

**华安品质甄选混合型证券投资基金**  
**2023 年第 3 季度报告**  
**2023 年 9 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

## §1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 华安品质甄选混合  |
| 基金主代码      | 013680  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 7 月 20 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 1,736,524,544.03 份  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>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。</p> <p>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</p> |

|                 |   |                         |
|-----------------|---|-------------------------|
|                 | <p>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。</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，综合考虑行业景气度、行业竞争格局、行业估值水平等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整股票资产在各行业之间的配置。</p> <p>在个股选择层面，本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置的行业内通过定量与定性相结合的分析方法筛选具有较好品质和长期投资价值的公司。</p> |                         |
| 业绩比较基准          | <p>中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×20%</p>  |                         |
| 风险收益特征          | <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |                         |
| 基金管理人           | <p>华安基金管理有限公司</p>   |                         |
| 基金托管人           | <p>上海浦东发展银行股份有限公司</p>   |                         |
| 下属分级基金的基金简称     | <p>华安品质甄选混合 A</p>   | <p>华安品质甄选混合 C</p>       |
| 下属分级基金的交易代码     | <p>013680</p>   | <p>013681</p>           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>1,363,611,603.28 份</p>   | <p>372,912,940.75 份</p> |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日) |                |
|----------------|---|----------------|
|                | 华安品质甄选混合 A                              | 华安品质甄选混合 C     |
| 1.本期已实现收益      | -88,528,469.70                          | -24,697,117.41 |
| 2.本期利润         | -127,058,477.10                         | -37,457,703.66 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0880                                 | -0.0905        |
| 4.期末基金资产净值     | 1,213,298,297.05                        | 330,217,053.94 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8898                                  | 0.8855         |

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、华安品质甄选混合 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -8.93%     | 0.97%         | -3.59%         | 0.71%                 | -5.34% | 0.26% |
| 过去六个月          | -10.35%    | 0.94%         | -6.82%         | 0.68%                 | -3.53% | 0.26% |
| 过去一年           | -5.91%     | 0.89%         | -0.28%         | 0.77%                 | -5.63% | 0.12% |
| 过去三年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -11.02%    | 0.83%         | -9.10%         | 0.76%                 | -1.92% | 0.07% |

##### 2、华安品质甄选混合 C：

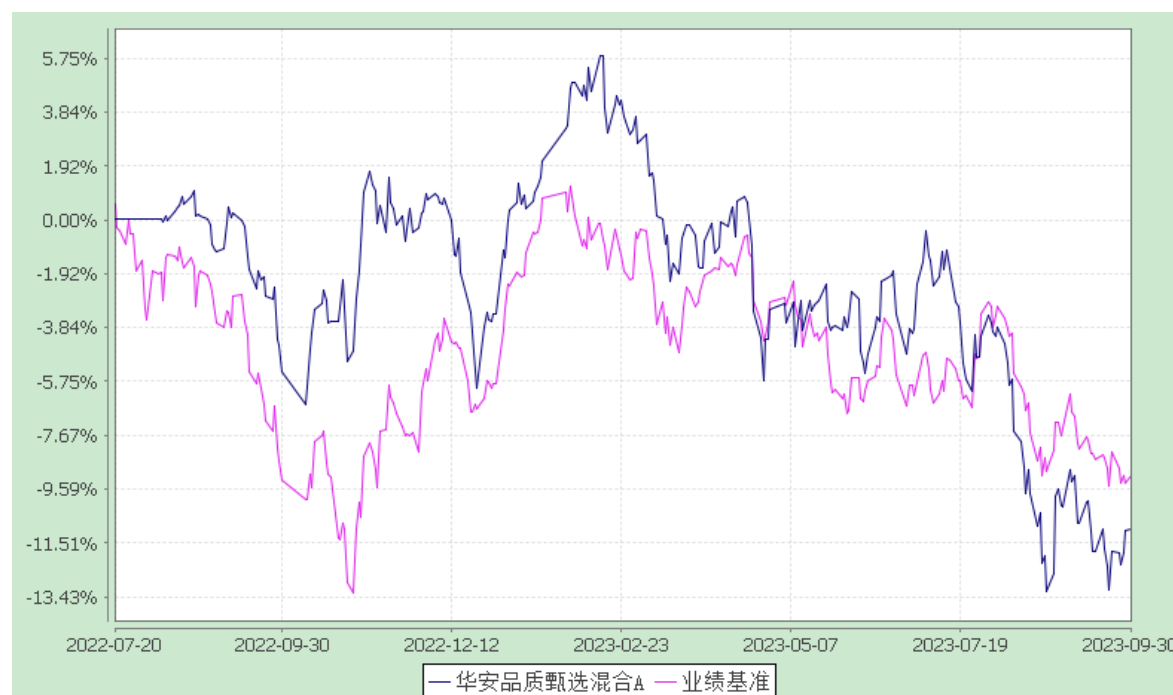
| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -9.03%     | 0.97%         | -3.59%         | 0.71%                 | -5.44% | 0.26% |

|            |         |       |        |       |        |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | -10.53% | 0.94% | -6.82% | 0.68% | -3.71% | 0.26% |
| 过去一年       | -6.29%  | 0.89% | -0.28% | 0.77% | -6.01% | 0.12% |
| 过去三年       | -       | -     | -      | -     | -      | -     |
| 过去五年       | -       | -     | -      | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | -11.45% | 0.83% | -9.10% | 0.76% | -2.35% | 0.07% |

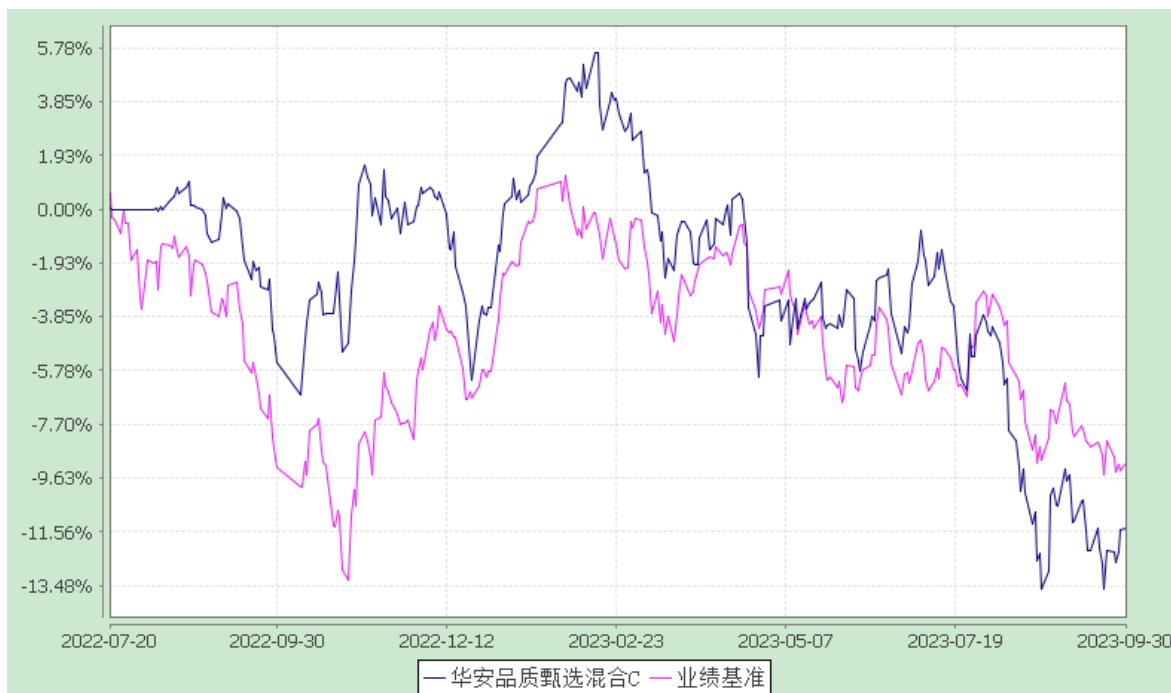
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安品质甄选混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2022 年 7 月 20 日至 2023 年 9 月 30 日)

#### 1. 华安品质甄选混合 A:



#### 2. 华安品质甄选混合 C:



## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------|-------------|------|--------|---|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 刘畅畅 | 本基金的基金经理 | 2022-07-21  | -    | 13 年   | 硕士研究生，13 年基金行业从业经验。2010 年 7 月应届毕业生加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2020 年 1 月起，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。2021 年 8 月起，同时担任华安安华灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安产业精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安品质甄选混合型证券投资基金的基金经理。 |

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

规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资

境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年三季度，国内经济仍然偏弱运行，随着政策陆续发力，市场信心有所改善。三季度，全球原油价格出现 20% 左右的上涨，美国通胀回落继续低于预期，美国国债利率继续上行。2023 年第三季度，上证指数下跌 2.86%，沪深 300 下跌 3.98%，创业板指下跌 9.53%。标普 500 下跌 3.65%，恒生指数下跌 5.85%。行业方面，三季度市场继续轮动，大幅分化，煤炭、非银、石油石化涨幅居前，传媒、计算机、电力设备大幅下跌。

报告期内，我们仍然维持相对均衡的行业配置，并对个股进行适当的调整。由于经济预期在低位，同时市场整体估值也处在相对低位，我们在报告期内维持比较高的股票仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 0.8898 元，本报告期份额净值增长率为 -8.93%；本基金 C 类份额净值为 0.8855 元，本报告期份额净值增长率为 -9.03%。同期业绩比较基准增长率为 -3.59%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们观点没有大的变化，仍然认为过度悲观的经济预期会有所纠正。一方面，地产开工端近两年的快速下滑不符合经济周期正常规律，另一方面消费、出行仍在缓慢恢复的过程中，此外，海内外库存都处在底部，去库存结束也将成为经济恢复向上的动力。科技领域，AI 领域的技术进步打开了其在各个产业和消费端应用的新空间，可能成为历史上一次重要的技术变革。

选择突出成长性的股票，寻找市场在这方面的预期差，始终是我们努力的重点方向。新能源发展带来的从能源产生到使用的巨大变革，使得这一产业链虽然短期面临一些需求或供给端的压力，但它仍会是未来拉动经济增长的主线。新能源车方面，除了在材料端的领先优势外，过去的一段时间内，我们也看到国内新能源整车、零部件企业的全球竞争力的不断加强，很多企业在技术上已经处在全球领先的水平。部分相关的制造环节存在比较高的技术壁垒，存在持续技术创新，或者部分制造业本身并没有获得超额的利润回报，这些因素会使利润率的调整相对有限。我们认为，横向对比其他行业，新能源的渗透率仍然不高，其体量增加对上下游的企业会形成不断增强的边际拉动。当前估值下，我们在这一领域会保持一定的配置水平。

同时，制造业中仍然诞生出了不少新的成长性机会，不停的有公司在打开另一个细分市场或者获得更多市场份额，我们也会继续寻找制造业中的相关细分机会。制造业的出口在过去几年一直是经济的持续亮点之一，我们看到中国的出口也在不断进行结构升级，从轻工业到重工业，从代工到自有品牌，这个结构升级的过程中，也呈现出一些投资机会。

随着技术的突破，数字经济、人工智能、人形机器人有可能是贯穿全年甚至更长时间的一条主线。我们也会择机增加相关机会的布局。

个股选择上，我们将恪守估值纪律，控制相关风险，继续寻找具备较好性价比的个股进行投资。

风险偏好方面，三季度市场风险偏好预计边际改善。

综上所述，我们将继续关注内需消费、现代服务、高科技、寡头制造等方向，选择风险收益

比高的投资标的构建投资组合，努力为持有人达成“承担较低风险获取中长期合意回报”的投资目标。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,404,917,084.36 | 90.80        |
|    | 其中：股票             | 1,404,917,084.36 | 90.80        |
| 2  | 固定收益投资            | 7,357,140.77     | 0.48         |
|    | 其中：债券             | 7,357,140.77     | 0.48         |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 134,714,961.55   | 8.71         |
| 7  | 其他各项资产            | 207,283.90       | 0.01         |
| 8  | 合计                | 1,547,196,470.58 | 100.00       |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币100,251,990.54元，占期末净值比例6.50%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | 27,438,321.00    | 1.78         |
| C  | 制造业              | 1,019,053,307.78 | 66.02        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,819,580.00    | 4.65         |
| E  | 建筑业              | 8,671.84         | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 11,195,134.78    | 0.73         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 102,668,713.42   | 6.65         |
| J  | 金融业              | 39,289,280.00    | 2.55         |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,542,568.00     | 0.10         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 9,370,158.04     | 0.61         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 22,258,173.50    | 1.44         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 21,185.46        | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,304,665,093.82 | 84.53        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 原材料      | 26,116,460.96  | 1.69         |
| 工业       | 2,127,708.68   | 0.14         |
| 非日常生活消费品 | 14,343,006.54  | 0.93         |
| 医疗保健     | 2,866,309.07   | 0.19         |
| 金融       | 22,684,685.35  | 1.47         |
| 公用事业     | 28,144,923.37  | 1.82         |
| 房地产      | 3,968,896.57   | 0.26         |
| 合计       | 100,251,990.54 | 6.50         |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 605589 | 圣泉集团 | 2,207,000 | 51,202,400.00 | 3.32         |
| 2  | 688208 | 道通科技 | 1,521,932 | 45,094,845.16 | 2.92         |
| 3  | 002965 | 祥鑫科技 | 943,770   | 38,543,566.80 | 2.50         |
| 4  | 300926 | 博俊科技 | 1,129,180 | 34,948,121.00 | 2.26         |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 774,000   | 34,783,560.00 | 2.25         |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 163,660   | 33,227,889.80 | 2.15         |
| 7  | 600580 | 卧龙电驱 | 2,746,900 | 33,045,207.00 | 2.14         |
| 8  | 600585 | 海螺水泥 | 889,900   | 23,164,097.00 | 1.50         |
| 8  | 00914  | 海螺水泥 | 425,500   | 8,140,915.13  | 0.53         |
| 9  | 002080 | 中材科技 | 1,516,400 | 31,177,184.00 | 2.02         |
| 10 | 601633 | 长城汽车 | 591,500   | 15,183,805.00 | 0.98         |
| 10 | 02333  | 长城汽车 | 1,673,500 | 14,343,006.54 | 0.93         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 7,357,140.77 | 0.48         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 7,357,140.77 | 0.48         |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |        |         |        |              |      |
|---|--------|---------|--------|--------------|------|
| 1 | 123222 | 博俊转债    | 21,324 | 3,354,266.95 | 0.22 |
| 2 | 113067 | 燃 23 转债 | 12,710 | 1,569,798.52 | 0.10 |
| 3 | 127091 | 科数转债    | 8,111  | 995,346.59   | 0.06 |
| 4 | 113671 | 武进转债    | 5,910  | 766,554.04   | 0.05 |
| 5 | 123216 | 科顺转债    | 5,584  | 658,399.04   | 0.04 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货合约进行交易，以对冲资产组合的系统性风险和流动性风险等。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲资产组合的系统性风险和流动性风险等。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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

**5.11.3其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 207,283.90 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 207,283.90 |

**5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)  | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------|--------------|
| 1  | 123174 | 精锻转债 | 2,774.80 | 0.00         |

**5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

| 项目             | 华安品质甄选混合A        | 华安品质甄选混合C      |
|----------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 1,548,923,101.56 | 475,021,311.06 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 15,042,528.97    | 13,786,829.86  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 200,354,027.25   | 115,895,200.17 |

|               |                  |                |
|---------------|------------------|----------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额 | -                | -              |
| 本报告期末基金份额总额   | 1,363,611,603.28 | 372,912,940.75 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 华安品质甄选混合A     | 华安品质甄选混合C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,225,976.86 | -         |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 0.00          | -         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,225,976.86 | -         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.59          | -         |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《华安品质甄选混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安品质甄选混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安品质甄选混合型证券投资基金托管协议》

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 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  
二〇二三年十月二十四日