

# 华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

## 2023 年中期报告

### 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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 2023 年 4 月 4 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
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> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
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
<b>5 托管人报告</b> .....	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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
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
<b>7 投资组合报告</b> .....	39
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.....	40
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.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 本报告期投资本基金情况.....	42

7.13 投资组合报告附注.....	46
<b>8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	48
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.9 其他重大事件.....	50
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	华安锐进积极配置一年持有混合（FOF）
基金主代码	016980
交易代码	016980
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 4 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	365,289,110.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	1、基金投资策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，风险与预期收益高于债券型基金中基金及货币市场型基金中基金、低于股票型基金中基金。

### 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	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	郑鹏
	联系电话	021-38969999	010-85238667
	电子邮箱	service@huan.com.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		4008850099	95577
传真		021-68863414	010-85238680
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市东城区建国门内大街22

	临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	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	北京市东城区建国门内大街22 号
邮政编码	200120	100005
法定代表人	朱学华	李民吉

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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 层、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（2023年4月4日（基金合同生效日）至 2023年6月30日）
本期已实现收益	-4,413,468.87
本期利润	-6,142,797.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0168
本期加权平均净值利润率	-1.70%
本期基金份额净值增长率	-1.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-6,142,797.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0168
期末基金资产净值	359,146,313.79
期末基金份额净值	0.9832
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.68%

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：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

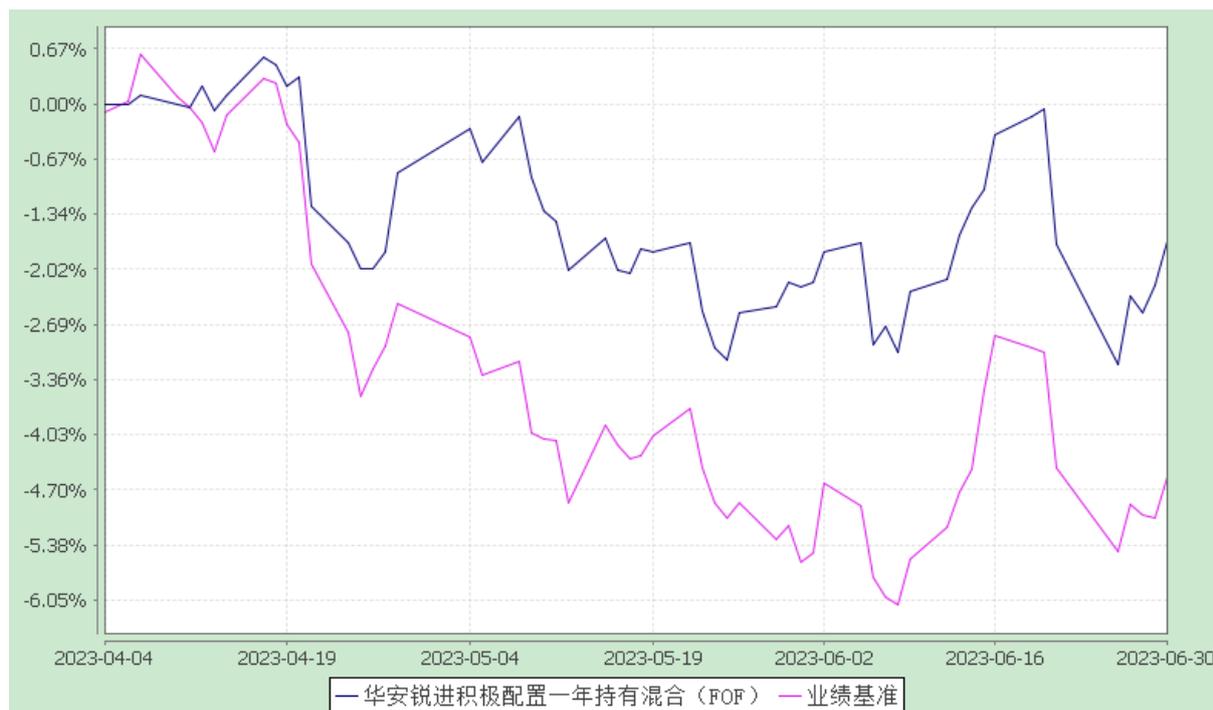
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	0.71%	1.13%	0.66%	-0.57%	0.05%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.68%	0.56%	-4.54%	0.57%	2.86%	-0.01%

#### 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

华安锐进积极配置一年持有期混合型证券投资基金（FOF）

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

（2023 年 4 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2023 年 4 月 4 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

## 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 2023 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 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 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		

袁冠群	本基金的基金经理	2023-04-04	-	12 年	12 年证券、基金行业从业经验，硕士研究生，历任上海证券有限责任公司投资经理、上海尚湖投资管理有限公司量化投资经理、太平洋资产管理有限责任公司投资经理。2021 年 1 月加入华安基金，2021 年 10 月起，担任华安慧萃组合精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、华安民享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 2 月起，同时担任华安慧心楚选配置三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 4 月起，同时担任华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。
陆靖昶	基金组合投资部总监、本基金的基金经理	2023-04-20	-	14 年	14 年证券、基金行业从业经验，硕士研究生，历任浙商证券有限责任公司金融工程研究员、平安资产管理有限责任公司投资经理、广发基金管理有限公司基金经理，2021 年 12 月加入华安基金管理有限公司，现任基金组合投资部总监、基金经理。2023 年 4 月起，担任华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 5 月起，同时担任华安盈瑞稳健优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 7 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

上半年经济整体呈现“先上后下”的特征。一季度 PMI 数据明显回暖，二季度经济景气超预期下滑，连续三个月均处于收缩区间。上半年 CPI-PPI 剪刀差在 2 月有所收敛，而后持续扩大。分项看，CPI 上半年整体呈现下降趋势，6 月 CPI 同比增长为 0，环比为-0.2%。上半年猪周期持续下探，餐饮部门恢复程度不及预期，经济呈现弱复苏态势，总需求不足。PPI 同比持续下跌，6 月 PPI 同比-5.4%，环比-0.8%，主要是受去年基数较高、6 月原油和原油的下游、钢铁、耐用消费品价格走低的影响。今年央行货币政策坚持稳健取向，3 月央行超预期降准，降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，6 月央行 LPR 报价调降 10bp，降低实际贷款利率以支持实体经济，同时引导房贷利率下降，稳定居民部门资产负债表。国外市场来看，上半年美联储加息三次共计 75bp，6 月议息会议中暂停加息，这是自 2022 年 3 月加息以来首次暂停加息。联储表态倾向于慢节奏紧缩，未来加息路径的不确定性仍然较高。

上半年 A 股市场主要股指涨跌不一，分化明显。科创 50 涨幅最大，达到 4.71%，上证指数涨幅达到 3.65%，而创业板指下跌幅度最大，半年累积下跌 5.61%。结构来看，上半年申万一级行业中有 14 个行业上涨，在 AI+ 热潮的催化下，通信、传媒、计算机涨幅居前，分别上涨 50.66%、42.75%、27.57%；商贸零售、房地产、美容护理跌幅居前，分别下跌 23.44%、14.29%、13.61%。债券市场方面，上半年 10 年期国债利率呈现先上后下趋势，1 月底触顶，2 月下旬后震荡回落下降至 2.64%。信用利差走势分化，各类信用债内部分化加大。

报告期内基金规模保持平稳，产品处于建仓期，权益市场震荡下行中，权益配置仓位逢低提升，总权益仓位始终低于基金合同约定的中枢。配置结构保持与业绩比较基准接近，其中风格类配置以

主动基金为主，板块配置以被动基金为主，产品业绩跑赢业绩比较基准以及偏股混合基金指数，超额收益主要来自于行业配置和优选基金的贡献。管理人在今后的操作中，注重市场情绪、拥挤度等指标变化的跟踪，持续优化配置结构，结合配置模型优选基金，持续增加产品的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9832 元，本报告期份额净值增长率为-1.68%，同期业绩比较基准增长率为-4.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球方面，美联储表态倾向于慢节奏紧缩，未来加息路径的趋于停止，经济衰退压力担忧有所缓解。管理人会持续关注国内外通胀情况以及美联储政策动向。

国内，经济整体温和复苏，但短期仍面临一定压力，地产销售偏弱、新开工不足、工业企业仍处在主动去库周期、居民加杠杆意愿不强等。尽管如此，展望下半年，我们观察到很多积极因素，同时伴随政策调节力度加快，经济会加快复苏节奏。总体而言，国内流动性持续保持宽松，政策发力侧重于产业政策多点开花，未来机会大于风险。

我们仍坚持以均衡配置的思路投资，看重资产的中长期投资价值，避免被短期的交易情绪左右。“稳中求进”仍是我们未来投资操作的主旋律，组合层面，我们仍将保持多元化、分散化的配置，为短期波动做好防御准备。我们始终认为“好基金、好价格、长期持有”，实现盈利是大概率事件。

#### 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	8,442,763.70
结算备付金		876,063.60
存出保证金		202,640.08
交易性金融资产	6.4.7.2	313,056,653.49
其中：股票投资		-
基金投资		294,553,588.67
债券投资		18,503,064.82
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	-13,225.91
应收清算款		36,945,596.44
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	7,808.46
资产总计		359,518,299.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>
<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		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		264,476.92
应付托管费		58,979.79
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	48,529.36
负债合计		371,986.07

<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	365,289,110.92
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-6,142,797.13
净资产合计		359,146,313.79
负债和净资产总计		359,518,299.86

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9832 元，基金份额总额 365,289,110.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安锐进积极配置一年持有期混合型证券投资基金（FOF）

本报告期：2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-5,137,936.86</b>
1.利息收入		109,573.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	52,885.72
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		56,687.53
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,538,587.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	-3,635,453.60
债券投资收益	6.4.7.12	73,566.00
资产支持证券投资收益		-
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	23,300.00
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	-1,729,328.26
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	20,405.75

列)		
<b>减：二、营业总支出</b>		1,004,860.27
1. 管理人报酬		784,099.83
2. 托管费		171,831.08
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	48,929.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,142,797.13</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,142,797.13</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-6,142,797.13</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安锐进积极配置一年持有期混合型证券投资基金（FOF）

本报告期：2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 4 月 4 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（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）	365,289,110.92	-	-	365,289,110.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-6,142,797.13	-6,142,797.13
（一）、综合收益总额	-	-	-6,142,797.13	-6,142,797.13
（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）				
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）	365,289,110.92	-	-6,142,797.13	359,146,313.79

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：陈松一

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2023]2392 号文的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2023 年 3 月 20 日至 2023 年 3 月 31 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\_B03 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 4 月 4 日生效。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 365,173,644.74 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 115,466.18 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 365,289,110.92 元，折合 365,289,110.92 基金份额。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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金及其他经中国证监会核准或注册的基金，以下简称“证券投资基金”）、国内依法发行或上市股票（包括创业板及其他经中国证监会注册或核准上市股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资

券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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：本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的比例范围为 60%-95%，其中混合型基金仅指最近连续四个季度披露的基金定期报告中显示股票投资比例均高于基金资产的 60%或在基金合同中明确约定基金资产 60%以上投资于股票的混合型基金，投资于 QDII 基金和香港互认基金比例合计不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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：中证偏股型基金指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×25%。

#### 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 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

##### 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 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）起至 2023 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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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。对于以摊余成本计量的金融负债，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，按实际利率法确认利息收入，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。

以摊余成本计量的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) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；

(3) 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基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 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。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。

### 6.4.7 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,442,763.70
等于：本金	8,439,597.19
加：应计利息	3,166.51
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	8,442,763.70

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,280,236.00	168,294.82	18,503,064.82	54,534.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,280,236.00	168,294.82	18,503,064.82	54,534.00
	资产支持证券	-	-	-	-
基金	296,337,450.93	-	294,553,588.67	-1,783,862.26	
其他	-	-	-	-	
合计	314,617,686.93	168,294.82	313,056,653.49	-1,729,328.26	

#### 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 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-13,225.91	-
银行间市场	-	-
合计	-13,225.91	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	7,808.46
待摊费用	-
合计	7,808.46

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	29,117.44
预提审计费	19,411.92
合计	48,529.36

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	365,289,110.92	365,289,110.92
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	365,289,110.92	365,289,110.92

#### 6.4.7.8 未分配利润

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
上年度末	-	-	-
本期利润	-4,413,468.87	-1,729,328.26	-6,142,797.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,413,468.87	-1,729,328.26	-6,142,797.13

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	47,117.06
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	5,304.49
其他	464.17
合计	52,885.72

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	398,266,689.79
减：卖出/赎回基金成本总额	401,839,266.20
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	62,877.19
基金投资收益	-3,635,453.60

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	73,566.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）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	73,566.00

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
	2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	23,300.00
合计	23,300.00

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-1,729,328.26
——股票投资	-
——债券投资	54,534.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,783,862.26
——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	-1,729,328.26

#### 6.4.7.17 其他收入

项目	本期
	2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-

销售服务费返还收入	20,405.75
合计	20,405.75

**6.4.7.18 持有基金产生的费用**

项目	本期
	2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	160,028.80
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	705,750.13
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	124,004.83

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	19,411.92
信息披露费	29,117.44
证券出借违约金	-
其他费用	400.00
合计	48,929.36

**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
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	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 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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 2023年4月4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管理费	784,099.83
其中：支付销售机构的客户维护费	312,472.02

注：本基金投资于基金管理人所管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 × 1.00% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年4月4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	171,831.08

注：本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 × 0.20% / 当年天数。

#### 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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

##### 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	
	2023年4月4日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行	8,442,763.70	47,117.06

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，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

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人华安基金所管理的公开募集证券投资基金合计 46,673,331.79 元，占本基金净资产的比例为 13.00%。

##### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用	
	2023 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
当期交易基金产生的申购费（元）		-
当期交易基金产生的赎回费（元）		-
当期持有基金产生的		20,405.75

应支付销售服务费 (元)	
当期持有基金产生的 应支付管理费(元)	112,212.21
当期持有基金产生的 应支付托管费(元)	18,913.88

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为0，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2023 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中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金及货币市场型基金中基金、低于股票型基金中基金。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。本基金在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。

#### 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。

#### 6.4.13.3 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 2023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	8,442,763.70	-	-	-	8,442,763.70
结算备付金	876,063.60	-	-	-	876,063.60
存出保证金	202,640.08	-	-	-	202,640.08
交易性金融资产	18,503,064.82	-	-	294,553,588.67	313,056,653.49
买入返售金融资产	-13,225.91	-	-	-	-13,225.91
应收清算款	-	-	-	36,945,596.44	36,945,596.44
其他资产	-	-	-	7,808.46	7,808.46
资产总计	28,011,306.29	-	-	331,506,993.57	359,518,299.86
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					
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	264,476.92	264,476.92
应付托管费	-	-	-	58,979.79	58,979.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	48,529.36	48,529.36
负债总计	-	-	-	371,986.07	371,986.07
利率敏感度缺口	28,011,306.29	-	-	331,135,007.50	359,146,313.79

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

本基金于 2023 年 06 月 30 日持有的交易性债券资产比例较低，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金投资于证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于权益类资产(股票、股票型基金、混合型基金)的比例范围为 60%-95%，其中混合型基金仅指最近连续四个季度披露的基金定期报告中显示股票投资比例均高于基金资产的 60%或在基金合同中明确约定基金资产 60%以上投资于股票的混合型基金，投资于 QDII 基金和香港互认基金比例合计不超过基金资产的 20%；本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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，本基金的投资比例会做相应调整。

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 2023 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	-	-
交易性金融资产—基金投资	294,553,588.67	82.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	294,553,588.67	82.01

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满 6 个月，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

### 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 2023 年 6 月 30 日	
	第一层次	
第二层次		18,503,064.82

第 三 层次	-
合计	313,056,653.49

#### 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	294,553,588.67	81.93
3	固定收益投资	18,503,064.82	5.15
	其中：债券	18,503,064.82	5.15
	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	-13,225.91	0.00
	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	9,318,827.30	2.59
8	其他各项资产	37,156,044.98	10.33
9	合计	359,518,299.86	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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

本基金本报告期末未买入股票。

### 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

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入卖出股票。

## 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	18,503,064.82	5.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,503,064.82	5.15

**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	019694	23 国债 01	183,000	18,503,064.82	5.15

**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**

无。

**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**

无。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比 例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	010386	华安汇嘉 精选混合 C	契约型开 放式	18,040,72 7.56	17,910,83 4.32	4.99%	是
2	007460	华安成长 创新混合 A	契约型开 放式	8,037,449. 73	17,766,78 2.63	4.95%	是
3	000893	工银创新 动力股票	契约型开 放式	11,248,16 4.01	12,024,28 7.33	3.35%	否
4	016313	富国研究 精选灵活 配置混合 C	契约型开 放式	4,598,715. 89	11,616,35 6.34	3.23%	否
5	016182	华安安进 灵活配置 混合发起 式C	契约型开 放式	10,712,89 4.43	10,995,71 4.84	3.06%	是
6	006038	大成景恒 混合C	契约型开 放式	4,656,161. 23	10,900,07 3.44	3.03%	否
7	014109	融通内需 驱动混合 C	契约型开 放式	3,885,998. 47	10,566,02 9.84	2.94%	否
8	010962	中银鑫新 消费成长 混合C	契约型开 放式	9,582,244. 62	10,197,42 4.72	2.84%	否
9	016556	万家量化 睿选混合 C	契约型开 放式	7,406,723. 50	10,152,39 5.90	2.83%	否
10	010256	农银金汇 债券C	契约型开 放式	9,265,264. 52	10,006,48 5.68	2.79%	否
11	000979	景顺长城 沪港深精 选股票	契约型开 放式	5,276,517. 15	9,983,170. 45	2.78%	否
12	516110	国泰中证 800 汽车 与零部件 ETF	契约型开 放式	9,446,200. 00	9,880,725. 20	2.75%	否

13	011125	富国文体健康股票 C	契约型开放式	4,230,118.44	9,636,209.81	2.68%	否
14	017493	东方红新动力混合 C	契约型开放式	2,245,498.78	9,220,017.99	2.57%	否
15	002943	广发多因子混合	契约型开放式	2,715,341.91	9,156,675.99	2.55%	否
16	630002	华商盛世成长混合	契约型开放式	1,613,273.34	8,642,305.28	2.41%	否
17	010236	广发电子信息传媒股票 C	契约型开放式	3,200,100.82	8,233,859.41	2.29%	否
18	012697	同泰数字经济股票 C	契约型开放式	11,549,446.60	8,153,909.30	2.27%	否
19	005314	万家中证 1000 指数增强 C	契约型开放式	6,309,148.26	8,070,662.45	2.25%	否
20	017090	景顺长城能源基建混合 C	契约型开放式	3,331,746.78	7,099,952.39	1.98%	否
21	016258	中信保诚创新成长混合 C	契约型开放式	1,711,625.36	5,081,131.04	1.41%	否
22	161609	融通动力先锋混合	契约型开放式	2,602,030.43	5,032,326.85	1.40%	否
23	007812	淳厚信泽混合 C	契约型开放式	2,866,643.73	4,979,646.82	1.39%	否
24	002207	前海开源金银珠宝混合 C	契约型开放式	3,570,714.29	4,745,479.29	1.32%	否
25	013500	南方金融主题灵活配置混合 C	契约型开放式	3,016,323.63	4,277,146.91	1.19%	否
26	011326	国泰医药健康股票 C	契约型开放式	4,666,447.58	4,199,336.18	1.17%	否
27	000242	景顺长城策略精选灵活配置混合 A	契约型开放式	1,388,954.62	4,104,360.90	1.14%	否
28	001167	金鹰科技	契约型开	2,379,524.	4,009,499.	1.12%	否

		创新股票	放式	67	07		
29	005506	前海开源 中药股票 C	契约型开 放式	1,412,223. 67	3,836,446. 82	1.07%	否
30	012160	财通资管 健康产业 混合 C	契约型开 放式	3,026,283. 06	3,380,055. 55	0.94%	否
31	011066	大成高新 技术产业 股票 C	契约型开 放式	847,218.3 0	3,185,540. 81	0.89%	否
32	002872	华夏智胜 价值成长 股票 C	契约型开 放式	1,946,078. 97	3,027,709. 66	0.84%	否
33	010004	景顺长城 电子信息 产业股票 C	契约型开 放式	2,489,626. 56	2,946,473. 03	0.82%	否
34	015450	华泰柏瑞 多策略混 合 C	契约型开 放式	1,067,110. 02	1,873,631. 77	0.52%	否
35	159996	国泰中证 全指家用 电器 ETF	契约型开 放式	1,591,000. 00	1,858,288. 00	0.52%	否
36	512100	南方中证 1000ETF	契约型开 放式	678,200.0 0	1,803,333. 80	0.50%	否
37	515450	南方标普 中国 A 股 大盘红利 低波 50ETF	契约型开 放式	1,325,100. 00	1,800,810. 90	0.50%	否
38	159845	华夏中证 1000ETF	契约型开 放式	675,400.0 0	1,795,213. 20	0.50%	否
39	510500	南方中证 500ETF	契约型开 放式	293,600.0 0	1,789,492. 00	0.50%	否
40	511380	博时可转 债 ETF	契约型开 放式	157,200.0 0	1,779,346. 80	0.50%	否
41	513330	华夏恒生 互联网科 技业 ETF(QDII )	契约型开 放式	4,066,700. 00	1,683,613. 80	0.47%	否
42	012709	东方红中 证东方红 红利低波	契约型开 放式	1,459,220. 39	1,626,009. 28	0.45%	否

		动指数 C					
43	562500	华夏中证机器人 ETF	契约型开放式	1,812,900.00	1,580,848.80	0.44%	否
44	515000	华宝中证科技龙头 ETF	契约型开放式	1,106,300.00	1,465,847.50	0.41%	否
45	513500	博时标普 500ETF(QDII)	契约型开放式	974,800.00	1,465,124.40	0.41%	否
46	516800	华宝中证智能制造 ETF	契约型开放式	1,390,100.00	1,451,264.40	0.40%	否
47	512670	鹏华中证国防 ETF	契约型开放式	1,758,600.00	1,447,327.80	0.40%	否
48	159941	广发纳指 100(QDII-ETF)	契约型开放式	1,746,100.00	1,445,770.80	0.40%	否
49	515750	富国中证科技 50 策略 ETF	契约型开放式	1,057,500.00	1,433,970.00	0.40%	否
50	159792	富国中证港股通互联网 ETF	契约型开放式	2,294,100.00	1,413,165.60	0.39%	否
51	162411	华宝标普油气上游股票 (QDII-LOF)A	契约型开放式	1,257,800.00	904,483.98	0.25%	否
52	515250	富国中证智能汽车主题 ETF	契约型开放式	836,000.00	754,072.00	0.21%	否
53	159985	华夏饲料豆粕期货 ETF	契约型开放式	387,000.00	735,687.00	0.20%	否
54	516150	嘉实中证稀土产业 ETF	契约型开放式	639,300.00	716,016.00	0.20%	否
55	515790	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	契约型开放式	572,200.00	711,244.60	0.20%	否

### 7.13 投资组合报告附注

**7.13.1** 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。

**7.13.2** 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。

#### 7.13.3 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	202,640.08
2	应收清算款	36,945,596.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	7,808.46
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,156,044.98

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## 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

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	持有份额	占总份额

			比例		比例
6,814	53,608.62	4,657,441.42	1.28%	360,631,669.50	98.72%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

## 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

基金合同生效日（2023 年 4 月 4 日）基金份额总额	365,289,110.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
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	365,289,110.92

## 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：

无。

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：

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍刚先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 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。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 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。

#### 10.7.2 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	-	-	-	-	-

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：

无。

### 10.8.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的比例		的比例		的比例		的比例
东兴 证券	18,280,23 6.00	100.00 %	337,842,0 00.00	100.00 %	-	-	784,011,5 92.30	100.00 %

### 10.9 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	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-03-09
2	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-03-09
3	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-03-09
4	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同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	2023-03-09
5	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-03-09
6	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-03-09
7	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	2023-03-15
8	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-04-05
9	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-20
10	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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	2023-04-24
11	华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书更新(2023 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	2023-04-24

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。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- 2、《华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》
- 3、《华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
- 4、中国证监会批准华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日