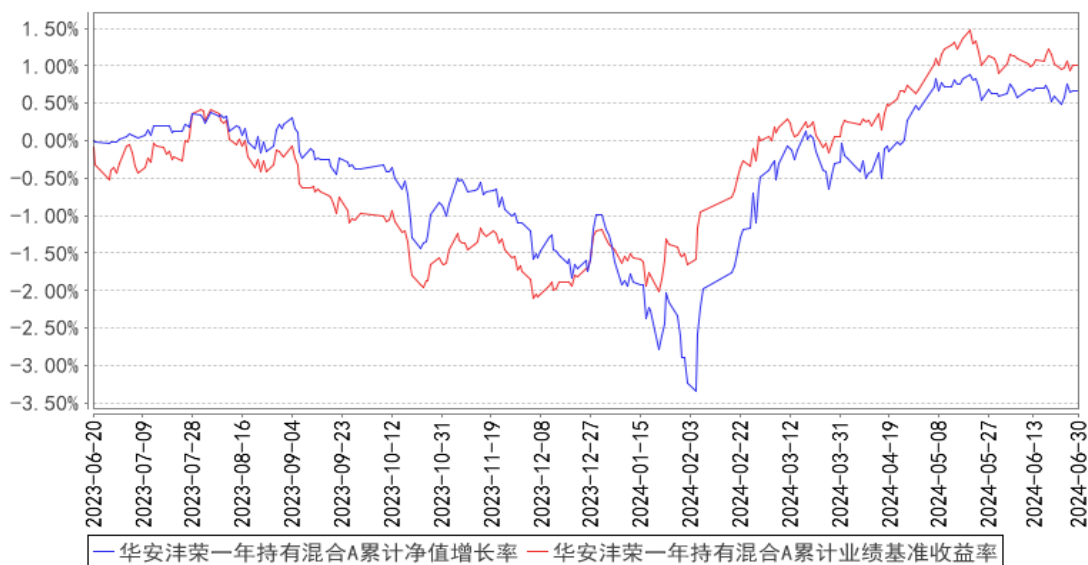
华安沣荣一年持有混合 C

| 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

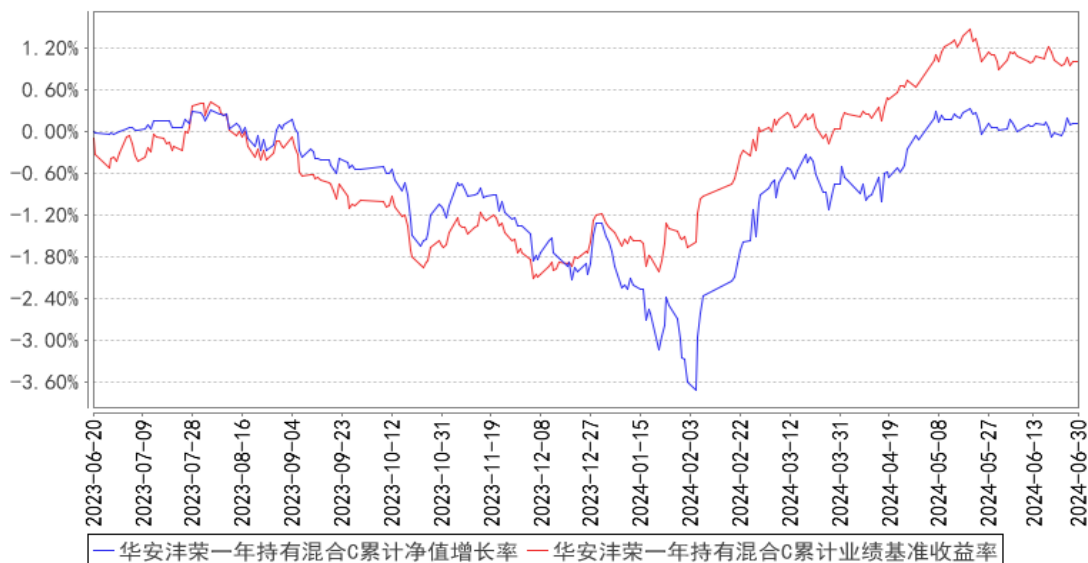
|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.10% | 0.08% | 0.04% | 0.08% | 0.06%  | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.89% | 0.13% | 0.96% | 0.11% | -0.07% | 0.02% |
| 过去六个月      | 1.45% | 0.19% | 2.19% | 0.14% | -0.74% | 0.05% |
| 过去一年       | 0.12% | 0.16% | 1.28% | 0.14% | -1.16% | 0.02% |
| 过去三年       | -     | -     | -     | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 0.12% | 0.16% | 1.01% | 0.14% | -0.89% | 0.02% |

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

华安沣荣一年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华安沣荣一年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在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 2024 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 263 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,651.01 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 |        |   |
| 吴文明 | 本基金的基金经理 | 2023 年 6 月 20 日 | -    | 14 年   | 14 年金融、基金行业从业经验。曾任威海市商业银行交易员、银华基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、银华基金管理股份有限公司投资管理三部基金经理。2021 年 7 月加入华安基金，现任绝对收益投资部基金经理。2021 年 11 月起担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月起，同时担任华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安沣悦债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起，同时担任华安沣裕债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安招裕一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起，同时担任华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起，同时担任华安沣润债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起，同时担任华安季季鑫 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 张瑞  | 本基金的基金经理 | 2023 年 7 月 6 日  | -    | 5 年    | 硕士研究生，5 年基金行业从业经验。曾任工银瑞信基金管理有限公司 FOF 投资   |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 部高级研究员，2022 年 1 月加入华安基金，任职于绝对收益投资部。2022 年 5 月起担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金、华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金、华安新动力灵活配置混合型证券投资基金、华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起，同时担任华安沣荣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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。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比例分配原则进行分配。（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。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 0 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

上半年总量经济数据平稳，但结构分化，生产强于需求，房地产处在低位，消费下滑，制造业投资有一定韧性。2024 年上半年国内生产总值同比增长 5.0%，第二季度 GDP 同比增长 4.7%，较一季度同比增速回落 0.6 个百分点。从生产端看，上半年工业增加值同比增长 6.0%，较 1-5 月增速回落 0.2 个百分点，整体平稳。从需求端看，上半年固定资产投资同比增长 3.9%，其中制造业投资增速 9.5%，保持在较高水平；基建投资增长 5.4%；地产投资同比下滑 10.1%，处在低位，二季度地产政策进一步放松，效果有待进一步观察。出口方面，上半年以美元计价的出口同比增长 3.6%。消费方面，上半年社零同比增长 3.7%，增速较 1-5 月下滑 0.4 个百分点，消费偏弱。

上半年，央行下调存款准备金率 0.5 个百分点，5 年期 LPR 下调 25bp，一季度、二季度 DR001 均值分别为 1.71%、1.78%，流动性保持合理充裕。二季度，央行把买卖国债纳入货币政策工具箱，基础货币投放渠道和流动性管理手段有所丰富。央行未来以某个短期操作利率为主要政策利率，7 天逆回购操作利率重要性抬升，MLF 重要性下降。

债券市场方面，上半年收益率下行幅度较大，中长端信用债表现突出、曲线平坦化下行，信用利差压缩。截至 6 月底，1Y 国开债较上年末下行 51bp 至 1.69%，10Y 国开债收益率较上年末下行 39bp 至 2.29%；1YAAA 中票收益率下行 51bp 至 2.02%，5Y AAA 中票收益率下行 67bp 至 2.26%。策略上，本基金灵活调整久期和杠杆，精选品种和个券增厚收益。

股票市场方面，上半年走势偏震荡，结构分化大。从指数表现来看，主要宽基指数涨少跌多，其中，上证 50 和沪深 300 实现小幅上涨，而中证 1000、科创 50、创业板指和中证 500 等跌幅较大，整体来看，大盘风格相对占优。从行业板块上看，分化更为明显，排名靠前的有银行、煤炭、公用事业、家用电器和石油石化等，排名靠后的有计算机、商贸零售、社会服务、传媒和医药生物等，首尾收益率差距超过 40%，整体来看，红利风格相对占优。上半年股市走的比较顽强，扛住了一轮流动性冲击，而结构分化主要反映的是投资者对企业盈利复苏的分歧和自身风险偏好的差异，从成交水平来看，市场活跃程度一般，存量博弈特征明显。上半年，本基金维持了均衡的行业结构，根据景气度和估值匹配程度，进行了一定结构调整，聚焦于科技成长、金融周期和医药等相关行业。

转债市场方面，上半年震荡调整，与股票市场走势大体匹配，同时又有自己的特征。由于出现了个券违约和退市等相关事件，转债信用风险和流动性风险被市场重点关注，转债价格波动加大。本基金在转债投资上相对谨慎，主要配置了偏债型转债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0067 元，C 类份额净值为 1.0012 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准增长率为 2.19%，C 类份额净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准增长率为 2.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，三中全会强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，宏观政策有望有所加力，不过在“固本培元”的总体政策基调下，政策力度预计温和，关注后续政策推进情况。货币政策预计整体将维持偏宽松基调，央行 7 月降息 10bp 体现逆周期调节的意味，预计后续仍将根据经济形势变化相机逆周期调节。结合产品规模以及债券流动性情况，本基金持仓未来重点关注利率债，组合将灵活调整久期和杠杆，努力为组合创造超额收益。

股票方面，当前 A 股主要宽基指数的估值分位数处于中位数以下，大部分行业估值水平也处在相对低位，未来随着稳增长政策落地，企业盈利增长和市场信心均有支撑，需要多一份耐心，密切关注市场动向，把握配置时机。结构上，重点关注安全和高质量发展主线，长短结合，均衡持仓。

转债方面，个券违约和退市等相关事件冲击之后，转债市场整体的波动可能会加大，结构分化明显，部分转债呈现出一定性价比，关注配置机会。

#### 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、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管

理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安沅荣一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                        |                          |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 1,165,204.69           | 494,824.79               |
| 结算备付金         |            | 1,362,909.05           | 1,827,846.04             |
| 存出保证金         |            | 35,445.66              | 49,665.68                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 75,090,684.46          | 294,284,048.10           |
| 其中：股票投资       |            | 7,862,898.72           | 42,530,375.80            |
| 基金投资          |            | -                      | -                        |
| 债券投资          |            | 67,227,785.74          | 251,753,672.30           |
| 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    | 13,000,361.65          | -                        |
| 债权投资          |            | -                      | -                        |
| 其中：债券投资       |            | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资      |            | -                      | -                        |
| 其他投资          |            | -                      | -                        |
| 其他债权投资        |            | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资      |            | -                      | -                        |
| 应收清算款         |            | 2,203,448.22           | -                        |
| 应收股利          |            | -                      | -                        |
| 应收申购款         |            | -                      | -                        |
| 递延所得税资产       |            | -                      | -                        |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                      | -                        |
| 资产总计          |            | 92,858,053.73          | 296,656,384.61           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>              |

|             |         | 2024 年 6 月 30 日 | 2023 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   |         | -               | 65,328,084.53    |
| 应付清算款       |         | 656.00          | 34.13            |
| 应付赎回款       |         | 3,871,934.65    | -                |
| 应付管理人报酬     |         | 130,269.48      | 156,187.63       |
| 应付托管费       |         | 16,283.69       | 19,523.45        |
| 应付销售服务费     |         | 38,465.30       | 44,114.77        |
| 应付投资顾问费     |         | -               | -                |
| 应交税费        |         | 33,218.73       | 14,422.29        |
| 应付利润        |         | -               | -                |
| 递延所得税负债     |         | -               | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 236,040.20      | 207,042.56       |
| 负债合计        |         | 4,326,868.05    | 65,769,409.36    |
| <b>净资产:</b> |         |                 |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 88,200,552.40   | 233,480,766.08   |
| 其他综合收益      |         | -               | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 330,633.28      | -2,593,790.83    |
| 净资产合计       |         | 88,531,185.68   | 230,886,975.25   |
| 负债和净资产总计    |         | 92,858,053.73   | 296,656,384.61   |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 88,200,552.40 份，其中 A 类基金份额净值 1.0067 元，基金份额总额 41,142,010.17 份；C 类基金份额净值 1.0012 元，基金份额总额 47,058,542.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目            | 附注号     | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 20 日（基<br>金合同生效日）至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|---------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |         | 5,456,092.40                             | 112,023.36  |
| 1. 利息收入        |         | 59,127.26                                | 106,683.68  |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.9 | 27,064.43                                | 37,704.29   |
| 债券利息收入         |         | -  | -   |
| 资产支持证券利<br>息收入 |         | -  | -   |

|                            |            |                     |                  |
|----------------------------|------------|---------------------|------------------|
| 买入返售金融资产收入                 |            | 32,062.83           | 68,979.39        |
| 其他利息收入                     |            | -                   | -                |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 1,325,319.07        | 11,561.07        |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10   | -4,131,075.03       | -6,426.49        |
| 基金投资收益                     |            | -                   | -                |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.11   | 5,205,100.25        | 16,007.56        |
| 资产支持证券投资                   |            | -                   | -                |
| 收益                         |            | -                   | -                |
| 贵金属投资收益                    |            | -                   | -                |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.12   | -                   | -                |
| 股利收益                       | 6.4.7.13   | 251,293.85          | 1,980.00         |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -                   | -                |
| 其他投资收益                     |            | -                   | -                |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.14   | 4,071,646.07        | -6,221.39        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                   | -                |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.15   | -                   | -                |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>1,972,426.72</b> | <b>80,207.22</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 899,064.78          | 51,167.07        |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                   | -                |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 112,383.08          | 6,395.88         |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 255,405.29          | 14,477.69        |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                   | -                |
| 5. 利息支出                    |            | 584,539.07          | 971.44           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 584,539.07          | 971.44           |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.16   | -                   | -                |
| 7. 税金及附加                   |            | 10,482.29           | 25.96            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.17   | 110,552.21          | 7,169.18         |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>3,483,665.68</b> | <b>31,816.14</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                   | -                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>3,483,665.68</b> | <b>31,816.14</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>3,483,665.68</b> | <b>31,816.14</b> |



### 6.3 净资产变动表

会计主体：华安沅荣一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |               |                 |
|--|---------------------------------------|--------|---------------|-----------------|
|  | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 233,480,766.08                        | -      | -2,593,790.83 | 230,886,975.25  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                     | -      | -             | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                     | -      | -             | -               |
| 其他                                       | -                                     | -      | -             | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 233,480,766.08                        | -      | -2,593,790.83 | 230,886,975.25  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                     | -      | 2,924,424.11  | -142,355,789.57 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                     | -      | 3,483,665.68  | 3,483,665.68    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -                                     | -      | -559,241.57   | -145,839,455.25 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 7,208.32                              | -      | 2.48          | 7,210.80        |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                     | -      | -559,244.05   | -145,846,666.05 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                     | -      | -             | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                     | -      | -             | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 88,200,552.40                         | -      | 330,633.28    | 88,531,185.68   |
| 项目                                       | 上年度可比期间                               |        |               |                 |

|  | 2023 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |        |           |                |
|--|---|--------|-----------|----------------|
|  | 实收基金                                      | 其他综合收益 | 未分配利润     | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | -   | -      | -         | -              |
| 加：会计政策变更                                 | -   | -      | -         | -              |
| 前期差错更正                                   | -   | -      | -         | -              |
| 其他                                       | -   | -      | -         | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 233,480,766.08                            | -      | -         | 233,480,766.08 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -   | -      | 31,816.14 | 31,816.14      |
| (一)、综合收益总额                               | -   | -      | 31,816.14 | 31,816.14      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -   | -      | -         | -              |
| 其中：1. 基金申购款                              | -   | -      | -         | -              |
| 2. 基金赎回款                                 | -   | -      | -         | -              |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -   | -      | -         | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -   | -      | -         | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 233,480,766.08                            | -      | 31,816.14 | 233,512,582.22 |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 朱学华      | 朱学华       | 陈松一     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），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〔2022〕2142 号文《关于准予华安沣荣一年持有期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自 2023 年 3 月 15 日至 2023 年 6 月 15 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2023）验字第 60971571\_B05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 6 月 20 日正式生效。本基金为混合型证券投资基金，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 233,358,849.48 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 121,916.60 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 233,480,766.08 元，折合 233,480,766.08 份基金份额，其中 A 类基金份额 145,392,322.86 份，C 类基金份额 88,088,443.22 份。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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购或申购时收取认购费或申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费，而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。

基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于权益类资产（包括股票、可转换债券、可交换债券）的比例占基金资产的 10%-30%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；同业存单投资占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债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

含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债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。本基金业绩比较基准：中债综合全价指数收益率×85%+中证800 指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×5%。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2 号《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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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法》、《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。

#### 6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,165,204.69           |
| 等于：本金          | 1,158,797.14           |
| 加：应计利息         | 6,407.55               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 1,165,204.69           |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |              |              |               |
|---------------|------------------------|--------------|--------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息         | 公允价值         | 公允价值变动        |
| 股票            | 8,529,474.98           | -            | 7,862,898.72 | -666,576.26   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -            | -            | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 29,275.21    | 5,865,151.21 | -1,367.37     |
|               | 银行间市场                  | 5,837,243.37 | 809,634.53   | 61,362,634.53 |
|               |                        |              |              | 88,400.00     |

|        |    |               |            |               |             |
|--------|----|---------------|------------|---------------|-------------|
|        | 场  |               |            |               |             |
|        | 合计 | 66,301,843.37 | 838,909.74 | 67,227,785.74 | 87,032.63   |
| 资产支持证券 |    | -             | -          | -             | -           |
| 基金     |    | -             | -          | -             | -           |
| 其他     |    | -             | -          | -             | -           |
| 合计     |    | 74,831,318.35 | 838,909.74 | 75,090,684.46 | -579,543.63 |

### 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

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 13,000,361.65     | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 13,000,361.65     | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 86,532.60         |
| 其中：交易所市场    | 78,511.82         |
| 银行间市场       | 8,020.78          |
| 应付利息        | -                 |
| 预提审计费       | 89,835.26         |
| 预提信息披露费     | 59,672.34         |
| 合计          | 236,040.20        |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元



| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 145,392,322.86                        | 145,392,322.86  |
| 本期申购          | 12.85                                 | 12.85           |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -104,250,325.54                       | -104,250,325.54 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -               |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -               |
| 本期申购          | -                                     | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -               |
| 本期末           | 41,142,010.17                         | 41,142,010.17   |

华安沣荣一年持有混合 C

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 88,088,443.22                         | 88,088,443.22  |
| 本期申购          | 7,195.47                              | 7,195.47       |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -41,037,096.46                        | -41,037,096.46 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 47,058,542.23                         | 47,058,542.23  |

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

单位：人民币元

华安沣荣一年持有混合 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 1,455,877.41  | -2,898,142.45 | -1,442,265.04 |
| 加：会计政策变更       | -             | -             | -             |
| 前期差错更正         | -             | -             | -             |
| 其他             | -             | -             | -             |
| 本期期初           | 1,455,877.41  | -2,898,142.45 | -1,442,265.04 |
| 本期利润           | -149,285.16   | 2,442,001.38  | 2,292,716.22  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,102,899.22 | 527,139.50    | -575,759.72   |
| 其中：基金申购款       | 0.11          | 0.01          | 0.12          |
| 基金赎回款          | -1,102,899.33 | 527,139.49    | -575,759.84   |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 203,693.03    | 70,998.43     | 274,691.46    |

华安沣荣一年持有混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |             |               |               |
|----------------|-------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 601,521.46  | -1,753,047.25 | -1,151,525.79 |
| 加：会计政策变更       | -           | -             | -             |
| 前期差错更正         | -           | -             | -             |
| 其他             | -           | -             | -             |
| 本期期初           | 601,521.46  | -1,753,047.25 | -1,151,525.79 |
| 本期利润           | -438,695.23 | 1,629,644.69  | 1,190,949.46  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -183,500.43 | 200,018.58    | 16,518.15     |
| 其中：基金申购款       | 9.37        | -7.01         | 2.36          |
| 基金赎回款          | -183,509.80 | 200,025.59    | 16,515.79     |
| 本期已分配利润        | -           | -             | -             |
| 本期末            | -20,674.20  | 76,616.02     | 55,941.82     |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |           |
|-----------|----------------------|-----------|
|           | 2024年1月1日至2024年6月30日 |           |
| 活期存款利息收入  |                      | 13,403.49 |
| 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 |                      | 13,416.27 |
| 其他        |                      | 244.67    |
| 合计        |                      | 27,064.43 |

#### 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                   |               |
|------------------|----------------------|---------------|
|                  | 2024年1月1日至2024年6月30日 |               |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 |                      | -4,131,075.03 |
| 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               |                      | -4,131,075.03 |

##### 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                   |               |
|------------|----------------------|---------------|
|            | 2024年1月1日至2024年6月30日 |               |
| 卖出股票成交总额   |                      | 58,970,621.52 |
| 减：卖出股票成本总额 |                      | 62,988,344.40 |

|          |               |
|----------|---------------|
| 减：交易费用   | 113,352.15    |
| 买卖股票差价收入 | -4,131,075.03 |

#### 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>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 4,349,591.20               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 855,509.05                 |
| 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                           | 5,205,100.25               |

##### 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>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 493,838,872.28             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 484,027,884.75             |
| 减：应计利息总额               | 8,946,635.38               |
| 减：交易费用                 | 8,843.10                   |
| 买卖债券差价收入               | 855,509.05                 |

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 251,293.85                 |
| 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            | 251,293.85                 |

## 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 4,071,646.07               |
| 股票投资                   | 3,827,809.06               |
| 债券投资                   | 243,837.01                 |
| 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预估增值税 | -                          |
| 合计                     | 4,071,646.07               |

## 6.4.7.15 其他收入

无。

## 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 29,835.26                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行汇划费   | 2,444.61                   |
| 账户维护费   | 18,000.00                  |
| 其他      | 600.00                     |
| 合计      | 110,552.21                 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司（“华安基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”）   | 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

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 20 日（基金<br>合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 899,064.78                            | 51,167.07  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 388,605.61                            | 22,062.34  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 510,459.17                            | 29,104.73  |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 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                              | 上年度可比期间                                   |
|----------------|---------------------------------|---|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 112,383.08                      | 6,395.88                                  |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

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

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关联方名称 | 本期  |              |            |
|----------------|---|--------------|------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日           |              |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |              |            |
|                | 华安沅荣一年持有混合 A                              | 华安沅荣一年持有混合 C | 合计         |
| 华安基金管理有限公司     | -   | 0.74         | 0.74       |
| 上海银行股份有限公司     | -   | 192,086.65   | 192,086.65 |
| 合计             | -   | 192,087.39   | 192,087.39 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                                   |              |            |
|                | 2023 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |              |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |              |            |
|                | 华安沅荣一年持有混合 A                              | 华安沅荣一年持有混合 C | 合计         |
| 华安基金管理有限公司     | -   | 0.65         | 0.65       |
| 上海银行股份有限公司     | -   | 10,920.48    | 10,920.48  |
| 合计             | -   | 10,921.13    | 10,921.13  |

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：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5.2 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**

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月<br>30 日 |           | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至<br>2023 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    |
| 上海银行股份有限公司 | 1,165,204.69                             | 13,403.49 | 1,793,185.89  | 37,704.29 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

##### 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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 13,035,505.21     | -                   |
| 合计     | 13,035,505.21     | -                   |

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 1,102,753.70      | 146,919,593.20      |
| AAA 以下 | 1,752,141.62      | 10,378,393.44       |
| 未评级    | 51,337,385.21     | 94,455,685.66       |
| 合计     | 54,192,280.53     | 251,753,672.30      |

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金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>2024年6月30日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上          | 不计息           | 合计            |
|-------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 资产                |               |               |               |               |               |
| 货币资金              | 1,165,204.69  | -             | -             | -             | 1,165,204.69  |
| 结算备付金             | 1,362,909.05  | -             | -             | -             | 1,362,909.05  |
| 存出保证金             | 35,445.66     | -             | -             | -             | 35,445.66     |
| 交易性金融资产           | 15,890,400.53 | 41,154,393.45 | 10,182,991.76 | 7,862,898.72  | 75,090,684.46 |
| 买入返售金融资产          | 13,000,361.65 | -             | -             | -             | 13,000,361.65 |
| 应收清算款             | -             | -             | -             | 2,203,448.22  | 2,203,448.22  |
| 资产总计              | 31,454,321.58 | 41,154,393.45 | 10,182,991.76 | 10,066,346.94 | 92,858,053.73 |
| 负债                |               |               |               |               |               |
| 应付赎回款             | -             | -             | -             | 3,871,934.65  | 3,871,934.65  |
| 应付管理人报酬           | -             | -             | -             | 130,269.48    | 130,269.48    |

|                          |                |                |               |               |                |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 16,283.69     | 16,283.69      |
| 应付清算款                    | -              | -              | -             | 656.00        | 656.00         |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 38,465.30     | 38,465.30      |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 33,218.73     | 33,218.73      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 236,040.20    | 236,040.20     |
| 负债总计                     | -              | -              | -             | 4,326,868.05  | 4,326,868.05   |
| 利率敏感度缺口                  | 31,454,321.58  | 41,154,393.45  | 10,182,991.76 | 5,739,478.89  | 88,531,185.68  |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息           | 合计             |
| 资产                       |                |                |               |               |                |
| 货币资金                     | 494,824.79     | -              | -             | -             | 494,824.79     |
| 结算备付金                    | 1,827,846.04   | -              | -             | -             | 1,827,846.04   |
| 存出保证金                    | 49,665.68      | -              | -             | -             | 49,665.68      |
| 交易性金融资产                  | 105,280,148.85 | 146,473,523.45 | -             | 42,530,375.80 | 294,284,048.10 |
| 资产总计                     | 107,652,485.36 | 146,473,523.45 | -             | 42,530,375.80 | 296,656,384.61 |
| 负债                       |                |                |               |               |                |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 156,187.63    | 156,187.63     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 19,523.45     | 19,523.45      |
| 应付清算款                    | -              | -              | -             | 34.13         | 34.13          |
| 卖出回购金融资产款                | 65,328,084.53  | -              | -             | -             | 65,328,084.53  |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 44,114.77     | 44,114.77      |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 14,422.29     | 14,422.29      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 207,042.56    | 207,042.56     |
| 负债总计                     | 65,328,084.53  | -              | -             | 441,324.83    | 65,769,409.36  |
| 利率敏感度缺口                  | 42,324,400.83  | 146,473,523.45 | -             | 42,089,050.97 | 230,886,975.25 |

#### 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影响金额（单位：人民币元） |                        |
|               |                    | 本期末（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|               | 市场利率下降 25 个基点      | 490,551.40                  | 856,648.37             |
| 市场利率上升 25 个基点 | -486,649.43        | -851,330.10                 |                        |

#### 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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票（包括股票、可转换债券、可交换债券）占基金资产的比例为 10-30%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；同业存单投资占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债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%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债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。

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>2024 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 7,862,898.72           | 8.88              | 42,530,375.80            | 18.42             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | 2,854,895.32           | 3.22              | -                        | -                 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                 | -                        | -                 |

|                  |               |       |               |       |
|------------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 衍生金融资产<br>— 权证投资 | -             | -     | -             | -     |
| 其他               | -             | -     | -             | -     |
| 合计               | 10,717,794.04 | 12.11 | 42,530,375.80 | 18.42 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资、可转换债券和可交换债券公允价值占基金净资产的比例为 12.11% (2023 年 12 月 31 日：18.42%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 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>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 10,717,794.04          | 42,530,375.80            |
| 第二层次          | 64,372,890.42          | 251,753,672.30           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 75,090,684.46          | 294,284,048.10           |

###### 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

#### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | 7,862,898.72  | 8.47          |
|    | 其中：股票             | 7,862,898.72  | 8.47          |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 67,227,785.74 | 72.40         |
|    | 其中：债券             | 67,227,785.74 | 72.40         |
|    | 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          | 13,000,361.65 | 14.00         |
|    | 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      | 2,528,113.74  | 2.72          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,238,893.88  | 2.41          |
| 9  | 合计                | 92,858,053.73 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 194,850.00   | 0.22 |
| B | 采矿业              | 425,751.00   | 0.48 |
| C | 制造业              | 5,654,070.72 | 6.39 |
| 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           | 128,568.00   | 0.15 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -    |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -    |
| J | 金融业              | 991,911.00   | 1.12 |
| K | 房地产业             | 243,528.00   | 0.28 |
| L | 租赁和商务服务业         | 224,220.00   | 0.25 |
| 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               | 7,862,898.72 | 8.88 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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<br>(股) | 公允价值 (元)   | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|------------|------------------|
| 1  | 002475 | 立讯精密 | 10,500    | 412,755.00 | 0.47             |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 9,900     | 338,481.00 | 0.38             |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 1,700     | 306,051.00 | 0.35             |
| 4  | 002371 | 北方华创 | 900       | 287,901.00 | 0.33             |
| 5  | 300124 | 汇川技术 | 5,400     | 277,020.00 | 0.31             |
| 6  | 601377 | 兴业证券 | 52,000    | 263,120.00 | 0.30             |
| 7  | 603019 | 中科曙光 | 6,200     | 257,300.00 | 0.29             |
| 8  | 002698 | 博实股份 | 20,400    | 250,308.00 | 0.28             |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 3,800     | 245,100.00 | 0.28             |
| 10 | 600048 | 保利发展 | 27,800    | 243,528.00 | 0.28             |
| 11 | 300502 | 新易盛  | 2,300     | 242,765.00 | 0.27             |
| 12 | 600760 | 中航沈飞 | 5,700     | 228,570.00 | 0.26             |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 13 | 002389 | 航天彩虹 | 16,400 | 227,796.00 | 0.26 |
| 14 | 002027 | 分众传媒 | 37,000 | 224,220.00 | 0.25 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业 | 12,700 | 223,139.00 | 0.25 |
| 16 | 600584 | 长电科技 | 7,000  | 221,970.00 | 0.25 |
| 17 | 600926 | 杭州银行 | 16,400 | 214,020.00 | 0.24 |
| 18 | 600547 | 山东黄金 | 7,400  | 202,612.00 | 0.23 |
| 19 | 002594 | 比亚迪  | 800    | 200,200.00 | 0.23 |
| 20 | 002458 | 益生股份 | 22,500 | 194,850.00 | 0.22 |
| 21 | 603707 | 健友股份 | 16,400 | 194,832.00 | 0.22 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 6,800  | 190,196.00 | 0.21 |
| 23 | 601865 | 福莱特  | 9,000  | 180,900.00 | 0.20 |
| 24 | 300573 | 兴齐眼药 | 1,100  | 180,400.00 | 0.20 |
| 25 | 600989 | 宝丰能源 | 10,200 | 176,766.00 | 0.20 |
| 26 | 300033 | 同花顺  | 1,700  | 176,290.00 | 0.20 |
| 27 | 002422 | 科伦药业 | 5,800  | 175,914.00 | 0.20 |
| 28 | 003006 | 百亚股份 | 7,000  | 165,900.00 | 0.19 |
| 29 | 688390 | 固德威  | 2,856  | 160,278.72 | 0.18 |
| 30 | 603501 | 韦尔股份 | 1,600  | 158,992.00 | 0.18 |
| 31 | 002959 | 小熊电器 | 3,200  | 153,952.00 | 0.17 |
| 32 | 600585 | 海螺水泥 | 6,500  | 153,335.00 | 0.17 |
| 33 | 002236 | 大华股份 | 9,900  | 153,054.00 | 0.17 |
| 34 | 300633 | 开立医疗 | 3,600  | 142,488.00 | 0.16 |
| 35 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,400  | 130,764.00 | 0.15 |
| 36 | 000950 | 重药控股 | 26,400 | 128,568.00 | 0.15 |
| 37 | 000860 | 顺鑫农业 | 6,200  | 103,788.00 | 0.12 |
| 38 | 002466 | 天齐锂业 | 2,500  | 74,775.00  | 0.08 |

## 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  | 600036 | 招商银行 | 1,360,498.00 | 0.59            |
| 2  | 002027 | 分众传媒 | 1,286,578.00 | 0.56            |
| 3  | 000932 | 华菱钢铁 | 1,222,619.00 | 0.53            |
| 4  | 000729 | 燕京啤酒 | 916,285.00   | 0.40            |
| 5  | 002371 | 北方华创 | 913,495.00   | 0.40            |
| 6  | 000625 | 长安汽车 | 786,607.00   | 0.34            |
| 7  | 300677 | 英科医疗 | 785,377.00   | 0.34            |
| 8  | 603707 | 健友股份 | 745,215.00   | 0.32            |
| 9  | 601881 | 中国银河 | 672,000.00   | 0.29            |
| 10 | 000801 | 四川九洲 | 662,957.60   | 0.29            |
| 11 | 002698 | 博实股份 | 656,065.66   | 0.28            |
| 12 | 601988 | 中国银行 | 639,650.00   | 0.28            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 13 | 603019 | 中科曙光 | 639,061.00 | 0.28 |
| 14 | 000950 | 重药控股 | 582,864.00 | 0.25 |
| 15 | 300347 | 泰格医药 | 580,087.00 | 0.25 |
| 16 | 603501 | 韦尔股份 | 570,326.00 | 0.25 |
| 17 | 688390 | 固德威  | 523,805.25 | 0.23 |
| 18 | 300573 | 兴齐眼药 | 499,992.00 | 0.22 |
| 19 | 301376 | 致欧科技 | 486,071.00 | 0.21 |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 483,333.00 | 0.21 |

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 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 000333 | 美的集团 | 2,017,962.00 | 0.87            |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 2,005,692.00 | 0.87            |
| 3  | 002698 | 博实股份 | 1,706,724.73 | 0.74            |
| 4  | 600919 | 江苏银行 | 1,641,080.00 | 0.71            |
| 5  | 002984 | 森麒麟  | 1,606,594.40 | 0.70            |
| 6  | 003006 | 百亚股份 | 1,263,489.00 | 0.55            |
| 7  | 000932 | 华菱钢铁 | 1,197,679.00 | 0.52            |
| 8  | 600760 | 中航沈飞 | 1,122,971.80 | 0.49            |
| 9  | 600050 | 中国联通 | 1,078,080.00 | 0.47            |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 1,068,909.00 | 0.46            |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 1,054,902.00 | 0.46            |
| 12 | 002648 | 卫星化学 | 998,103.79   | 0.43            |
| 13 | 688235 | 百济神州 | 978,196.81   | 0.42            |
| 14 | 300677 | 英科医疗 | 970,131.00   | 0.42            |
| 15 | 000729 | 燕京啤酒 | 964,800.00   | 0.42            |
| 16 | 603019 | 中科曙光 | 950,446.00   | 0.41            |
| 17 | 600547 | 山东黄金 | 948,341.00   | 0.41            |
| 18 | 002027 | 分众传媒 | 945,044.00   | 0.41            |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 938,456.00   | 0.41            |
| 20 | 600926 | 杭州银行 | 894,003.00   | 0.39            |

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

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 24,493,058.26 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 58,970,621.52 |

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      | 23,476,034.54 | 26.52        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 40,896,855.88 | 46.19        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,896,855.88 | 46.19        |
| 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） | 2,854,895.32  | 3.22         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 67,227,785.74 | 75.94        |

### 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  | 230207 | 23 国开 07   | 200,000 | 20,603,852.46 | 23.27        |
| 2  | 240001 | 24 付息国债 01 | 100,000 | 10,282,786.89 | 11.61        |
| 3  | 220313 | 22 进出 13   | 100,000 | 10,267,754.10 | 11.60        |
| 4  | 240004 | 24 付息国债 04 | 100,000 | 10,182,991.76 | 11.50        |
| 5  | 240411 | 24 农发 11   | 100,000 | 10,025,249.32 | 11.32        |

### 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 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进行交易，以对冲资产组合的系统性风险和流动性风险等。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。本基金按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎参与国债期货投资交易。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局的处罚。

本基金对上述主体所发行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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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 | 35,445.66    |
| 2  | 应收清算款 | 2,203,448.22 |
| 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    | 2,238,893.88 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|------|--------------|
|----|------|------|------|--------------|

|   |        |      |              |      |
|---|--------|------|--------------|------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 1,102,753.70 | 1.25 |
| 2 | 118024 | 冠宇转债 | 438,615.89   | 0.50 |
| 3 | 113579 | 健友转债 | 432,608.88   | 0.49 |
| 4 | 113059 | 福莱转债 | 427,248.22   | 0.48 |
| 5 | 127100 | 神码转债 | 231,752.49   | 0.26 |
| 6 | 110081 | 闻泰转债 | 198,204.49   | 0.22 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别         | 持有人户数<br>(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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 华安沣荣一年持有混合 A | 283          | 145,378.13 | 0.00  | 0.00          | 41,142,010.17 | 100.00        |
| 华安沣荣一年持有混合 C | 611          | 77,018.89  | 0.00  | 0.00          | 47,058,542.23 | 100.00        |
| 合计           | 894          | 98,658.34  | 0.00  | 0.00          | 88,200,552.40 | 100.00        |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 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情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                         | 华安沣荣一年持有混合 A   | 华安沣荣一年持有混合 C  |
|----------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2023 年 6 月 20) | 145,392,322.86 | 88,088,443.22 |

|                |                |               |
|----------------|----------------|---------------|
| 日) 基金份额总额      |                |               |
| 本报告期期初基金份额总额   | 145,392,322.86 | 88,088,443.22 |
| 本报告期基金总申购份额    | 12.85          | 7,195.47      |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 104,250,325.54 | 41,037,096.46 |
| 本报告期基金拆分变动份额   | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 41,142,010.17  | 47,058,542.23 |

## § 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:

2024 年 3 月 12 日, 基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》, 范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

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

#### 10.6.1 管理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及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 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 (%) |    |
| 海通证券 | 2      | 83,463,679.78 | 100.00           | 78,511.82 | 100.00         | -  |

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) 财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范、具备健全的内控制度；

(2) 研究服务能力较强，有较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，能够针对本基金投资运作管理需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

(3) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(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尽职调查

由相关部门牵头依据上述交易单元选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调查。

(2) 完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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           |                  | 债券回购交易           |                    | 权证交易 |                  |
|------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额             | 占当期债券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 (%) |
| 海通证券 | 131,441,372.47 | 100.00           | 1,728,341,000.00 | 100.00             | -    | -                |

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  | 华安沣荣一年持有混合 2023 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 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 2  | 华安沣荣一年持有混合 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 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 3  | 华安沣荣一年持有混合更新的招募说明书(2024 年第 1 号) | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 4  | 华安沣荣一年持有混合 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 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 5  | 华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告           | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2024 年 3 月 12 日 |
| 6  | 华安沣荣一年持有混合 2023 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 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 7  | 华安基金管理有限公司旗下部分基                 | 中国证监会基金电子披              | 2024 年 3 月 27 日 |



|    |  |                         |                 |
|----|--|-------------------------|-----------------|
|    | 金 2023 年年度报告的提示性公告                         | 露网站和公司网站等指定媒介           |                 |
| 8  | 华安沣荣一年持有混合 2024 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 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 9  | 华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告      | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 10 | 关于华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入和定期定额投资业务公告 | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2024 年 5 月 15 日 |
| 11 | 关于华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金开放赎回和转换转出业务的公告         | 中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介 | 2024 年 6 月 19 日 |
| 12 | 华安沣荣一年持有混合 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 | 2024 年 6 月 28 日 |
| 13 | 华安沣荣一年持有混合 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 | 2024 年 6 月 28 日 |

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

| 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              | 20240101~20240623       | 80,022,333.33 | 0.00 | 80,022,333.33 | 0.00       | 0.00     |
| 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。 |                |                         |               |      |               |            |          |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沣荣一年持有期混合型证券投资基金托管协议》

- 4、中国证监会批准华安沣荣一年持有期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住所，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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日