

# 华安智联混合型证券投资基金（LOF）

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 1 月 1 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
<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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	16
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.....	16
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>7 投资组合报告</b> .....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.11 投资组合报告附注.....	52
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.4 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
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>55</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>55</b>
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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	55
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	56
10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.9 其他重大事件 .....	59
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安智联混合型证券投资基金（LOF）	
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	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	270,739,127.44 份	
基金合同存续期	不定期	
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

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228
传真		021-68863414	021-60635778

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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、 32层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 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1月1日至2023年6月30日）	
	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
本期已实现收益	8,265,571.16	118,722.69
本期利润	28,977,594.55	33,551.17
加权平均基金份额本期利润	0.0953	0.0417
本期加权平均净值利润率	9.24%	3.92%
本期基金份额净值增长率	9.27%	9.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
期末可供分配利润	5,402,329.75	3,586.17
期末可供分配基金份额利润	0.0200	0.0160
期末基金资产净值	287,386,962.49	237,047.27
期末基金份额净值	1.0624	1.0583
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	

	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
基金份额累计净值增长率	1.34%	-1.66%

### 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

华安智联混合（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.09%	0.99%	0.27%	0.17%	-0.18%	0.82%
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	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.34%	0.77%	-0.45%	0.19%	1.79%	0.58%

华安智联混合（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.06%	0.99%	0.27%	0.17%	-0.21%	0.82%
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	-	-	-	-	-	-
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。

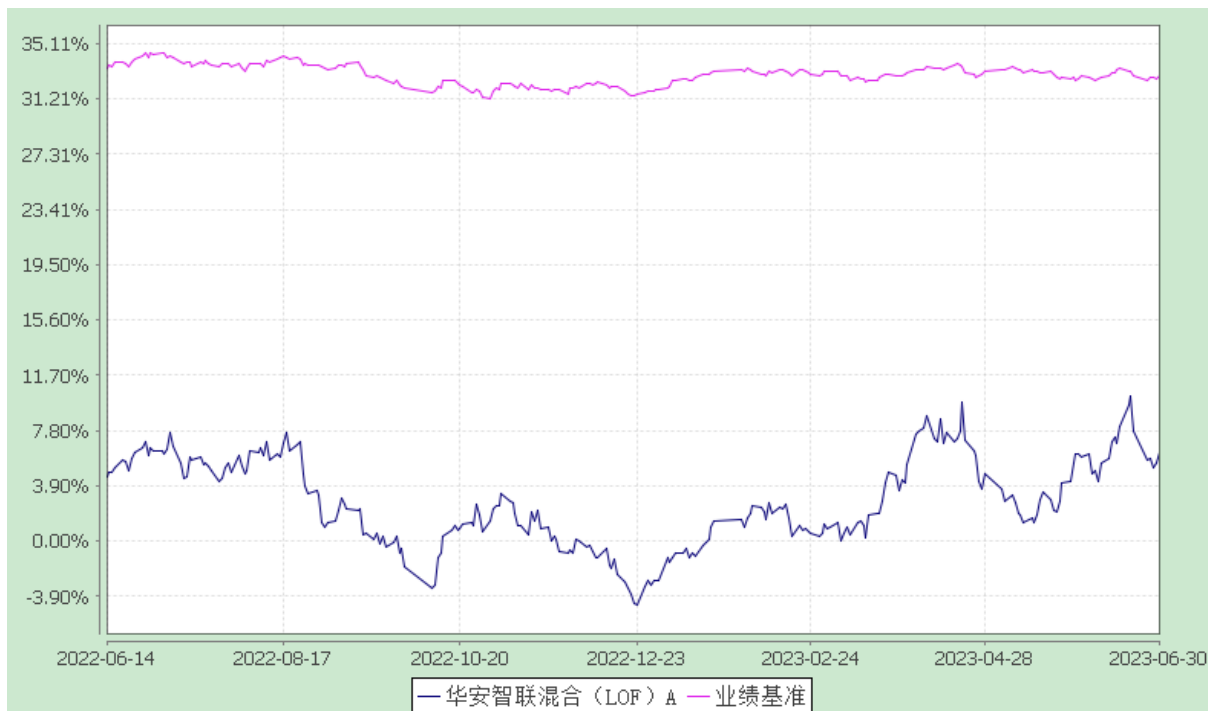
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安智联混合型证券投资基金（LOF）

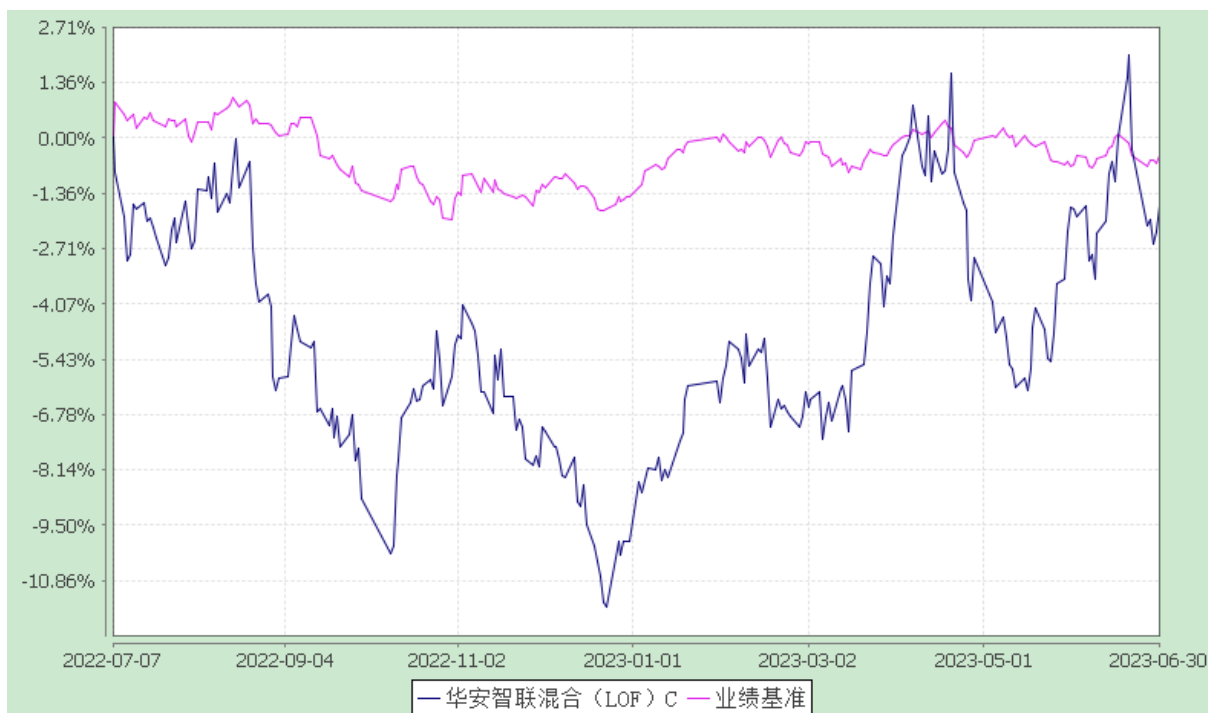
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2022 年 6 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日）

华安智联混合（LOF）A



华安智联混合（LOF）C



## 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		
朱才敏	本基金的基金经理	2021-03-08	-	15 年	硕士研究生，15 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，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。
李欣	本基金的基金经理	2022-03-28	-	13 年	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 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 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

报告期内，通信、传媒、计算机等行业涨幅居前，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。

在报告期内，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，在本报告期内，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 9.27%，同期业绩比较基准增长率为 0.98%。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 9.14%，同期业绩比较基准增长率为 0.98%。

#### 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 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# 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：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,198,579.89	34,251,569.50
结算备付金		329,743.10	1,016,690.32
存出保证金		47,455.86	106,289.06
交易性金融资产	6.4.7.2	248,310,546.45	280,735,019.95
其中：股票投资		123,836,469.75	120,795,828.87
基金投资		-	-
债券投资		124,474,076.70	159,939,191.08
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	18,009,124.38	13,053,964.10
应收清算款		1,034,207.89	5,253.70
应收股利		-	-



应收申购款		6,467.31	2,713.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>288,936,124.88</b>	<b>329,171,500.04</b>
<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>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		644,206.43	1,305,779.25
应付管理人报酬		169,754.24	198,245.86
应付托管费		48,501.21	56,641.68
应付销售服务费		57.29	152.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,031.32	6,528.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	441,564.63	621,279.49
负债合计		1,312,115.12	2,188,627.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	270,739,127.44	336,311,725.21
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	16,884,882.32	-9,328,852.41
净资产合计		287,624,009.76	326,982,872.80
负债和净资产总计		288,936,124.88	329,171,500.04

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 270,739,127.44 份，其中 A 类基金份额净值 1.0624 元，基金份额总额 270,515,146.05 份；C 类基金份额净值 1.0583 元，基金份额总额 223,981.39 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 14 日（基 金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		<b>30,532,074.02</b>	<b>9,349,842.99</b>

1.利息收入		150,028.16	250,830.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	45,500.86	64,095.52
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		104,527.30	186,734.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,655,146.85	-5,874,517.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,451,279.96	-5,929,701.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,689,240.71	8.57
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	514,626.18	55,176.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	20,626,851.87	14,642,130.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	100,047.14	331,398.65
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,520,928.30</b>	<b>286,001.73</b>
1. 管理人报酬		1,093,483.56	213,978.41
2. 托管费		312,423.86	61,136.70
3. 销售服务费		1,628.81	-
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		4,831.92	0.04
8. 其他费用	6.4.7.15	108,560.15	10,886.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>29,011,145.72</b>	<b>9,063,841.26</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>29,011,145.72</b>	<b>9,063,841.26</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>29,011,145.72</b>	<b>9,063,841.26</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安智联混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 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）	336,311,725.21	-	-9,328,852.41	326,982,872.80
二、本期期初净资产（基金净值）	336,311,725.21	-	-9,328,852.41	326,982,872.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,572,597.77	-	26,213,734.73	-39,358,863.04
（一）、综合收益总额	-	-	29,011,145.72	29,011,145.72
（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）	-65,572,597.77	-	-2,797,410.99	-68,370,008.76
其中：1.基金申购款	7,798,713.54	-	383,697.41	8,182,410.95
2.基金赎回款	-73,371,311.31	-	-3,181,108.40	-76,552,419.71
（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）	270,739,127.44	-	16,884,882.32	287,624,009.76

项目	上年度可比期间			
	2022 年 6 月 14 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）	988,565,281.49	-	47,858,737.90	1,036,424,019.39
二、本期期初净资产（基金净值）	988,565,281.49	-	47,858,737.90	1,036,424,019.39

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-470,817,496.51	-	-13,654,303.08	-484,471,799.59
（一）、综合收益总额	-	-	9,063,841.26	9,063,841.26
（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）	-470,817,496.51	-	-22,718,144.34	-493,535,640.85
其中：1.基金申购款	546,612.32	-	31,609.56	578,221.88
2.基金赎回款	-471,364,108.83	-	-22,749,753.90	-494,113,862.73
（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）	517,747,784.98	-	34,204,434.82	551,952,219.80

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

华安智联混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是根据《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基金合同》的有关规定，由华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华安科创主题混合基金”)转型而来。

根据《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基金合同》的规定，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封闭运作期为基金合同生效日(含)起至 3 年后的年度对日止的期间。封闭运作期届满后转为上市开放式基金(LOF)，基金名称调整为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”。根据本基金的基金管理人于 2022 年 6 月 11 日发布的《关于华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及转型相关安排的公告》，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封闭运作期于 2022 年 6 月 13 日届满，自 2022 年 6 月

14 日起自动转为上市开放式基金(LOF)，并接受场外、场内申购赎回，基金名称将变更为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”。经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)备案，基金管理人就基金合同、托管协议进行了修订，修订后的《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《华安智联混合型证券投资基金(LOF)托管协议》自 2022 年 6 月 14 日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金在上海证券交易所(以下简称“上交所”)挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《华安智联混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括科创板、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)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、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、同业存单、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)。本基金的投资组合比例：股票资产投资比例为 0%-45%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、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。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安智联混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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 1 月 1 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 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

##### (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。

## （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。

## （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### （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。

#### （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。

### 6.4.7 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	21,198,579.89
等于：本金	21,196,377.57
加：应计利息	2,202.32
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	21,198,579.89

### 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	116,772,422.61	-	123,836,469.75	7,064,047.14	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	122,640,366.57	2,054,855.70	124,474,076.70	-221,145.57
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	122,640,366.57	2,054,855.70	124,474,076.70	-221,145.57
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	239,412,789.18	2,054,855.70	248,310,546.45	6,842,901.57	

### 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

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	18,009,124.38	-
银行间市场	-	-
合计	18,009,124.38	-

#### 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 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	352,304.48
其中：交易所市场	352,304.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
合计	441,564.63

#### 6.4.7.7 实收基金

华安智联混合（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	336,301,859.13	336,301,859.13
本期申购	2,482,781.96	2,482,781.96
本期赎回（以“-”号填列）	-68,269,495.04	-68,269,495.04
本期末	270,515,146.05	270,515,146.05

华安智联混合（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期

	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	9,866.08	9,866.08
本期申购	5,315,931.58	5,315,931.58
本期赎回（以“-”号填列）	-5,101,816.27	-5,101,816.27
本期末	223,981.39	223,981.39

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安智联混合（LOF）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
上年度末	-3,479,251.30	-5,849,302.47	-9,328,553.77
本期期初	-3,479,251.30	-5,849,302.47	-9,328,553.77
本期利润	8,265,571.16	20,712,023.39	28,977,594.55
本期基金份额交易产生的变动数	616,009.89	-3,393,234.23	-2,777,224.34
其中：基金申购款	-24,430.84	127,479.11	103,048.27
基金赎回款	640,440.73	-3,520,713.34	-2,880,272.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,402,329.75	11,469,486.69	16,871,816.44

华安智联混合（LOF）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
上年度末	-127.34	-171.30	-298.64
本期期初	-127.34	-171.30	-298.64
本期利润	118,722.69	-85,171.52	33,551.17
本期基金份额交易产生的变动数	-115,009.18	94,822.53	-20,186.65
其中：基金申购款	-135,807.08	416,456.22	280,649.14
基金赎回款	20,797.90	-321,633.69	-300,835.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,586.17	9,479.71	13,065.88

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日

活期存款利息收入	41,172.44
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	3,871.08
其他	457.34
合计	45,500.86

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,451,279.96
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	7,451,279.96

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	204,172,702.94
减：卖出股票成本总额	196,135,012.48
减：交易费用	586,410.50
买卖股票差价收入	7,451,279.96

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,031,912.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-342,671.70
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	1,689,240.71

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	58,060,715.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,992,450.27
减：应计利息总额	1,410,911.98
减：交易费用	25.05
买卖债券差价收入	-342,671.70

## 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	514,626.18
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	514,626.18

## 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	20,626,851.87
——股票投资	19,632,108.45
——债券投资	994,743.42
——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	20,626,851.87

## 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
基金赎回费收入	100,047.14	
合计	100,047.14	

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
审计费用	29,752.78	
信息披露费	59,507.37	
证券出借违约金	-	
账户维护费	18,000.00	
银行汇划费	700.00	
其他费用	600.00	
合计	108,560.15	

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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。

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年6月14日（基金合同生效日） 至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	62,108,796.76	16.33%	25,401,000.21	25.44%

#### 6.4.9.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年6月14日（基金合同生效日） 至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	515,058.19	8.80%	0.00	0.00%

#### 6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	57,221.10	16.24%	57,221.10	16.24%
关联方名称	上年度可比期间 2022年6月14日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有 限公司	23,402.17	25.30%	169,571.76	22.75%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年6月14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	1,093,483.56	213,978.41
其中：支付销售机构的客户维护费	363,615.14	60,779.89

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年6月14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	312,423.86	61,136.70

### 6.4.9.2.3 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		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C	合计
华安基金管理有限公司	-	5.70	5.70
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	5.70	5.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年6月14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		
	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C	合计
合计	-	-	-



**6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.9.4.1 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及上年度末均未投资本基金。

**6.4.9.5 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1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年6月14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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	21,198,579.89	41,172.44	178,570,783.24	189,050.66

**6.4.9.6 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

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	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	688361	中科飞测	网下申购	2,491.00	58,787.60
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	1,963.00	66,722.37
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508.00	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581.00	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499.00	30,873.13

上年度可比期间 2022 年 6 月 14 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额

#### 6.4.10 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

#### 6.4.11 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 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

6.4.11.1 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
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6 个月(含)	新股限售	11.10	17.04	1,023.00	11,355.30	17,431.92	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6 个月(含)	新股限售	23.77	42.89	393.00	9,341.61	16,855.77	-
688361	中科飞测	2023-05-12	1-6 个月(含)	新股限售	23.60	64.67	250.00	5,900.00	16,167.50	-
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6 个月(含)	新股限售	5.69	5.41	2,864.00	16,296.16	15,494.24	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6 个月(含)	新股限售	37.88	29.49	460.00	17,424.80	13,565.40	-
688582	芯动联科	2023-06-21	1-6 个月(含)	新股限售	26.74	40.68	290.00	7,754.60	11,797.20	-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6 个月(含)	新股限售	135.80	120.41	92.00	12,493.60	11,077.72	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6 个月(含)	新股限售	41.20	42.69	258.00	10,629.60	11,014.02	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6 个月(含)	新股限售	26.80	22.32	476.00	12,756.80	10,624.32	-

001287	中电港	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	11.88	21.02	484.00	5,749.92	10,173.68	-
688334	西高院	2023-06-09	1-6个月(含)	新股限售	14.16	16.21	605.00	8,566.80	9,807.05	-
688620	安凯微	2023-06-15	1-6个月(含)	新股限售	10.68	12.34	778.00	8,309.04	9,600.52	-
301307	美利信	2023-04-14	1-6个月(含)	新股限售	32.34	31.86	280.00	9,055.20	8,920.80	-
688507	索辰科技	2023-04-10	1-6个月(含)	新股限售	245.56	122.11	49.00	12,032.44	5,983.39	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	122.11	24.00	-	2,930.64	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6个月(含)	新股限售	33.73	31.85	273.00	9,208.29	8,695.05	-
688552	航天南湖	2023-05-08	1-6个月(含)	新股限售	21.17	23.50	369.00	7,811.73	8,671.50	-
688535	华海诚科	2023-03-28	1-6个月(含)	新股限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
688429	时创能源	2023-06-20	1-6个月(含)	新股限售	19.20	25.53	321.00	6,163.20	8,195.13	-
688570	天玛智控	2023-05-29	1-6个月(含)	新股限售	30.26	25.33	312.00	9,441.12	7,902.96	-
688512	慧智微	2023-05-08	1-6个月(含)	新股限售	20.92	19.16	397.00	8,305.24	7,606.52	-
688603	天承科技	2023-06-30	1-6个月(含)	新股限售	55.00	55.00	133.00	7,315.00	7,315.00	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6个月(含)	新股限售	29.99	23.79	296.00	8,877.04	7,041.84	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月	新股限售	44.18	25.10	200.00	8,836.00	5,020.00	-

			(含)							
30128 1	科源 制药	2023-0 5-26	1-6 个 月 (含)	新股 限售- 送股	-	25.10	80.00	-	2,008. 00	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	1-6 个 月 (含)	新股 限售	6.58	7.58	923.00	6,073. 34	6,996. 34	-
68863 1	莱斯 信息	2023-0 6-19	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.28	29.87	233.00	5,890. 24	6,959. 71	-
30120 3	国泰 环保	2023-0 3-28	1-6 个 月 (含)	新股 限售	46.13	34.40	199.00	9,179. 87	6,845. 60	-
30143 9	泓淋 电力	2023-0 3-10	1-6 个 月 (含)	新股 限售	19.99	16.90	358.00	7,156. 42	6,050. 20	-
68862 3	双元 科技	2023-0 5-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	125.88	86.79	68.00	8,559. 84	5,901. 72	-
68847 9	友车 科技	2023-0 5-04	1-6 个 月 (含)	新股 限售	33.99	29.49	197.00	6,696. 03	5,809. 53	-
30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	1-6 个 月 (含)	新股 限售	73.45	46.64	110.00	8,079. 50	5,130. 40	-
60106 5	江盐 集团	2023-0 3-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	10.36	11.84	326.00	3,377. 36	3,859. 84	-
60113 3	柏诚 股份	2023-0 3-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	11.66	12.26	300.00	3,498. 00	3,678. 00	-
00132 8	登康 口腔	2023-0 3-29	1-6 个 月 (含)	新股 限售	20.68	25.49	140.00	2,895. 20	3,568. 60	-
00136 0	南矿 集团	2023-0 3-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	15.38	14.87	177.00	2,722. 26	2,631. 99	-
60312 5	常青 科技	2023-0 3-30	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.98	24.53	104.00	2,701. 92	2,551. 12	-
00136 7	海森 药业	2023-0 3-30	1-6 个 月 (含)	新股 限售	44.48	39.48	55.00	2,446. 40	2,171. 40	-
68860	天承	2023-0	1 个月	新股	55.00	55.00	1,188.	65,340	65,340	-

3	科技	6-30	内 (含)	未上 市			00	.00	.00	
---	----	------	----------	---------	--	--	----	-----	-----	--

#### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12 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高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪科创板企业所处行业，努力探寻具备长期价值增长潜力的科创板上市公司。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。

##### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,539,367.12	30,205,684.93
合计	30,539,367.12	30,205,684.93

注：未评级债券为国债。

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	51,214,101.83	97,367,445.19
AAA 以下	175,531.59	442,691.10
未评级	42,545,076.16	31,923,369.86
合计	93,934,709.58	129,733,506.15

注：未评级债券为国债、公司债。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度可比期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.12.3 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。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。



本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.12.4.1.1 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	21,198,579.89	-	-	-	21,198,579.89
结算备付金	329,743.10	-	-	-	329,743.10
存出保证金	47,455.86	-	-	-	47,455.86
交易性金融资产	43,129,319.98	81,344,756.72	-	123,836,469.75	248,310,546.45
买入返售金融资产	18,009,124.38	-	-	-	18,009,124.38
应收清算款	-	-	-	1,034,207.89	1,034,207.89
应收申购款	-	-	-	6,467.31	6,467.31
资产总计	82,714,223.21	81,344,756.72	-	124,877,144.95	288,936,124.88
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	-	-	-	644,206.43	644,206.43
应付管理人报酬	-	-	-	169,754.24	169,754.24
应付托管费	-	-	-	48,501.21	48,501.21
应付销售服务费	-	-	-	57.29	57.29
应交税费	-	-	-	8,031.32	8,031.32
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	441,564.63	441,564.63
负债总计	-	-	-	1,312,115.12	1,312,115.12
利率敏感度缺口	82,714,223.21	81,344,756.72	-	123,565,029.83	287,624,009.72

					6
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,251,569.50	-	-	-	34,251,569.50
结算备付金	1,016,690.32	-	-	-	1,016,690.32
存出保证金	106,289.06	-	-	-	106,289.06
交易性金融资产	92,941,814.92	66,997,376.16	-	120,795,828.87	280,735,019.95
买入返售金融资产	13,053,964.10	-	-	-	13,053,964.10
应收清算款	-	-	-	5,253.70	5,253.70
应收申购款	-	-	-	2,713.41	2,713.41
资产总计	141,370,327.90	66,997,376.16	-	120,803,795.98	329,171,500.04
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	-	-	-	1,305,779.25	1,305,779.25
应付管理人报酬	-	-	-	198,245.86	198,245.86
应付托管费	-	-	-	56,641.68	56,641.68
应付销售服务费	-	-	-	152.75	152.75
应交税费	-	-	-	6,528.21	6,528.21
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	621,279.49	621,279.49
负债总计	-	-	-	2,188,627.24	2,188,627.24
利率敏感度缺口	141,370,327.90	66,997,376.16	-	118,615,168.74	326,982,872.80

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
市场利率下降 25 个基点	381,607.64	454,533.23
市场利率上升 25 个基点	-380,235.71	-451,523.44

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。本基金管理人根据多因素框架的分析结果，给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-45%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、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。

#### 6.4.12.4.3.1 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	123,836,469. 75	43.05	120,795,828.8 7	36.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	375,911.77	0.13	1,714,196.29	0.52
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>124,212,381. 52</b>	<b>43.19</b>	<b>122,510,025.1 6</b>	<b>37.47</b>

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	10,340,000.00	33,430,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-10,340,000.00	-33,430,000.00

#### 6.4.13 公允价值

##### 6.4.13.1 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.13.1.1 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	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	123,842,738.87	121,853,170.30
第二层次	124,170,819.93	158,224,994.79

第三层次	296,987.65	656,854.86
合计	248,310,546.45	280,735,019.95

## 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	123,836,469.75	42.86
	其中：股票	123,836,469.75	42.86
2	基金投资	-	-
3	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	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,528,322.99	7.45
8	其他各项资产	1,088,131.06	0.38
9	合计	288,936,124.88	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

### 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	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
11	688496	清越科技	159,288	3,166,645.44	1.10
12	688486	龙迅股份	27,691	3,047,394.55	1.06
13	688111	金山办公	6,332	2,990,097.04	1.04
14	688118	普元信息	85,161	2,940,609.33	1.02
15	300782	卓胜微	28,160	2,721,100.80	0.95
16	688286	敏芯股份	42,306	2,664,431.88	0.93
17	688515	裕太微	13,598	2,334,232.68	0.81

18	300394	天孚通信	21,600	2,307,528.00	0.80
19	688220	翱捷科技	28,491	2,147,936.49	0.75
20	300188	美亚柏科	93,600	1,945,944.00	0.68
21	603893	瑞芯微	26,200	1,908,670.00	0.66
22	688475	萤石网络	44,082	1,889,354.52	0.66
23	688072	拓荆科技	3,811	1,623,371.67	0.56
24	002920	德赛西威	10,200	1,589,262.00	0.55
25	688361	中科飞测	19,144	1,584,558.44	0.55
26	603595	东尼电子	35,600	1,524,392.00	0.53
27	688661	和林微纳	21,119	1,484,665.70	0.52
28	688047	龙芯中科	12,864	1,476,658.56	0.51
29	688153	唯捷创芯	19,523	1,428,302.68	0.50
30	300604	长川科技	24,220	1,150,207.80	0.40
31	002241	歌尔股份	61,200	1,086,300.00	0.38
32	000021	深科技	52,800	1,055,472.00	0.37
33	300316	晶盛机电	13,800	978,420.00	0.34
34	688623	二元科技	10,551	968,974.93	0.34
35	002415	海康威视	28,100	930,391.00	0.32
36	300613	富瀚微	15,678	889,569.72	0.31
37	002156	通富微电	38,600	872,360.00	0.30
38	300015	爱尔眼科	44,602	827,367.10	0.29
39	002230	科大讯飞	12,100	822,316.00	0.29
40	000938	紫光股份	24,800	789,880.00	0.27
41	603690	至纯科技	22,440	781,809.60	0.27
42	002436	兴森科技	49,800	771,900.00	0.27
43	600021	上海电力	70,000	753,900.00	0.26
44	600633	浙数文化	44,200	716,482.00	0.25
45	600763	通策医疗	7,200	697,392.00	0.24
46	688029	南微医学	8,368	682,494.08	0.24
47	300012	华测检测	34,000	663,000.00	0.23
48	002001	新 和 成	38,544	593,577.60	0.21
49	300413	芒果超媒	17,200	588,412.00	0.20
50	000739	普洛药业	32,300	573,002.00	0.20
51	300747	锐科激光	17,842	543,824.16	0.19
52	002353	杰瑞股份	20,900	525,217.00	0.18
53	688498	源杰科技	1,669	475,665.00	0.17
54	002690	美亚光电	17,120	440,840.00	0.15
55	002597	金禾实业	18,500	436,600.00	0.15
56	688107	安路科技	7,821	433,205.19	0.15
57	603239	浙江仙通	26,600	432,782.00	0.15
58	688428	诺诚健华	33,088	382,166.40	0.13
59	688622	禾信仪器	9,641	342,255.50	0.12
60	601311	骆驼股份	34,400	319,232.00	0.11
61	688031	星环科技	2,177	290,063.48	0.10

62	688120	华海清科	1,118	281,791.90	0.10
63	688343	云天励飞	4,160	264,617.60	0.09
64	301368	丰立智能	3,368	233,031.92	0.08
65	300693	盛弘股份	6,137	226,578.04	0.08
66	688472	阿特斯	10,225	186,380.64	0.06
67	301358	湖南裕能	3,930	172,519.14	0.06
68	688469	中芯集成	28,633	161,604.47	0.06
69	301366	一博科技	3,706	161,025.70	0.06
70	688539	高华科技	3,413	158,363.20	0.06
71	301361	众智科技	5,169	145,714.11	0.05
72	688443	智翔金泰	4,592	141,285.52	0.05
73	301296	新巨丰	7,981	134,719.28	0.05
74	688582	芯动联科	2,897	133,935.15	0.05
75	688105	诺唯赞	4,362	132,997.38	0.05
76	301339	通行宝	5,284	132,786.92	0.05
77	001287	中电港	4,840	131,183.36	0.05
78	301328	维峰电子	2,239	127,488.66	0.04
79	688576	西山科技	912	120,186.92	0.04
80	301277	新天地	6,098	118,971.98	0.04
81	301141	中科磁业	2,576	117,873.82	0.04
82	688084	晶品特装	1,343	116,666.41	0.04
83	301270	汉仪股份	2,095	114,407.95	0.04
84	301280	珠城科技	3,088	110,426.88	0.04
85	301303	真兰仪表	4,758	108,510.84	0.04
86	688334	西高院	6,043	107,473.53	0.04
87	688503	聚和材料	1,091	106,372.50	0.04
88	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.04
89	688620	安凯微	7,775	103,500.26	0.04
90	301356	天振股份	4,415	96,688.50	0.03
91	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.03
92	301398	星源卓镁	2,549	95,587.50	0.03
93	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.03
94	301307	美利信	2,792	93,851.52	0.03
95	688507	索辰科技	715	92,778.49	0.03
96	688552	航天南湖	3,686	92,558.43	0.03
97	688429	时创能源	3,209	91,802.73	0.03
98	301290	东星医疗	2,764	88,586.20	0.03
99	301373	凌玮科技	2,730	88,277.28	0.03
100	301115	建科股份	3,850	88,011.00	0.03
101	300627	华测导航	2,700	87,669.00	0.03
102	688115	思林杰	2,153	83,170.39	0.03
103	688570	天玛智控	3,112	82,494.96	0.03
104	301316	慧博云通	3,584	81,894.40	0.03
105	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.03



106	688512	慧智微	3,964	81,372.08	0.03
107	301176	逸豪新材	4,679	80,385.22	0.03
108	601061	中信金属	9,224	79,879.12	0.03
109	301388	欣灵电气	2,920	78,402.00	0.03
110	301265	华新环保	6,709	77,958.58	0.03
111	688631	莱斯信息	2,324	75,042.67	0.03
112	301386	未来电器	2,952	73,919.92	0.03
113	301281	科源制药	2,787	73,162.66	0.03
114	688603	天承科技	1,321	72,655.00	0.03
115	688267	中触媒	3,390	71,427.30	0.02
116	301203	国泰环保	1,981	70,623.38	0.02
117	688420	美腾科技	1,788	69,249.24	0.02
118	688391	钜泉科技	990	67,973.40	0.02
119	688071	华依科技	1,101	67,326.15	0.02
120	601136	首创证券	4,739	67,151.63	0.02
121	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.02
122	301439	泓淋电力	3,573	63,405.80	0.02
123	688479	友车科技	1,963	61,385.55	0.02
124	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.02
125	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
126	301345	涛涛车业	1,094	52,077.04	0.02
127	001328	登康口腔	1,400	44,884.00	0.02
128	601133	柏诚股份	2,992	43,815.72	0.02
129	601065	江盐集团	3,251	43,142.59	0.01
130	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
131	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01
132	688663	新风光	988	31,408.52	0.01
133	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.01
134	603125	常青科技	1,032	28,952.72	0.01
135	301263	泰恩康	1,228	25,640.64	0.01
136	001367	海森药业	549	24,687.92	0.01
137	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
138	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
139	688259	创耀科技	234	18,521.10	0.01
140	301363	美好医疗	384	16,892.16	0.01
141	301327	华宝新能	205	16,217.55	0.01
142	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.01
143	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
144	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
145	301377	鼎泰高科	539	12,397.00	0.00
146	301152	天力锂能	260	11,611.60	0.00
147	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
148	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
149	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00

150	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
151	300774	倍杰特	444	5,168.16	0.00
152	603456	九洲药业	96	2,628.48	0.00
153	002466	天齐锂业	12	838.92	0.00
154	300996	普联软件	1	30.70	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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000977	浪潮信息	8,804,479.00	2.69
2	002371	北方华创	8,566,141.00	2.62
3	688008	澜起科技	8,159,868.47	2.50
4	688256	寒武纪	8,041,482.34	2.46
5	300496	中科创达	7,379,131.00	2.26
6	000063	中兴通讯	6,293,968.00	1.92
7	601138	工业富联	6,157,134.00	1.88
8	688052	纳芯微	5,010,099.60	1.53
9	688475	萤石网络	4,553,070.51	1.39
10	688032	禾迈股份	4,406,364.59	1.35
11	002241	歌尔股份	4,018,692.00	1.23
12	688036	传音控股	3,955,185.61	1.21
13	000066	中国长城	3,843,656.00	1.18
14	688041	海光信息	3,534,859.59	1.08
15	603290	斯达半导	3,413,959.00	1.04
16	002230	科大讯飞	3,300,850.00	1.01
17	688496	清越科技	3,162,198.21	0.97
18	688515	裕太微	3,046,922.32	0.93
19	002131	利欧股份	2,983,063.00	0.91
20	688561	奇安信	2,788,850.33	0.85

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

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688111	金山办公	9,458,702.22	2.89
2	300496	中科创达	7,150,695.30	2.19

3	000977	浪潮信息	6,240,599.00	1.91
4	601138	工业富联	5,058,945.00	1.55
5	300014	亿纬锂能	5,001,167.15	1.53
6	301095	广立微	4,966,130.40	1.52
7	300567	精测电子	4,665,243.00	1.43
8	603496	恒为科技	4,496,936.00	1.38
9	603290	斯达半导	4,410,450.00	1.35
10	688052	纳芯微	4,303,404.11	1.32
11	688047	龙芯中科	3,982,965.71	1.22
12	002230	科大讯飞	3,902,964.00	1.19
13	300274	阳光电源	3,714,480.00	1.14
14	002897	意华股份	3,709,240.00	1.13
15	688475	萤石网络	3,646,897.37	1.12
16	688256	寒武纪	3,563,674.14	1.09
17	002236	大华股份	3,264,200.00	1.00
18	300693	盛弘股份	3,259,523.71	1.00
19	002371	北方华创	3,241,091.74	0.99
20	688032	禾迈股份	3,102,562.68	0.95

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	179,543,544.91
卖出股票的收入（成交）总额	204,172,702.94

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	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

### 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	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

### 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国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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

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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	47,455.86
2	应收清算款	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

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

## 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	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
华安智联混合 （LOF）A	38,101	7,099.95	2,487,043.04	0.92%	268,028,103.01	99.08%
华安智联混合 （LOF）C	57	3,929.50	0.00	0.00%	223,981.39	100.00 %
合计	38,158	7,095.21	2,487,043.04	0.92%	268,252,084.40	99.08%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	何树红	3,847,154.00	6.64%
2	龚晖	2,162,175.00	3.73%
3	吕华	1,730,100.00	2.99%
4	张能鸿	1,359,122.00	2.35%
5	宁波万坤投资管理合伙企业（有限合伙）—万坤东方点睛8号多策略灵活配置私募证券	1,280,016.00	2.21%
6	邵常红	1,111,023.00	1.92%
7	李思宇	1,000,000.00	1.73%
8	刘要定	900,000.00	1.55%
9	夏凤文	830,018.00	1.43%
10	吕芸	775,788.00	1.34%

## 8.3 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	华安智联混合（LOF）A	159,819.59	0.06%
	华安智联混合（LOF）C	1,867.68	0.83%
	合计	161,687.27	0.06%

## 8.4 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	华安智联混合（LOF）A	0~10
	华安智联混合（LOF）C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华安智联混合（LOF）A	-
	华安智联混合（LOF）C	-

	合计	-
--	----	---

注：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	华安智联混合（LOF）A	华安智联混合（LOF）C
基金合同生效日（2022 年 6 月 14 日）基金份额总额	988,565,281.49	-
本报告期期初基金份额总额	336,301,859.13	9,866.08
本报告期基金总申购份额	2,482,781.96	5,315,931.58
减：本报告期基金总赎回份额	68,269,495.04	5,101,816.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	270,515,146.05	223,981.39

## 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：

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 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。

## 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	
财通证券	1	80,720,625.32	21.23%	74,367.79	21.11%	-
国泰君安证券	2	62,108,796.76	16.33%	57,221.10	16.24%	-
华泰证券	1	60,027,721.52	15.79%	55,904.62	15.87%	-
方正证券	3	41,075,232.87	10.80%	37,842.46	10.74%	-
中信证券	1	38,148,651.22	10.03%	35,527.76	10.08%	-
中信建投	2	24,559,865.39	6.46%	22,873.03	6.49%	-
天风证券	2	23,833,809.53	6.27%	22,189.21	6.30%	-
国盛证券	1	15,897,386.07	4.18%	14,805.46	4.20%	-
广发证券	1	13,817,578.12	3.63%	12,868.24	3.65%	-
中金公司	1	8,034,155.35	2.11%	7,482.41	2.12%	-
长江证券	2	5,678,591.19	1.49%	5,288.24	1.50%	-
银河证券	1	5,652,110.58	1.49%	5,263.75	1.49%	-
招商证券	3	719,936.15	0.19%	670.41	0.19%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-



诚通证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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：

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	
	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
财通证券	284,444.63	4.86%	-	-	-	-
国泰君安证券	515,058.19	8.80%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	59,000,000.00	26.22%	-	-
方正证券	3,977.17	0.07%	-	-	-	-
中信证券	-	-	47,500,000.00	21.11%	-	-
中信建投	4,977,681.37	85.02%	23,500,000.00	10.44%	-	-
天风证券	31,000.00	0.53%	10,000,000.00	4.44%	-	-
国盛证券	42,228.76	0.72%	39,000,000.00	17.33%	-	-
广发证券	-	-	12,000,000.00	5.33%	-	-
中金公司	-	-	7,000,000.00	3.11%	-	-
长江证券	-	-	13,000,000.00	5.78%	-	-
银河证券	-	-	4,000,000.00	1.78%	-	-
招商证券	-	-	10,000,000.00	4.44%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

诚通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

## 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	华安智联混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-01-20
2	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（亿道信息）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-03
3	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（多利科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-17
4	华安智联混合型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-30
5	华安智联混合型证券投资基金（LOF）2023 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	2023-04-21
6	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（友车科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-05
7	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(中科飞测)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-13

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》
- 4、中国证监会批准华安智联混合型证券投资基金（LOF）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

二〇二三年八月三十日