

华安智联混合型证券投资基金（LOF）

2023年第2季度报告

2023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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安智联混合（LOF）
场内简称	华安智联
基金主代码	501073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 14 日
报告期末基金份额总额	270,739,127.44 份
投资目标	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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。 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，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%

风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
下属分级基金的场内简称	华安智联	-
下属分级基金的交易代码	501073	016071
报告期末下属分级基金的份额总额	270,515,146.05 份	223,981.39 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2023年4月1日-2023年6月30日)	
	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
1.本期已实现收益	13,417,008.18	130,114.08
2.本期利润	2,694,003.23	4,763.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094	0.0034
4.期末基金资产净值	287,386,962.49	237,047.27
5.期末基金份额净值	1.0624	1.0583

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安智联混合（LOF）A：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.82%	0.98%	-0.29%	0.16%	1.11%	0.82%
过去六个月	9.27%	0.83%	0.98%	0.16%	8.29%	0.67%
过去一年	-0.35%	0.78%	-1.44%	0.18%	1.09%	0.60%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	1.34%	0.77%	-0.45%	0.19%	1.79%	0.58%

2、华安智联混合（LOF）C：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.79%	0.98%	-0.29%	0.16%	1.08%	0.82%
过去六个月	9.14%	0.83%	0.98%	0.16%	8.16%	0.67%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-1.66%	0.79%	-1.30%	0.19%	-0.36%	0.60%

注：华安智联混合型证券投资基金（LOF）自2022年7月7日起新增C类基金份额。

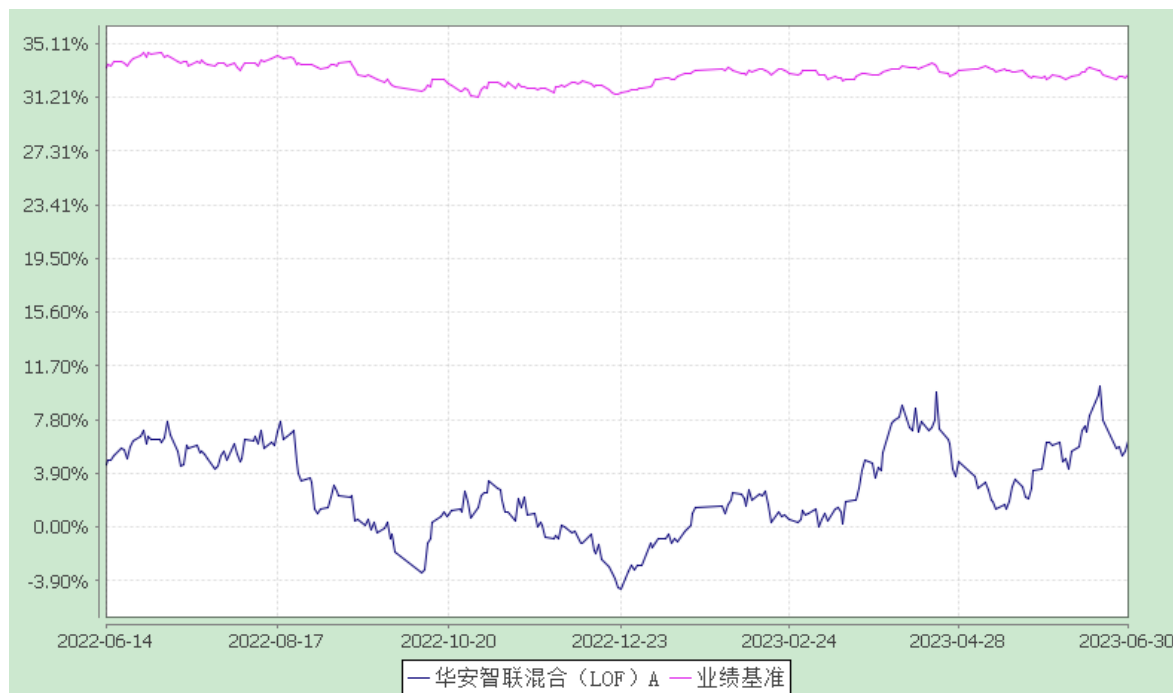
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安智联混合型证券投资基金（LOF）

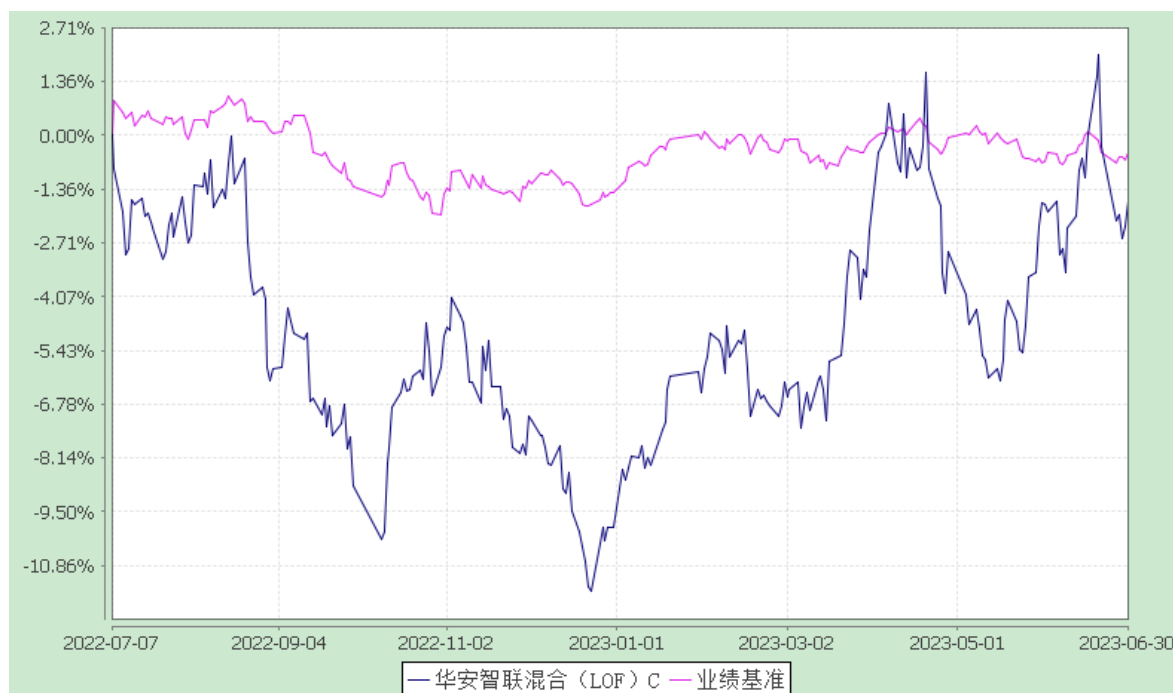
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年6月14日至2023年6月30日)

1. 华安智联混合（LOF）A：



2. 华安智联混合（LOF）C:



注：华安智联混合型证券投资基金（LOF）自 2022 年 7 月 7 日起新增 C 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱才敏	本基金的基金经理	2021-03-08	-	15年	<p>硕士研究生，15年基金行业从业经历。2007年7月应届毕业生进入华安基金，历任金融工程部风险管理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。2014年11月至2017年7月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年11月至2022年2月，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2014年11月起，同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2018年10月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月至2023年1月，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2018年1月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月至2020年11月，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019年5月至2022年2月，同时担任华安鼎信3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年7月至2021年3月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019年8月至2021年3月，同时担任</p>

					<p>华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 6 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起，同时担任华安智联混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 3 月至 2023 年 3 月，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起，同时担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。</p>
李欣	本基金的基金经理	2022-03-28	-	13 年	<p>硕士研究生，13 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，历任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 11 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安中小盘成长混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安科技动力混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月起，同时担任华安科技创新混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安汇宏精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起，再次担任华安科创主题 3</p>

					年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 5 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年二季度内，通信、石油石化、传媒等行业涨幅居前，AI(人工智能)带动了 TMT 行业，包括算力、应用等产业的快速发展和发展前景预期，算力包括上游的计算芯片、传输芯片及模组、存储芯片等，以及中下游的服务器、交换机及其构成的数据中心等，通信行业中的光模块、传媒行业内多个受益于 AI 带来的内容生成和制作效率提升的子行业，上涨幅度均较显著。

在该季度内，我们的投资决策一如既往的基于我们对客观世界的认知体系，正如我们之前多次在报告中表述的那样，我们认为推动现代社会物质文明进步的三大支柱是信息、能源、健康领域的技术发展和应用，我们一直在深化、增厚、更新上述认知体系，从 2022 年下半年我们以信创为切入点加重了信息领域的投资，在今年上半年包括本季度，我们基于既有的对于 AI 的认知和实践积累基础，结合全球相关的科技和应用动向，对相关的产业链和公司进行了深入研究，在评估长中短期的成长空间、确定性、风险后，做出了重点投资，取得了成效。同时，我们也在加深

对二级市场运行规律的学习和总结，努力将基本面研究成果兑现在对市场机遇的把握和基金业绩上。

本基金在确定投资标的和投资比例时，参考基金合同中对投资方向的相关表述。债券方面，保持对利率债和高等级信用债的基本配置，动态调整组合久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年6月30日，本基金A类份额净值为1.0624元，本报告期份额净值增长率为0.82%，同期业绩比较基准增长率为-0.29%。本基金C类份额净值为1.0583元，本报告期份额净值增长率为0.79%，同期业绩比较基准增长率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

党的二十大报告中明确提出，要加快构建以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进的新发展格局。要把科技自立自强作为国家发展战略的支撑，需要发挥好有为政府与有效市场两种机制有机结合的体制机制效力，推动科技创新在畅通循环中发挥关键作用。我们努力做到在研究、投资中贯彻、落实新发展理念。

在复杂多变的国际环境中，如何持续提高我国的产业竞争力和国际竞争话语权，是产业界重要的使命和发展机遇之所在，也是二级市场投资界支持实业发展、维护持有人利益的重要议题。我们从客观的角度观察这一次AI浪潮，相对于以往的“AI浪潮”，它具有两个显著特征，第一是产品的普适性显著超越以往，从办公助理、搜索引擎、编程/制图/视频助手、导医导购到工业自动化应用，在toB和toC端的绝大多数领域都有应用落地，代表着AI技术“旧时王谢堂前燕，飞入寻常百姓家”；第二是强大的快速学习和进化能力，目前GPT-4在海外的Uniform Bar Exam、LSAT等专业考试中的测试成绩已经超越了90%左右的考生，其在医学、信息科学等自然科学领域亦有较为专业的表现。

我们认为目前处于AI产业革命进程的初期。AI的技术本质是深度学习，来自于对人脑认知世界的过程机理的研究、假设、模仿、复现，以参数单元、激活函数模拟人脑的神经元，以多层结构、层间信号传递模拟人脑的神经网络结构，以反向传播、梯度下降等机制模拟人脑认识客观世界时的反馈和修正机制。现代AI发展至今，走过了MLP（多层感知机）、CNN（卷积神经网络）、RNN（循环神经网络）及其演化而来的LSTM、Transformer及其演化而来的GPT（生成式预训练Transformer）等各个模型主导的阶段，每一种模型都是研究者对“如何更好的模拟人脑认知世界的方式”所作的假设和验证，其精度和泛化能力逐级加强，甚至已经到了“以假乱真”的水平，但我们没有任何理由认为目前的模型代表着这一认知科学历史进程的顶峰，我们认为，这一进程

刚刚开始、将持续推进，背后的推动力包括数学工具的进步、以半导体先进工艺为代表的硬件能力的演进、算法的迭代、应用和商业化的多样化。

我们认为应坚持从技术、产业链、应用环境等角度客观解析大模型所推动的 AI 产业机遇，希望做到既充分认识到其产业影响力和发展潜力，又不夸大和过分追捧，从而在投资中既把握其机遇，也控制其风险。

在 AI 产业的投资和研究中，我们认为其技术、供应链、应用是否“收敛”是很重要的，如果收敛，就会涌现出主流产业链和供应链，上下游相关企业随时间不断精进竞争力、市值长期成长是大概率事件；反之，如果上述要素没有收敛，则出现低层次重复竞争、供给侧产能不能随主流技术趋势升级而落后的概率会增大。

我们认为，信创是我国科技自立自强的重要体现，并且随着全球科技的发展，信创又被不断注入新的内涵，例如当 AI 成为一个国家产业竞争力的重要组成部分的时候，AI 相关的核心芯片等也是信创的重要组成部分。先进半导体制造、先进封装、半导体设备、EDA 工具等信创基座行业的重要性进一步凸显，而这些产业本身也受益于 AI 等科技前沿的推动，例如在需求侧，AI 对先进制程数字芯片制造、Chiplet 等先进封装的推动很明显，在供给侧，AI 推动着 EDA、光刻等设计、制造工艺的进步。在操作系统、数据库、CAD 等领域，信创也在快速推进。数据要素市场的确立和发展是我国经济发展的重要里程碑，也给信创和整个信息产业带来了新的广阔市场空间。

我们在新能源产业中重点关注新技术、新赛道，例如发电侧的光热、钙钛矿等，输配电侧的柔性化输电，用电侧的充电桩等新能源后市场以及固态电池等新技术，储能侧的液流电池、工商业和户用逆变、储能系统等。

我们认为，对于科技新兴产业，需要有强烈的好奇心、敏锐的洞察力、踏实深入专业的研究，作出适当领先的投资判断，并根据产业实际发展进程对研究结论进行对照和修正。我们对于实实在在具有坚实的技术、产品、市场前景论证支撑的新技术、新产品、新产业，应有专业性支撑的前瞻性，并在投资实践中逐渐优化对前瞻性和确定性的均衡能力。

我们也看好医药健康、高端制造、军工、受益于疫情后复苏的社会服务与消费等方向，限于篇幅原因，就不一一展开了。

管理人注重对基金合同的全面、深入的理解和把握。基金合同中指出，本基金封闭运作期届满转为开放式后，采取相对灵活的资产配置策略，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，对证券市场投资机会与风险进行综合研判。债券操作上，我们将动态调整组合杠杆水平和久期，维持高信用等级策略。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	123,836,469.75	42.86
	其中：股票	123,836,469.75	42.86
2	固定收益投资	124,474,076.70	43.08
	其中：债券	124,474,076.70	43.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	18,009,124.38	6.23
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,528,322.99	7.45
7	其他各项资产	1,088,131.06	0.38
8	合计	288,936,124.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	99,185.23	0.03

C	制造业	96,169,338.73	33.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	753,900.00	0.26
E	建筑业	43,815.72	0.02
F	批发和零售业	236,703.12	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,259,599.07	8.09
J	金融业	67,151.63	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,004,616.91	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	75,791.54	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,524,759.10	0.53
R	文化、体育和娱乐业	588,412.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	123,836,469.75	43.05

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	41,744	7,847,872.00	2.73
2	601138	工业富联	294,100	7,411,320.00	2.58
3	000063	中兴通讯	156,200	7,113,348.00	2.47
4	688008	澜起科技	99,537	5,715,414.54	1.99
5	002371	北方华创	16,200	5,145,930.00	1.79
6	688041	海光信息	70,458	4,810,167.66	1.67
7	688036	传音控股	29,664	4,360,608.00	1.52
8	000977	浪潮信息	80,600	3,909,100.00	1.36
9	600536	中国软件	81,120	3,802,905.60	1.32
10	002236	大华股份	178,100	3,517,475.00	1.22

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	32,543,883.83	11.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	91,554,281.10	31.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	375,911.77	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	124,474,076.70	43.28

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	300,000	30,539,367.12	10.62
2	155510	19 恒健 01	100,000	10,411,059.18	3.62
3	149682	21 越租 03	100,000	10,209,524.38	3.55
4	137535	22 能建 01	100,000	10,204,572.60	3.55
5	148012	22 深投 05	100,000	10,172,671.23	3.54

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,455.86
2	应收证券清算款	1,034,207.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,467.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,088,131.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113053	隆 22 转债	200,380.18	0.07
2	113061	拓普转债	175,531.59	0.06

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
本报告期期初基金份额总额	305,112,355.52	3,897,896.74
报告期期间基金总申购份额	1,435,823.16	1,423,495.01
减：报告期期间基金总赎回份额	36,033,032.63	5,097,410.36
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	270,515,146.05	223,981.39

§7 影响投资者决策的其他重要信息**7.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

无。

§8 备查文件目录**8.1 备查文件目录**

- 1、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 2、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 3、《华安智联混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

8.2 存放地点

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

8.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二三年七月二十日