

华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.11 投资组合报告附注.....	48
8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50

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	50
9 开放式基金份额变动	51
10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	华安添利 6 个月债券	
基金主代码	010619	
交易代码	010619	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 5 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,467,092,896.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安添利 6 个月债券 A	华安添利 6 个月债券 C
下属分级基金的交易代码	010619	010620
报告期末下属分级基金的份额总额	1,158,356,552.01 份	308,736,344.72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用多因素分析框架,从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面,采取定量与定性相结合的分析方法,给出股票、债券和货币市场工具等大类资产投资机会的整体评估,作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期,调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	姜敏
	联系电话	021-38969999	4006800000
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		4008850099	95558
传真		021-68863414	010-85230024

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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码	200120	100020
法定代表人	朱学华	朱鹤新

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、 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1月1日至2023年6月30日）	
	华安添利6个月债券A	华安添利6个月债券C
本期已实现收益	-1,336,504.82	-1,032,421.70
本期利润	34,266,700.81	8,035,263.16
加权平均基金份额本期利润	0.0228	0.0205
本期加权平均净值利润率	2.26%	2.05%
本期基金份额净值增长率	2.03%	1.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	华安添利6个月债券A	华安添利6个月债券C
期末可供分配利润	6,438,338.43	-1,248,134.86
期末可供分配基金份额利润	0.0056	-0.0040
期末基金资产净值	1,177,150,535.89	310,736,346.03
期末基金份额净值	1.0162	1.0065

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	华安添利 6 个月债券 A	华安添利 6 个月债券 C
基金份额累计净值增长率	1.62%	0.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安添利 6 个月债券 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	0.67%	0.20%	0.22%	0.09%	0.45%	0.11%
过去三个月	0.82%	0.20%	0.32%	0.08%	0.50%	0.12%
过去六个月	2.03%	0.18%	1.10%	0.08%	0.93%	0.10%
过去一年	0.33%	0.18%	-0.05%	0.10%	0.38%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.62%	0.17%	1.06%	0.12%	0.56%	0.05%

华安添利 6 个月债券 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	0.64%	0.20%	0.22%	0.09%	0.42%	0.11%
过去三个月	0.72%	0.19%	0.32%	0.08%	0.40%	0.11%
过去六个月	1.83%	0.17%	1.10%	0.08%	0.73%	0.09%
过去一年	-0.07%	0.18%	-0.05%	0.10%	-0.02%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.65%	0.17%	1.06%	0.12%	-0.41%	0.05%

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

华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 2 月 5 日至 2023 年 6 月 30 日)

华安添利 6 个月债券 A



华安添利 6 个月债券 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		
陆奔	本基金的基金经理	2021-02-05	-	11 年	硕士研究生，11 年基金行业从业经历。2011 年加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 9 月起，担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月至 2019 年 1 月，同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2020 年 2 月，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安添利 6 个月持

					<p>有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安兴安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
周益鸣	本基金的基金经理	2021-02-05	-	14 年	<p>硕士，14 年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010 年 6 月加入华安基金，历任集中交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2018 年 6 月至 2023 年 5 月，担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月至 2020 年 10 月，同时担任华安安盛 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，同时担任华安安业债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安和债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 5 月，同时担任华安安敦债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月去，同时担任华安可转换债券债券型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，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安安心收益债券型证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券</p>

					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

上半年，中国宏观经济走出疫情的困扰，在一季度有明显的反弹，步入二季度受到去年拿地相对较少的拖累，经济略有压力，但整体看投资、消费和进出口都处于相对合理的区间内。海外宏观经济相对平稳，虽然有一些风险事件的爆发（例如 SVB 事件等），但没有出现显著的系统性问题。在美国就业市场上，由于居民资产负债状况相对较好，需求没有明显转弱，非农就业数据一直处于较强的水平，推动美债利率有所上行。美联储在上半年维持加息步伐，但由于通胀压力有所缓解，市场对于后续货币政策预期有所转松。

债券市场利率在上半年整体处于下行通道，其中 30 年国债创出近几年的新低，信用利差维持在相对中性的水平。部分地区城投平台的估值虽然有所波动，但并未产生实质性的信用风险事件。可转债受低利率环境的支撑，转股溢价率维持在相对高位，但二季度股票市场整体有所回调，制约了可转债的表现。

股票市场方面，二季度宽基指数略有转弱，但结构性机会凸显。AI 产业链为首的数字经济板块

出现大幅上涨，中特估值板块也有过阶段性行情，但消费和地产链条个股表现较差。市场走势同宏观经济和产业政策契合度高，显示市场对于中国经济转型有强烈的诉求，新老经济动能正在持续的转换。

报告期内，本基金继续按照“固收+”策略布局投资，仓位维持积极水平，风格维持均衡，积极寻求结构性机会。

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 1.0162 元，本报告期份额净值增长率为 2.03%；本基金 C 类份额净值为 1.0065 元，本报告期份额净值增长率为 1.83%，同期业绩比较基准增长率为 1.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济有利因素将进一步增加。6 月的 PMI 指标已经有所好转，工业企业利润降幅收窄，预示着本轮去库周期接近尾声。政策方面，国常会强调必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好，而 6 月末央行降低 MLF 和 LPR 利率意味着政策工具箱已经被打开。下半年宏观经济本身有自然见底的迹象，同时叠加房地产、消费等刺激政策的出台，有望迎来较为全面的复苏。

债券市场利率目前处于相对低位，虽然从货币政策层面看有利于利率下行，但如果房地产和财政方面有进一步的宽松举措，可能会不利于债券市场，因此我们倾向于认为债券利率将在下一阶段维持震荡，不易出现上半年单边下行的行情。

对于股票市场，我们认为下跌空间有限，有很强的配置价值。一方面，企业盈利增速可能在下半年有所提高；另一方面，当前市场的估值水平在历史中枢下方，且和债券收益率相比，股票的风险溢价率水平非常有吸引力。我们关注到近期政策进一步强调消费对于经济增长的重要意义，出台了新能源车购置税减免政策，同时还将出台对家居消费的刺激计划，因此下一阶段的市场风格可能会趋于平衡，成长和消费板块都有机会。

在低利率环境下，可转债的溢价率水平会在高位维持震荡，收益的来源依然来自于股票的上涨。我们会积极关注一些原本是传统制造业的公司，如果能够依靠 AI、机器人和新能源等行业性机会完成转型，或者发现新的业务增长点，那股票和转债的估值都会有提高的空间。同时，金融类转债在宏观经济上行阶段，叠加相对较低的溢价率，可能也会有不错的表现，但部分品种需要关注强赎的风险。

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的利益。

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合规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金 2023 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华安管理有限公司在华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在

损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华安管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

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：华安添利6个月持有期债券型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,768,513.87	55,139,252.05
结算备付金		137,544.84	189,334.46
存出保证金		114,386.96	226,173.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,530,597,929.32	2,306,233,561.17
其中：股票投资		255,825,867.72	365,912,730.75
基金投资		-	-
债券投资		1,274,772,061.60	1,940,320,830.42
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	39,905,065.81	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		239.66	864.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,585,523,680.46	2,361,789,186.24
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		90,520,635.54	-
应付清算款		1,789.20	-
应付赎回款		5,358,024.78	1,195,287.29
应付管理人报酬		879,471.63	1,418,376.57
应付托管费		125,638.80	202,625.25
应付销售服务费		104,217.25	162,993.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		46,800.47	85,413.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	600,220.87	1,131,195.51
负债合计		97,636,798.54	4,195,891.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,467,092,896.73	2,370,714,760.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	20,793,985.19	-13,121,466.15
净资产合计		1,487,886,881.92	2,357,593,294.34
负债和净资产总计		1,585,523,680.46	2,361,789,186.24

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,467,092,896.73 份，其中 A 类基金份额净值 1.0162 元，基金份额总额 1,158,356,552.01 份；C 类基金份额净值 1.0065 元，基金份额总额 308,736,344.72 份。

6.2 利润表

会计主体：华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		51,593,333.89	-51,696,971.23
1.利息收入	6.4.7.9	155,480.22	522,173.68
其中：存款利息收入		81,755.38	164,343.04
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		73,724.84	357,830.64
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,766,963.18	13,699,681.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-15,021,639.55	-35,949,392.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,509,153.48	44,866,420.17
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	3,279,449.25	4,782,652.92
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	44,670,890.49	-65,918,825.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、营业总支出		9,291,369.92	17,360,439.39
1. 管理人报酬	6.4.9.1.1	6,655,394.16	13,230,225.34
2. 托管费	6.4.9.1.2	950,770.59	1,890,032.19
3. 销售服务费		781,309.67	1,518,050.50
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		717,183.93	442,171.76
其中：卖出回购金融资产支出		717,183.93	442,171.76
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		41,835.62	120,508.46
8. 其他费用	6.4.7.14	144,875.95	159,451.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,301,963.97	-69,057,410.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,301,963.97	-69,057,410.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		42,301,963.97	-69,057,410.62

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金

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）	2,370,714,760.49	-	-13,121,466.15	2,357,593,294.34
二、本期期初净资产（基金净值）	2,370,714,760.49	-	-13,121,466.15	2,357,593,294.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-903,621,863.76	-	33,915,451.34	-869,706,412.42
（一）、综合收益总额	-	-	42,301,963.97	42,301,963.97
（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）	-903,621,863.76	-	-8,386,512.63	-912,008,376.39
其中：1.基金申购款	589,812.72	-	3,806.97	593,619.69
2.基金赎回款	-904,211,676.48	-	-8,390,319.60	-912,601,996.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,467,092,896.73	-	20,793,985.19	1,487,886,881.92

项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 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）	4,719,060,288.50	-	128,121,223.93	4,847,181,512.43
二、本期期初净资产（基金净值）	4,719,060,288.50	-	128,121,223.93	4,847,181,512.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,440,637,826.64	-	-89,632,116.50	-1,530,269,943.14
（一）、综合收益总额	-	-	-69,057,410.62	-69,057,410.62
（二）、本期基金份额交易产生的	-1,440,637,826.64	-	-20,574,705.88	-1,461,212,532.52

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中：1.基金申购 款	2,246,084.55	-	29,162.01	2,275,246.56
2.基金赎回款	-1,442,883,911.19	-	-20,603,867.89	-1,463,487,77 9.08
(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)	3,278,422,461.86	-	38,489,107.43	3,316,911,569. 29

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

华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2791 号《关于准予华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 2 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 11,551,289,823.43 份基金份额。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及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（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、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、债券回购、股票（包括中小板、创业

板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于股票等资产的比例合计不超过基金资产的 20%,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率 \times 90%+中证 800 指数收益率 \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 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。

6.4.4.1 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。

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。

本基金持有的金融工具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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本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相应类别的基金份额进行再投资。投资人选择红利再投资方式取得的基金份额，其持有期限视同收益分配前原基金份额持有期限，即在原基金份额最短持有期到期后即可进行赎回或转换转出；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(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) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对上述基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 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	14,768,513.87
等于：本金	14,765,432.66
加：应计利息	3,081.21
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	14,768,513.87

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	257,906,377.53	-	255,825,867.72	-2,080,509.81	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	106,240,201.01	246,719.33	107,851,486.90	1,364,566.56
	银行间市 场	1,150,365,593.66	12,796,574.70	1,166,920,574.70	3,758,406.34
	合计	1,256,605,794.67	13,043,294.03	1,274,772,061.60	5,122,972.90
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,514,512,172.20	13,043,294.03	1,530,597,929.32	3,042,463.09	

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	-	-
银行间市场	39,905,065.81	-
合计	39,905,065.81	-

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	406,082.52
其中：交易所市场	397,413.16
银行间市场	8,669.36
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	134,630.98
合计	600,220.87

6.4.7.7 实收基金

华安添利 6 个月债券 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	1,891,350,263.53	1,891,350,263.53

本期申购	360,181.85	360,181.85
本期赎回（以“-”号填列）	-733,353,893.37	-733,353,893.37
本期末	1,158,356,552.01	1,158,356,552.01

华安添利 6 个月债券 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	479,364,496.96	479,364,496.96
本期申购	229,630.87	229,630.87
本期赎回（以“-”号填列）	-170,857,783.11	-170,857,783.11
本期末	308,736,344.72	308,736,344.72

6.4.7.8 未分配利润

华安添利 6 个月债券 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	8,692,888.93	-16,262,664.60	-7,569,775.67
本期利润	-1,336,504.82	35,603,205.63	34,266,700.81
本期基金份额交易产生的变动数	-918,045.68	-6,984,895.58	-7,902,941.26
其中：基金申购款	118.81	3,564.69	3,683.50
基金赎回款	-918,164.49	-6,988,460.27	-7,906,624.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,438,338.43	12,355,645.45	18,793,983.88

华安添利 6 个月债券 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	-1,433,647.90	-4,118,042.58	-5,551,690.48
本期利润	-1,032,421.70	9,067,684.86	8,035,263.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,217,934.74	-1,701,506.11	-483,571.37
其中：基金申购款	-1,766.82	1,890.29	123.47
基金赎回款	1,219,701.56	-1,703,396.40	-483,694.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,248,134.86	3,248,136.17	2,000,001.31

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	76,801.08
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	3,436.87
其他	1,517.43
合计	81,755.38

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	-15,021,639.55
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	-15,021,639.55

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	281,352,398.43
减：卖出股票成本总额	295,661,434.50
减：交易费用	712,603.48
买卖股票差价收入	-15,021,639.55

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	17,919,001.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及	590,151.72

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	18,509,153.48

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	1,269,371,364.75
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	1,251,227,768.33
减：应计利息总额	17,542,145.09
减：交易费用	11,299.61
买卖债券差价收入	590,151.72

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	3,279,449.25
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	3,279,449.25

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	44,670,890.49
——股票投资	37,157,678.80
——债券投资	7,513,211.69
——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	44,670,890.49

6.4.7.14 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	22,437.60
账户维护费	17,700.00
其他费用	600.00
合计	144,875.95

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、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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

无。

6.4.9.1.2 债券交易

无。

6.4.9.1.3 债券回购交易

无。

6.4.9.1.4 应支付关联方的佣金

无。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,655,394.16	13,230,225.34
其中：支付销售机构的客户维护费	2,990,609.49	5,945,902.63

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	950,770.59	1,890,032.19

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.2.3 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		
	华安添利 6 个月债券	华安添利 6 个月债券 C	合计

	A		
华安基金管理有限公司	-	1,293.92	1,293.92
中信银行股份有限公司	-	765,287.58	765,287.58
合计	-	766,581.50	766,581.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安添利6个月债券 A	华安添利6个月债券C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	8.65	8.65
华安基金管理有限公司	-	1,338.01	1,338.01
中信银行股份有限公司	-	1,491,105.28	1,491,105.28
合计	-	1,492,451.94	1,492,451.94

注：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.4 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1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
中信银行	14,768,513.87	76,801.08	94,163,527.50	155,158.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.9.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 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 90,520,635.54 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
220211	22 国开 11	2023-07-05	101.60	700,000.00	71,120,901.37
210303	21 进出 03	2023-07-05	101.53	260,000.00	26,398,354.09
合计				960,000.00	97,519,255.46

6.4.10.3.2 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。

6.4.11 金融工具风险及管理

本基金为定期开放式的债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在合理控制风险的前提下，通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。

6.4.11.1 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，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.11.2 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。

6.4.11.3 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于约定开放日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。

6.4.11.3.1 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》且于基金开放期内按照《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综合持仓集中度指标、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公司的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内,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%。

于开放期内,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。

6.4.11.4 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。

6.4.11.4.1 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。

6.4.11.4.1.1 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	14,768,513.87	-	-	-	14,768,513.87
结算备付金	137,544.84	-	-	-	137,544.84
存出保证金	114,386.96	-	-	-	114,386.96
交易性金融资产	908,723,816.62	334,994,603.88	31,053,641.10	255,825,867.72	1,530,597,929.32
买入返售金融资产	39,905,065.81	-	-	-	39,905,065.81
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	239.66	239.66
资产总计	963,649,328.10	334,994,603.88	31,053,641.10	255,826,107.38	1,585,523,680.46
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	90,520,635.54	-	-	-	90,520,635.54
应付清算款	-	-	-	1,789.20	1,789.20
应付赎回款	-	-	-	5,358,024.78	5,358,024.78
应付管理人报酬	-	-	-	879,471.63	879,471.63
应付托管费	-	-	-	125,638.80	125,638.80
应付销售服务费	-	-	-	104,217.25	104,217.25
应交税费	-	-	-	46,800.47	46,800.47
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	600,220.87	600,220.87
负债总计	90,520,635.54	-	-	7,116,163.00	97,636,798.54

利率敏感度缺口	873,128,692.56	334,994,603.88	31,053,641.10	248,709,944.38	1,487,886,881.92
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	55,139,252.05	-	-	-	55,139,252.05
结算备付金	189,334.46	-	-	-	189,334.46
存出保证金	226,173.65	-	-	-	226,173.65
交易性金融资产	1,482,503,166.58	303,003,309.05	154,814,354.79	365,912,730.75	2,306,233,561.17
应收清算款	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	864.91	864.91
资产总计	1,538,057,926.74	303,003,309.05	154,814,354.79	365,913,595.66	2,361,789,186.24
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	-	-	-	1,195,287.29	1,195,287.29
应付管理人报酬	-	-	-	1,418,376.57	1,418,376.57
应付托管费	-	-	-	202,625.25	202,625.25
应付销售服务费	-	-	-	162,993.50	162,993.50
应交税费	-	-	-	85,413.78	85,413.78
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,131,195.51	1,131,195.51
负债总计	-	-	-	4,195,891.90	4,195,891.90
利率敏感度缺口	1,538,057,926.74	303,003,309.05	154,814,354.79	361,717,703.76	2,357,593,294.34

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.11.4.1.2 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	3,079,178.36	6,032,275.17
市场利率上升 25 个基点	-3,059,607.06	-5,940,967.61	

6.4.11.4.2 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。

6.4.11.4.3 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.11.4.3.1 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	255,825,867. 72	17.19	365,912,730.7 5	15.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	255,825,867. 72	17.19	365,912,730.7 5	15.52

6.4.11.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于 2023 年 06 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日持有的交易性权益类投资比例较低，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12 公允价值

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.12.2.1 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	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	363,677,354.62	376,412,522.53
第二层次	1,166,920,574.70	1,929,821,038.64
第三层次	-	-
合计	1,530,597,929.32	2,306,233,561.17

6.4.12.2.2 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。

6.4.12.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.12.4 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。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	255,825,867.72	16.14
	其中：股票	255,825,867.72	16.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,274,772,061.60	80.40
	其中：债券	1,274,772,061.60	80.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	39,905,065.81	2.52
	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	14,906,058.71	0.94
8	其他各项资产	114,626.62	0.01
9	合计	1,585,523,680.46	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	-	-
C	制造业	226,727,425.72	15.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,796,264.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,564,974.00	0.24
J	金融业	-	-
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	7,573,020.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,549,038.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	7,615,146.00	0.51
S	综合	-	-
	合计	255,825,867.72	17.19

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	601567	三星医疗	3,030,200	38,271,426.00	2.57
2	300733	西菱动力	2,299,920	34,705,792.80	2.33
3	000768	中航西飞	640,800	17,141,400.00	1.15
4	600398	海澜之家	2,248,800	15,471,744.00	1.04
5	603338	浙江鼎力	230,300	12,899,103.00	0.87
6	000999	华润三九	210,100	12,744,666.00	0.86
7	603239	浙江仙通	768,100	12,496,987.00	0.84
8	002444	巨星科技	559,000	12,230,920.00	0.82
9	002180	纳思达	318,400	10,905,200.00	0.73
10	002768	国恩股份	318,600	7,706,934.00	0.52
11	300413	芒果超媒	222,600	7,615,146.00	0.51
12	300938	信测标准	172,900	7,573,020.00	0.51
13	300143	盈康生命	665,700	7,549,038.00	0.51
14	300320	海达股份	935,200	7,322,616.00	0.49
15	688658	悦康药业	334,032	6,951,205.92	0.47
16	688636	智明达	112,513	6,188,215.00	0.42
17	603313	梦百合	608,200	6,100,246.00	0.41
18	603337	杰克股份	249,200	4,744,768.00	0.32
19	600375	汉马科技	613,600	4,651,088.00	0.31
20	600893	航发动力	104,300	4,407,718.00	0.30
21	300248	新开普	341,800	3,564,974.00	0.24
22	300026	红日药业	644,100	3,491,022.00	0.23
23	600418	江淮汽车	264,000	3,323,760.00	0.22
24	601007	金陵饭店	328,200	2,796,264.00	0.19
25	300858	科拓生物	126,600	2,047,122.00	0.14
26	603267	鸿远电子	30,800	2,011,240.00	0.14
27	600519	贵州茅台	300	507,300.00	0.03
28	300726	宏达电子	9,100	406,952.00	0.03

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	000069	华侨城 A	15,590,437.70	0.66
2	002180	纳思达	13,487,376.28	0.57
3	300413	芒果超媒	12,341,093.00	0.52
4	603507	振江股份	9,342,859.00	0.40
5	603173	福斯达	8,785,259.74	0.37
6	300347	泰格医药	8,261,060.94	0.35
7	603712	七一二	8,057,280.00	0.34

8	688636	智明达	6,950,480.99	0.29
9	600325	华发股份	6,911,950.93	0.29
10	688658	悦康药业	6,739,296.39	0.29
11	601222	林洋能源	6,150,196.00	0.26
12	600958	东方证券	5,662,518.00	0.24
13	600375	汉马科技	4,881,946.00	0.21
14	002171	楚江新材	4,716,785.00	0.20
15	600418	江淮汽车	4,361,260.32	0.18
16	002444	巨星科技	4,313,473.00	0.18
17	000768	中航西飞	4,185,446.00	0.18
18	002291	遥望科技	3,574,625.00	0.15
19	000538	云南白药	3,500,245.20	0.15
20	601007	金陵饭店	3,225,777.00	0.14

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300143	盈康生命	26,419,264.20	1.12
2	000776	广发证券	18,559,663.00	0.79
3	002291	遥望科技	16,065,669.00	0.68
4	601222	林洋能源	13,388,779.00	0.57
5	000069	华侨城 A	13,033,559.00	0.55
6	300413	芒果超媒	12,674,715.00	0.54
7	300035	中科电气	10,503,898.00	0.45
8	603173	福斯达	10,059,494.75	0.43
9	000538	云南白药	9,733,009.40	0.41
10	300613	富瀚微	9,713,026.75	0.41
11	603712	七一二	9,394,266.00	0.40
12	603507	振江股份	9,346,791.00	0.40
13	300494	盛天网络	8,047,695.00	0.34
14	600325	华发股份	7,775,185.00	0.33
15	300709	精研科技	7,725,559.52	0.33
16	300347	泰格医药	7,648,806.00	0.32
17	002034	旺能环境	7,262,915.00	0.31
18	300182	捷成股份	7,009,247.00	0.30
19	301369	联动科技	6,946,088.00	0.29
20	605368	蓝天燃气	6,306,403.00	0.27

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	148,416,892.67
卖出股票的收入（成交）总额	281,352,398.43

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	395,640,093.26	26.59
	其中：政策性金融债	162,711,640.83	10.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	618,132,526.58	41.54
6	中期票据	153,147,954.86	10.29
7	可转债（可交换债）	107,851,486.90	7.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,274,772,061.60	85.68

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	220211	22 国开 11	700,000	71,120,901.37	4.78
2	072210177	22 长城证 券 CP005	700,000	71,008,790.14	4.77
3	2228045	22 兴业银 行 04	500,000	51,124,142.47	3.44

4	2220080	22 厦门国际银行	500,000	50,926,041.10	3.42
5	012284199	22 张江集 SCP006	500,000	50,672,293.15	3.41

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

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

2022 年 9 月 9 日，兴业银行因债券承销业务严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕41 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。2022 年 9 月 28 日，兴业银行因理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹、未按规定开展理财业务内部审计等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕50 号）给予罚款 450 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.11.2 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	114,386.96

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	239.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,626.62

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	113056	重银转债	13,153,097.26	0.88
2	113042	上银转债	12,758,685.78	0.86
3	110053	苏银转债	11,314,454.79	0.76
4	127063	贵轮转债	9,013,176.44	0.61
5	111010	立昂转债	8,732,540.27	0.59
6	127071	天箭转债	7,921,632.33	0.53
7	113639	华正转债	3,795,255.62	0.26
8	127032	苏行转债	3,569,860.27	0.24
9	113623	凤 21 转债	3,394,623.29	0.23
10	113050	南银转债	3,377,536.44	0.23
11	113044	大秦转债	3,356,899.74	0.23
12	127056	中特转债	3,306,013.97	0.22
13	113052	兴业转债	3,051,392.05	0.21
14	123158	宙邦转债	2,776,655.89	0.19
15	123157	科蓝转债	2,489,210.96	0.17
16	113644	艾迪转债	1,594,550.28	0.11
17	113655	欧 22 转债	1,575,560.82	0.11
18	113060	浙 22 转债	1,572,413.75	0.11
19	113563	柳药转债	1,302,057.53	0.09
20	113602	景 20 转债	1,277,837.74	0.09
21	110080	东湖转债	1,260,153.42	0.08
22	127054	双箭转债	1,252,527.45	0.08
23	123149	通裕转债	1,237,920.55	0.08
24	118006	阿拉转债	1,210,156.99	0.08

25	118011	银微转债	1,182,873.70	0.08
26	128136	立讯转债	562,589.04	0.04
27	127060	湘佳转债	556,020.00	0.04
28	123162	东杰转债	445,341.14	0.03
29	128137	洁美转债	403,691.51	0.03
30	110064	建工转债	338,718.08	0.02
31	127042	嘉美转债	48,296.42	0.00
32	118028	会通转债	19,743.38	0.00

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安添利 6 个月债券 A	10,784	107,414.37	0.00	0.00%	1,158,356,552.01	100.00%
华安添利 6 个月债券 C	3,155	97,856.21	0.00	0.00%	308,736,344.72	100.00%
合计	13,939	105,250.94	0.00	0.00%	1,467,092,896.73	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安添利 6 个月债券 A	2.97	0.00%
	华安添利 6 个月债券 C	0.00	0.00%
	合计	2.97	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、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安添利 6 个月债券 A	华安添利 6 个月债券 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 5 日）基金份额总额	8,816,251,539.18	2,735,038,284.25
本报告期期初基金份额总额	1,891,350,263.53	479,364,496.96
本报告期基金总申购份额	360,181.85	229,630.87
减：本报告期基金总赎回份额	733,353,893.37	170,857,783.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,158,356,552.01	308,736,344.72

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，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	409,967,833.71	95.39%	378,973.51	95.36%	-
长城证券	1	19,801,457.39	4.61%	18,439.65	4.64%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	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：

2023 年 4 月完成租用托管在中信银行的第一创业深交所 393168 交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	132,305,368.35	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金 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部分基金可投资科创板股票的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-25
3	华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金 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
4	华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金 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

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、《华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日