

华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金
2022 年中期报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 25 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
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
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	54
9	开放式基金份额变动	54
10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8	其他重大事件	57
11	影响投资者决策的其他重要信息	58
12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	华安沅瑞一年持有混合	
基金主代码	014809	
交易代码	014809	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,521,615,873.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	014809	014810
报告期末下属分级基金的份额总额	1,404,782,052.84 份	116,833,820.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
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、货币市场工具等资产的配置比例。
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	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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	罗菲菲
	联系电话	021-38969999	010-58560666
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95568

传真	021-68863414	010-57093382
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月25日(基金合同生效日)至2022年6月30日)	
	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C
本期已实现收益	9,800,187.47	664,799.67
本期利润	24,065,873.11	1,849,473.03
加权平均基金份额本期利润	0.0171	0.0158
本期加权平均净值利润率	1.71%	1.58%
本期基金份额净值增长率	1.71%	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C
期末可供分配利润	9,802,742.35	664,850.82
期末可供分配基金份额利润	0.0070	0.0057

期末基金资产净值	1,428,851,685.15	118,683,402.15
期末基金份额净值	1.0171	1.0158
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C
基金份额累计净值增长率	1.71%	1.58%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沅瑞一年持有混合 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	1.18%	0.15%	0.85%	0.15%	0.33%	0.00%
过去三个月	1.90%	0.17%	1.04%	0.20%	0.86%	-0.03%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.71%	0.14%	-1.39%	0.24%	3.10%	-0.10%

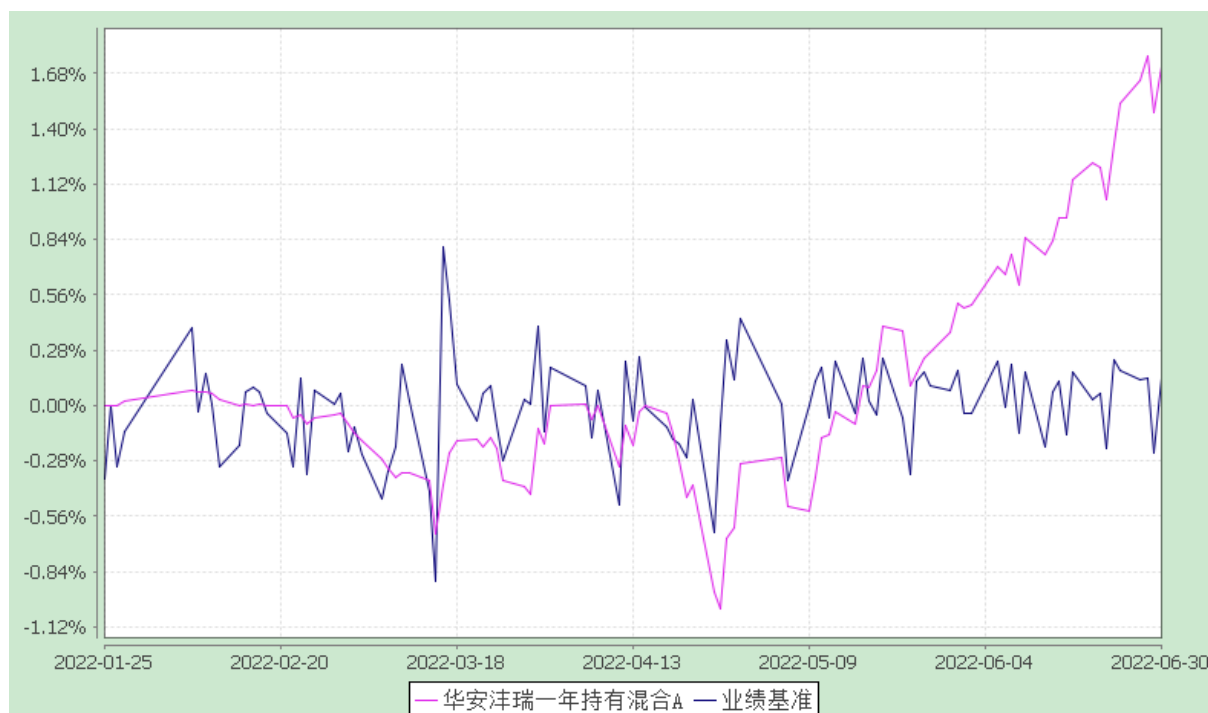
华安沅瑞一年持有混合 C

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	1.16%	0.15%	0.85%	0.15%	0.31%	0.00%
过去三个月	1.82%	0.17%	1.04%	0.20%	0.78%	-0.03%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.58%	0.14%	-1.39%	0.24%	2.97%	-0.10%

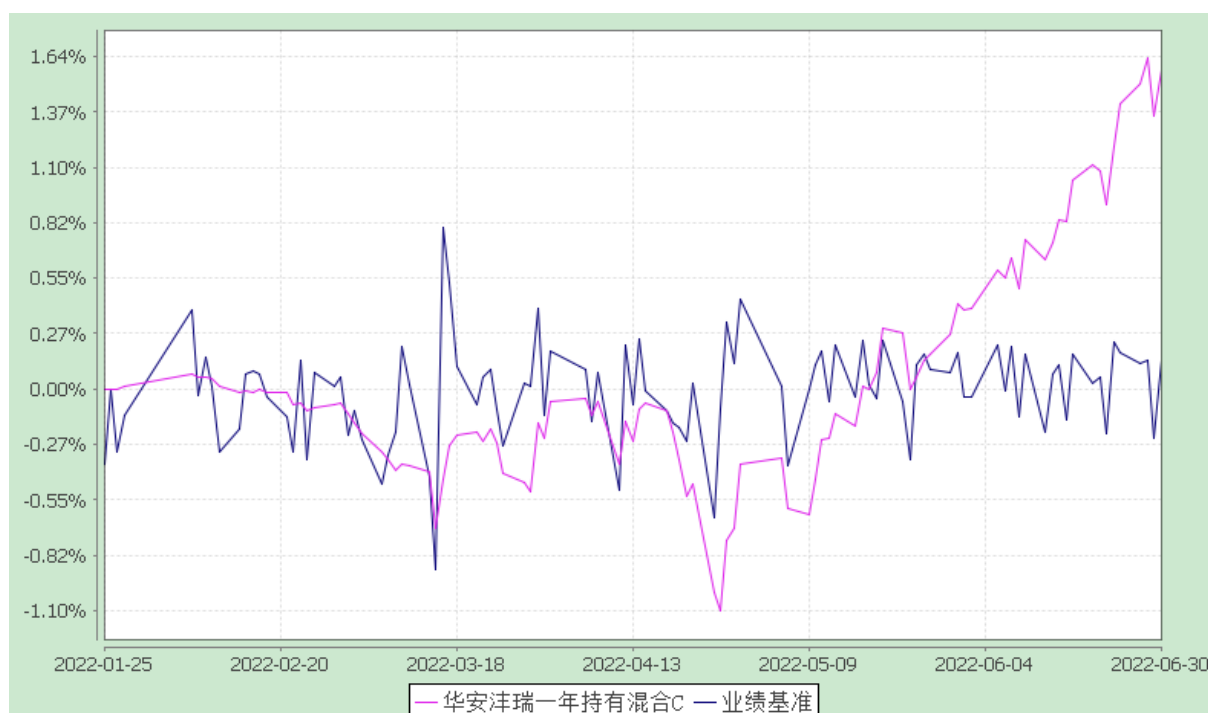
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2022 年 1 月 25 日至 2022 年 6 月 30 日)

华安沅瑞一年持有混合 A



华安沅瑞一年持有混合 C



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2022 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 206 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,985.16 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴文明	本基金的基金经理	2022-01-25	-	12 年	硕士研究生，12 年金融、基金行业从业经历。历任威海市商业银行金融市场部交易员、银华基金管理有限公司基金经理。2021 年 7 月加入华安基金管理有限公司，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，同时担任华安沅瑞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，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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 12 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，GDP 同比增长 2.5%，其中一季度、二季度分别同比增长 4.8% 和 0.4%，二季度经济受疫情影响较大。上半年，固定资产投资同比增长 6.1%，其中基建、制造业投资分别同比增长 7.1%、10.4%，而地产投资同比下降 5.4%，地产投资依然低迷，基建和制造业投资成为重要支撑。上半年，出口同比增长 13.2%，出口增速仍然维持在较高水平。受疫情影响，上半年社零同比下降 0.7%，其中 4 月社零同比降幅达到 11.1%，5 月份降幅收窄至 6.7%，6 月份由降转升，同比增长 3.1%。货币政策方面，资金面整体较为平稳，一季度 DR001 中枢在 1.9% 左右，二季度降至 1.4% 左右，6 月末资金面出现了近期少有的大幅波动，但跨半年后资金利率回落至低水平，货币政策对市场整体较为呵护。

从市场走势看，上半年债券市场收益率短端下行较多，截至 6 月末，1 年国开债收益率较年初下行 30bp 至 2.02%，10 年国开债收益率下行 3bp 至 3.05%，利率债曲线陡峭化下行。信用债方面，截至 6 月末，1 年 AAA 中票较年初下行 33bp 至 2.42%，3 年期 AAA 中票较年初上行 4bp 至 2.95%，短端表现好于长端。具体来说，1 月货币宽松预期驱动收益率下行，2 月至 3 月上旬，金融数据放量带动“宽信用”预期升温，多地房地产调控放松加剧投资者担忧，债市收益率上行。3 月下旬至 5 月底，在上海等多地疫情发酵以及宽松的资金面的影响下，收益率下行。5 月末至 6 月，疫情得到有效控制，同时在复工复产的影响下，债券市场收益率上行。上半年我们精选中高评级信用债，保持适

度杠杆和久期，灵活调整持仓结构。

权益方面，上半年上证 50 指数下跌 6.59%，沪深 300 指数下跌 9.22%，中证 500 指数下跌 12.30%。股票市场下行主要受估值高位回调、俄乌战争引起风险偏好的变化，以及上海等城市疫情导致经济下行压力。从行业板块上看，分化剧烈，其中，煤炭板块一枝独秀，上涨 31%，紧随其后的有交通运输和美容护理等，跌幅在 2% 以内，表现最差的电子、计算机、传媒和国防军工，跌幅都在 20% 以上。估值方面，过去几年累积的高估值有所缓解，主要宽基指数的估值重新回到中位数附近。上半年本基金根据市场情况，在市场低位对权益资产进行建仓，持仓结构上整体偏均衡，根据景气度和估值匹配程度，优选部分行业进行了重点配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0171 元，本报告期份额净值增长率为 1.71%；本基金 C 类份额净值为 1.0158 元，本报告期份额净值增长率为 1.58%。同期业绩比较基准增长率为 -1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增长方面，短期疫情得到有效控制，经济开始处于缓慢修复阶段，不过目前多数指标和疫情前相比还有距离。地产和疫情仍是影响宏观经济运行的两条主线，后续重点观察疫情反复的风险以及房地产政策放松的效果。

中期来看，债券市场走势要与中长期基本面和流动性环境相匹配，本轮经济宽信用难度较大，国内疫情形势复杂，经济压力仍然较大。由于要实现全年经济增长目标难度较大，宏观政策可能会继续加力，货币政策整体基调仍需要呵护经济修复。

债券方面，将灵活调整久期和杠杆，结合信用利差的变化，精选品种和个券增厚收益，在收益率曲线上寻找凸点，把握交易性机会。

权益方面，随着疫情有效管控，以及稳增长促销费的政策逐步推出，企业盈利预计在下半年将见底回升。我们将结合估值水平以及行业景气度，聚焦优质资产。可转债方面，当前的相对估值水平和绝对价位水平都在历史高位，需要谨慎挑选标的进行配置。本基金将根据市场情况，适当调整股权类配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	4,214,719.25
结算备付金		13,889,037.12
存出保证金		109,371.16
交易性金融资产	6.4.7.2	1,482,427,553.34
其中：股票投资		178,872,960.34
基金投资		-
债券投资		1,303,554,593.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	48,006,097.49
应收清算款		2,765,491.96
应收股利		-
应收申购款		59,961.96
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,551,472,232.28
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
负债：		-
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		2,500,000.00
应付清算款		-

应付赎回款		-
应付管理人报酬	6.4.10.2	757,608.41
应付托管费	6.4.10.2	189,402.11
应付销售服务费		29,057.15
应付投资顾问费		-
应交税费		108,372.19
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	352,705.12
负债合计		3,937,144.98
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	1,521,615,873.37
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	25,919,213.93
净资产合计		1,547,535,087.30
负债和净资产总计		1,551,472,232.28

注：报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,521,615,873.37 份，其中 A 类基金份额净值 1.0171 元，基金份额总额 1,404,782,052.84 份；C 类基金份额净值 1.0158 元，基金份额总额 116,833,820.53 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		31,978,049.64
1.利息收入		3,105,670.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	147,952.45
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,957,717.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,422,020.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,627,240.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	14,337,031.57
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,712,229.74
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	15,450,359.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		6,062,703.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2	3,904,235.65
2. 托管费	6.4.10.2	976,058.85
3. 销售服务费		149,834.26
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		896,378.25
其中：卖出回购金融资产支出		896,378.25
6. 信用减值损失		-
7.税金及附加		30,999.61
8. 其他费用	6.4.7.18	105,196.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,915,346.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,915,346.14
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		25,915,346.14

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,521,092,062.53	-	-	1,521,092,062.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号	523,810.84	-	25,919,213.93	26,443,024.77

填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	25,915,346.14	25,915,346.14
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	523,810.84	-	3,867.79	527,678.63
其中：1.基金申购款	523,810.84	-	3,867.79	527,678.63
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,521,615,873.37	-	25,919,213.93	1,547,535,087.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沅瑞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[2021]4131 号《关于准予华安沅瑞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 2022 年 1 月 17 日至 2022 年 1 月 21 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（2022）验字第 60971571_B01 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 2022 年 1 月 25 日正式生效。本基金为契约型开放式，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 1,520,856,522.60 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 235,539.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,521,092,062.53 元，折合 1,521,092,062.53 份基金份额，其中 A 类基金份额 1,404,268,333.41 份，C 类基金份额 116,823,729.12。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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

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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（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：本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 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。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

本基金业绩比较基准为：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、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证

监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），

按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利

率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；投资人选择红利再投资方式取得的基金份额，其持有期限视同收益分配前原基金份额持有期限，即在原基金份额最短持有期到期后即可进行赎回或转换转出；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,214,719.25
等于：本金	4,213,688.25
加：应计利息	1,031.00
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,214,719.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	165,462,082.47	-	178,872,960.34	13,410,877.87
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市 场	3,488,328.77	316,260,128.77	-113,896.24
	银行间市 场	974,193,022.63	987,294,464.23	2,153,377.37
	合计	1,287,078,718.87	14,436,393.00	1,303,554,593.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,452,540,801.34	14,436,393.00	1,482,427,553.34	15,450,359.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

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 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	48,006,097.49	-
合计	48,006,097.49	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	256,018.24
其中：交易所市场	250,132.25
银行间市场	5,885.99
应付利息	-
预提信息披露费	50,645.06
预提审计费	46,041.82
合计	352,705.12

6.4.7.7 实收基金

华安沅瑞一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	1,404,268,333.41	1,404,268,333.41
本期申购	513,719.43	513,719.43
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,404,782,052.84	1,404,782,052.84
-----	------------------	------------------

华安沅瑞一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	116,823,729.12	116,823,729.12
本期申购	10,091.41	10,091.41
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	116,833,820.53	116,833,820.53

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华安沅瑞一年持有混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	9,800,187.47	14,265,685.64	24,065,873.11
本期基金份额交易产生的变动数	2,554.88	1,204.32	3,759.20
其中：基金申购款	2,554.88	1,204.32	3,759.20
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,802,742.35	14,266,889.96	24,069,632.31

华安沅瑞一年持有混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	664,799.67	1,184,673.36	1,849,473.03
本期基金份额交易产生的变动数	51.15	57.44	108.59
其中：基金申购款	51.15	57.44	108.59
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	664,850.82	1,184,730.80	1,849,581.62

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,081.17
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	101,394.92
其他	476.36
合计	147,952.45

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
	2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,627,240.75
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	-2,627,240.75

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
	2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	52,063,304.50
减：卖出股票成本总额	54,365,185.86
减：交易费用	325,359.39
买卖股票差价收入	-2,627,240.75

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
	2022 年 1 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	14,458,629.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及	-121,598.41

债券到期兑付) 差价收入	
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	14,337,031.57

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
	2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	984,908,222.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	976,569,119.66
减：应计利息总额	8,446,425.69
减：交易费用	14,275.46
买卖债券差价收入	-121,598.41

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,712,229.74
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	1,712,229.74
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
1.交易性金融资产	15,450,359.00
——股票投资	13,410,877.87
——债券投资	2,039,481.13
——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	15,450,359.00

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
审计费用	46,041.82
信息披露费	50,645.06
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,610.00
账户维护费	1,500.00
其他费用	400.00
合计	105,196.88

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金托管人、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

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
	2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,904,235.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,950,040.33

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	976,058.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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		
	2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	172.62	172.62
中国民生银行股份有限公司	-	149,661.64	149,661.64
合计	-	149,834.26	149,834.26

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年费率为 0.30%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	4,214,719.25	46,081.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2022年1月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日 基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	113059	福莱转债	老股东配售	90.00	9,000.00

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	1-6个月(含)	新股限售	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,500,000.00.00 元，截至 2022 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。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，追求超越业绩比较基准的投资回报和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本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,214,719.25	-	-	-	4,214,719.25
结算备付金	13,889,037.12	-	-	-	13,889,037.12
存出保证金	109,371.16	-	-	-	109,371.16
交易性金融资产	425,716,746.86	794,198,183.12	83,639,663.02	178,872,960.34	1,482,427,553.34
买入返售金融资产	48,006,097.49	-	-	-	48,006,097.49
应收清算款	-	-	-	2,765,491.96	2,765,491.96
应收申购款	-	-	-	59,961.96	59,961.96
资产总计	491,935,971.88	794,198,183.12	83,639,663.02	181,698,414.26	1,551,472,232.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	757,608.41	757,608.41
应付托管费	-	-	-	189,402.11	189,402.11
应付销售服务费	-	-	-	29,057.15	29,057.15
应交税费	-	-	-	108,372.19	108,372.19
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	352,705.12	352,705.12
负债总计	2,500,000.00	-	-	1,437,144.98	3,937,144.98
利率敏感度缺口	489,435,971.88	794,198,183.12	83,639,663.02	180,261,269.28	1,547,535,087.30

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

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 2022 年 6 月 30 日
	市场利率下降 25 个基点	5,081,821.10
	市场利率上升 25 个基点	-5,061,672.71

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不高于 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 2022 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	178,872,960.34	11.56
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	178,872,960.34	11.56

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.56%，因此除市场利率和外币汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2022 年 6 月 30 日
第一层次	177,540,656.90
第二层次	1,303,554,593.00
第三层次	1,332,303.44
合计	1,482,427,553.34

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	178,872,960.34	11.53
	其中：股票	178,872,960.34	11.53

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,303,554,593.00	84.02
	其中：债券	1,303,554,593.00	84.02
	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	48,006,097.49	3.09
	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	18,103,756.37	1.17
8	其他各项资产	2,934,825.08	0.19
9	合计	1,551,472,232.28	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

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	1,341,531.00	0.09
B	采矿业	4,782,508.44	0.31
C	制造业	117,891,904.50	7.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,953,169.00	0.26
E	建筑业	1,720,220.00	0.11
F	批发和零售业	223,332.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,465,223.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,617,102.40	0.43
J	金融业	29,322,467.00	1.89
K	房地产业	1,136,449.00	0.07
L	租赁和商务服务业	2,887,741.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	3,474,834.00	0.22
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	1,926,375.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	130,104.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	178,872,960.34	11.56

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,600	7,362,000.00	0.48
2	601318	中国平安	149,700	6,989,493.00	0.45
3	300750	宁德时代	12,900	6,888,600.00	0.45
4	601012	隆基绿能	95,040	6,332,515.20	0.41
5	601988	中国银行	1,560,300	5,086,578.00	0.33
6	600036	招商银行	106,400	4,490,080.00	0.29
7	600030	中信证券	197,700	4,282,182.00	0.28
8	000858	五粮液	17,900	3,614,547.00	0.23
9	300059	东方财富	133,940	3,402,076.00	0.22
10	603288	海天味业	30,970	2,798,449.20	0.18
11	603259	药明康德	25,800	2,682,942.00	0.17
12	002475	立讯精密	77,200	2,608,588.00	0.17
13	600745	闻泰科技	30,300	2,578,833.00	0.17
14	002594	比亚迪	7,500	2,501,175.00	0.16
15	000568	泸州老窖	9,400	2,317,476.00	0.15
16	601888	中国中免	9,800	2,282,714.00	0.15
17	002415	海康威视	61,800	2,237,160.00	0.14
18	600438	通威股份	37,200	2,226,792.00	0.14
19	000725	京东方 A	560,500	2,208,370.00	0.14
20	600660	福耀玻璃	52,200	2,182,482.00	0.14
21	603501	韦尔股份	12,100	2,093,663.00	0.14
22	600887	伊利股份	47,900	1,865,705.00	0.12
23	000333	美的集团	30,600	1,847,934.00	0.12
24	300015	爱尔眼科	41,000	1,835,570.00	0.12
25	000887	中鼎股份	99,000	1,805,760.00	0.12

26	002049	紫光国微	9,200	1,745,424.00	0.11
27	600900	长江电力	74,500	1,722,440.00	0.11
28	002389	航天彩虹	93,400	1,714,824.00	0.11
29	002409	雅克科技	30,000	1,665,300.00	0.11
30	600460	士兰微	31,700	1,648,400.00	0.11
31	300034	钢研高纳	38,000	1,602,840.00	0.10
32	601985	中国核电	226,300	1,552,418.00	0.10
33	600031	三一重工	81,200	1,547,672.00	0.10
34	603606	东方电缆	20,000	1,532,000.00	0.10
35	600600	青岛啤酒	14,300	1,486,056.00	0.10
36	600436	片仔癀	4,000	1,426,920.00	0.09
37	601899	紫金矿业	152,000	1,418,160.00	0.09
38	000301	东方盛虹	83,800	1,417,058.00	0.09
39	601668	中国建筑	261,100	1,389,052.00	0.09
40	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.09
41	300454	深信服	12,700	1,318,006.00	0.09
42	600276	恒瑞医药	34,900	1,294,441.00	0.08
43	002241	歌尔股份	37,000	1,243,200.00	0.08
44	300014	亿纬锂能	12,100	1,179,750.00	0.08
45	300274	阳光电源	12,000	1,179,000.00	0.08
46	600104	上汽集团	64,300	1,145,183.00	0.07
47	601238	广汽集团	72,900	1,110,996.00	0.07
48	688777	中控技术	15,200	1,105,952.00	0.07
49	603659	璞泰来	12,800	1,080,320.00	0.07
50	002352	顺丰控股	19,000	1,060,390.00	0.07
51	300124	汇川技术	15,800	1,040,746.00	0.07
52	600926	杭州银行	68,600	1,027,628.00	0.07
53	002487	大金重工	24,400	1,018,212.00	0.07
54	002384	东山精密	44,000	1,008,920.00	0.07
55	601816	京沪高铁	200,300	1,005,506.00	0.06
56	601225	陕西煤业	47,100	997,578.00	0.06
57	601688	华泰证券	68,900	978,380.00	0.06
58	002129	TCL 中环	16,200	954,018.00	0.06
59	603197	保隆科技	19,000	934,610.00	0.06
60	002304	洋河股份	5,100	934,065.00	0.06
61	600741	华域汽车	40,300	926,900.00	0.06
62	600111	北方稀土	25,500	896,580.00	0.06
63	300782	卓胜微	6,560	885,600.00	0.06
64	600989	宝丰能源	59,800	876,070.00	0.06
65	600933	爱柯迪	53,000	868,140.00	0.06
66	688599	天合光能	13,090	854,122.50	0.06
67	603799	华友钴业	8,920	852,930.40	0.06
68	600406	国电南瑞	30,360	819,720.00	0.05
69	601799	星宇股份	4,700	803,700.00	0.05

70	601633	长城汽车	20,800	770,432.00	0.05
71	603986	兆易创新	5,200	739,492.00	0.05
72	000625	长安汽车	42,640	738,524.80	0.05
73	600919	江苏银行	103,000	733,360.00	0.05
74	603228	景旺电子	31,000	723,230.00	0.05
75	300850	新强联	8,000	712,240.00	0.05
76	601628	中国人寿	22,300	693,084.00	0.04
77	000902	新洋丰	40,300	680,667.00	0.04
78	300682	朗新科技	27,000	680,130.00	0.04
79	300498	温氏股份	31,600	672,764.00	0.04
80	601877	正泰电器	18,700	669,086.00	0.04
81	002714	牧原股份	12,100	668,767.00	0.04
82	002032	苏泊尔	11,500	647,910.00	0.04
83	002531	天顺风能	39,000	643,110.00	0.04
84	603833	欧派家居	4,200	632,856.00	0.04
85	002027	分众传媒	89,900	605,027.00	0.04
86	600009	上海机场	10,400	589,680.00	0.04
87	600048	保利发展	32,900	574,434.00	0.04
88	000001	平安银行	38,000	569,240.00	0.04
89	002555	三七互娱	26,200	556,226.00	0.04
90	600809	山西汾酒	1,700	552,160.00	0.04
91	600760	中航沈飞	8,740	528,333.00	0.03
92	000876	新希望	34,500	527,850.00	0.03
93	600905	三峡能源	82,900	521,441.00	0.03
94	300207	欣旺达	16,300	515,080.00	0.03
95	601088	中国神华	15,200	506,160.00	0.03
96	603806	福斯特	7,700	504,504.00	0.03
97	000338	潍柴动力	40,200	501,294.00	0.03
98	300760	迈瑞医疗	1,600	501,120.00	0.03
99	002459	晶澳科技	6,300	497,070.00	0.03
100	688036	传音控股	5,403	482,109.69	0.03
101	300896	爱美客	800	480,008.00	0.03
102	002812	恩捷股份	1,900	475,855.00	0.03
103	002410	广联达	8,500	462,740.00	0.03
104	300122	智飞生物	4,100	455,141.00	0.03
105	600132	重庆啤酒	3,100	454,460.00	0.03
106	601919	中远海控	32,300	448,970.00	0.03
107	000651	格力电器	13,300	448,476.00	0.03
108	688012	中微公司	3,754	438,279.50	0.03
109	300529	健帆生物	8,600	437,654.00	0.03
110	601128	常熟银行	56,400	430,896.00	0.03
111	603019	中科曙光	14,400	417,888.00	0.03
112	300759	康龙化成	4,350	414,207.00	0.03
113	000002	万科 A	20,200	414,100.00	0.03

114	600690	海尔智家	14,400	395,424.00	0.03
115	688561	奇安信	7,038	392,720.40	0.03
116	601100	恒立液压	6,200	382,664.00	0.02
117	002050	三花智控	13,900	381,972.00	0.02
118	300347	泰格医药	3,300	377,685.00	0.02
119	688169	石头科技	600	370,020.00	0.02
120	002839	张家港行	68,100	360,249.00	0.02
121	300770	新媒股份	9,300	351,819.00	0.02
122	000661	长春高新	1,500	350,130.00	0.02
123	000895	双汇发展	11,700	342,810.00	0.02
124	603338	浙江鼎力	6,600	334,620.00	0.02
125	600028	中国石化	81,600	332,928.00	0.02
126	000850	华茂股份	87,000	327,120.00	0.02
127	002466	天齐锂业	2,600	324,480.00	0.02
128	002821	凯莱英	1,100	317,900.00	0.02
129	688111	金山办公	1,600	315,392.00	0.02
130	688408	中信博	3,200	295,936.00	0.02
131	600019	宝钢股份	48,700	293,174.00	0.02
132	300408	三环集团	9,700	291,970.00	0.02
133	603218	日月股份	11,000	279,400.00	0.02
134	000063	中兴通讯	10,700	273,171.00	0.02
135	300450	先导智能	4,300	271,674.00	0.02
136	600585	海螺水泥	7,600	268,128.00	0.02
137	300595	欧普康视	4,600	263,074.00	0.02
138	600893	航发动力	5,600	254,856.00	0.02
139	002008	大族激光	7,600	251,788.00	0.02
140	600176	中国巨石	14,200	247,222.00	0.02
141	605499	东鹏饮料	1,400	239,204.00	0.02
142	002568	百润股份	7,560	227,102.40	0.01
143	688008	澜起科技	3,722	225,478.76	0.01
144	002460	赣锋锂业	1,500	223,050.00	0.01
145	600584	长电科技	8,100	218,700.00	0.01
146	688363	华熙生物	1,500	213,270.00	0.01
147	300628	亿联网络	2,800	213,220.00	0.01
148	000100	TCL 科技	44,200	211,718.00	0.01
149	688598	金博股份	700	206,290.00	0.01
150	002371	北方华创	700	193,984.00	0.01
151	603517	绝味食品	3,300	190,806.00	0.01
152	600346	恒力石化	8,400	186,816.00	0.01
153	000596	古井贡酒	700	174,762.00	0.01
154	601186	中国铁建	21,700	171,430.00	0.01
155	300142	沃森生物	3,500	169,365.00	0.01
156	600309	万华化学	1,700	164,883.00	0.01
157	000768	中航西飞	5,400	163,566.00	0.01

158	600426	华鲁恒升	5,600	163,520.00	0.01
159	600570	恒生电子	3,700	161,098.00	0.01
160	601868	中国能建	67,400	159,738.00	0.01
161	002624	完美世界	10,900	156,633.00	0.01
162	300316	晶盛机电	2,300	155,457.00	0.01
163	603233	大参林	4,920	153,996.00	0.01
164	601231	环旭电子	10,700	153,652.00	0.01
165	601600	中国铝业	31,700	150,575.00	0.01
166	601601	中国太保	6,300	148,239.00	0.01
167	600085	同仁堂	2,800	148,064.00	0.01
168	002244	滨江集团	17,100	147,915.00	0.01
169	601865	福莱特	3,700	140,970.00	0.01
170	002179	中航光电	2,200	139,304.00	0.01
171	002493	荣盛石化	9,000	138,510.00	0.01
172	603195	公牛集团	900	137,619.00	0.01
173	600547	山东黄金	7,100	131,776.00	0.01
174	601838	成都银行	7,900	130,982.00	0.01
175	300413	芒果超媒	3,900	130,104.00	0.01
176	601360	三六零	13,800	117,576.00	0.01
177	603160	汇顶科技	1,800	111,474.00	0.01
178	600845	宝信软件	2,000	109,200.00	0.01
179	002311	海大集团	1,800	108,018.00	0.01
180	601111	中国国航	9,300	107,973.00	0.01
181	601021	春秋航空	1,800	105,030.00	0.01
182	600332	白云山	3,200	101,088.00	0.01
183	600886	国投电力	9,500	99,750.00	0.01
184	600196	复星医药	2,100	92,589.00	0.01
185	603882	金域医学	1,100	90,805.00	0.01
186	002791	坚朗五金	700	90,804.00	0.01
187	000157	中联重科	14,500	89,320.00	0.01
188	000425	徐工机械	16,200	87,318.00	0.01
189	600029	南方航空	11,800	86,258.00	0.01
190	000938	紫光股份	4,300	83,420.00	0.01
191	300433	蓝思科技	7,300	80,811.00	0.01
192	002601	龙佰集团	4,000	80,200.00	0.01
193	688396	华润微	1,300	76,791.00	0.00
194	000703	恒逸石化	6,700	70,417.00	0.00
195	002602	世纪华通	14,500	69,890.00	0.00
196	601933	永辉超市	16,200	69,336.00	0.00
197	600362	江西铜业	3,800	67,754.00	0.00
198	002064	华峰化学	7,800	65,832.00	0.00
199	603993	洛阳钼业	11,100	63,603.00	0.00
200	002001	新和成	2,760	62,955.60	0.00
201	002120	韵达股份	3,600	61,416.00	0.00

202	003816	中国广核	20,400	57,120.00	0.00
203	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	6,740,396.00	0.44
2	300750	宁德时代	6,301,128.00	0.41
3	600519	贵州茅台	6,096,061.00	0.39
4	601012	隆基绿能	5,353,826.80	0.35
5	601988	中国银行	4,958,846.00	0.32
6	600036	招商银行	4,690,078.00	0.30
7	600030	中信证券	4,257,176.90	0.28
8	000858	五粮液	3,061,396.00	0.20
9	300059	东方财富	2,777,564.00	0.18
10	002475	立讯精密	2,584,598.00	0.17
11	002142	宁波银行	2,564,207.94	0.17
12	603288	海天味业	2,553,888.00	0.17
13	603259	药明康德	2,528,090.00	0.16
14	600745	闻泰科技	2,518,475.00	0.16
15	600276	恒瑞医药	2,457,581.80	0.16
16	002415	海康威视	2,405,395.00	0.16
17	000725	京东方 A	2,369,220.86	0.15
18	000333	美的集团	2,340,045.00	0.15
19	603501	韦尔股份	2,279,112.00	0.15
20	002389	航天彩虹	2,119,524.00	0.14

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	2,038,666.00	0.13
2	601166	兴业银行	1,831,600.00	0.12
3	600309	万华化学	1,631,488.00	0.11
4	601398	工商银行	1,543,760.00	0.10
5	688981	中芯国际	1,462,338.07	0.09

6	601328	交通银行	1,354,530.00	0.09
7	300451	创业慧康	1,226,597.00	0.08
8	600837	海通证券	1,153,336.00	0.07
9	600276	恒瑞医药	1,098,595.00	0.07
10	000902	新洋丰	1,096,282.50	0.07
11	603337	杰克股份	1,072,707.69	0.07
12	600050	中国联通	1,065,705.00	0.07
13	601288	农业银行	1,032,900.00	0.07
14	300705	九典制药	948,134.00	0.06
15	000001	平安银行	874,910.06	0.06
16	603799	华友钴业	796,552.00	0.05
17	601919	中远海控	730,257.00	0.05
18	601229	上海银行	724,130.00	0.05
19	000651	格力电器	720,413.00	0.05
20	601138	工业富联	695,696.00	0.04

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	219,827,268.33
卖出股票的收入（成交）总额	52,063,304.50

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,015,084.39	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	216,404,421.92	13.98
	其中：政策性金融债	81,486,772.60	5.27
4	企业债券	314,245,044.38	20.31
5	企业短期融资券	110,417,112.33	7.14
6	中期票据	530,900,481.21	34.31

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	129,572,448.77	8.37
9	其他	-	-
10	合计	1,303,554,593.00	84.23

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	102102302	21 北京国资 MTN002	970,000	99,724,854.90	6.44
2	102101117	21 光大控股 MTN001	800,000	81,516,339.73	5.27
3	160207	16 国开 07	800,000	81,486,772.60	5.27
4	185285	22 海通 01	800,000	80,982,715.62	5.23
5	012281469	22 深圳地铁 SCP003	800,000	80,278,027.40	5.19

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

2022 年 3 月 21 日，中国银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕13 号）给予罚款 480 万元的行政处罚。2022 年 5 月 26 日，中国银行因老产品规模在部分时点出现反弹，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕29 号）给予罚款 200 万元的行政处罚。

2022 年 3 月 21 日，招商银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕21 号）给予罚款 300 万元的行政处罚。

2021 年 7 月 5 日，晋商银行因撤销单位银行结算账户后未按规定向人民银行报告等违法违规事项，被中国人民银行太原中心支行（并银罚字〔2021〕第 3 号）给予警告，并处以罚款人民币 96 万元的行政处罚。

2021 年 7 月 13 日，交通银行因理财业务和同业业务制度不健全等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕28 号）给予罚款 4100 万元的行政处罚。2021 年 8 月 13 日，交通银行因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被中国人民银行（银罚字〔2021〕23 号）给予罚款 62 万元的行政处罚。2021 年 10 月 20 日，交通银行因未按规定办理内存外贷业务等违法违规事项，被国家外汇管理局上海市分局（上海汇管罚字〔2021〕3111210701 号）责令改正，给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823,166.01 元人民币的行政处罚。2022 年 3 月 21

日，交通银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报不良贷款余额 EAST 数据、贸易融资业务 EAST 数据存在偏差等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕15 号）给予罚款 420 万元的行政处罚。

2021 年 10 月 14 日，海通证券股份有限公司因在开展西南药业股份有限公司（现奥瑞德光电股份有限公司）财务顾问业务的持续督导工作期间未勤勉尽责，收到中国证监会重庆监管局下发的《行政处罚决定书》（〔2021〕5 号），被责令改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款。

本基金投资中国银行、招商银行、22 晋商银行 CD018、19 交通银行 01、22 海通 01 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	109,371.16
2	应收清算款	2,765,491.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,961.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,934,825.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安沅瑞一年持有混合 A	11,267	124,681.11	1,999,760.18	0.14%	1,402,782,292.66	99.86%
华安沅瑞一年持有混合 C	854	136,807.75	0.00	0.00%	116,833,820.53	100.00%
合计	12,121	125,535.51	1,999,760.18	0.13%	1,519,616,113.19	99.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安沅瑞一年持有混合 A	198,872.14	0.01%
	华安沅瑞一年持有混合 C	30,008.10	0.03%
	合计	228,880.24	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安沅瑞一年持有混合 A	华安沅瑞一年持有混合 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）基金份额总额	1,404,268,333.41	116,823,729.12

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	513,719.43	10,091.41
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	1,404,782,052.84	116,833,820.53

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	
东兴证券	2	270,546,641.56	100.00%	250,132.25	100.00%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2022 年 1 月完成租用托管在民生银行的平安证券深交所 014913 交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
东兴证券	877,988,261.07	100.00%	14,372,200,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
2	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金及招募说明书提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
3	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
4	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
5	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
6	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
7	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金(华安沅瑞一年持有混合 A)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
8	华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金(华安沅瑞一年持有混合 C)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
9	关于华安沅瑞一年持有期混合型证券投资基金参加民生银行费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2022-01-13

		定媒介	
10	关于旗下部分基金在募集期内暂不参加华安基金电子直销平台认购费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-17
11	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
12	华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
13	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-27
14	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-15
15	关于华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金开放申购、转换转入及定投业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-19
16	华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-21
17	华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-30
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（福莱转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-05-24

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安沣瑞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瑞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办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日