

华安稳健回报混合型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十日

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 2021 年 8 月 25 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 2021 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	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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
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	51
10.9 其他重大事件	52
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	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安稳健回报混合型证券投资基金
基金简称	华安稳健回报
基金主代码	000072
交易代码	000072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 28 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	312,453,422.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金为混合型基金，在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例；当市场环境发生变化时，本基金将依托仓位弹性优势并借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，对大类资产配置比例进行及时调整。 此外，本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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	李申
	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778

注册地址	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	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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	24,920,325.93
本期利润	21,046,813.56
加权平均基金份额本期利润	0.0537
本期加权平均净值利润率	4.31%
本期基金份额净值增长率	4.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	221,394,592.40
期末可供分配基金份额利润	0.7086
期末基金资产净值	400,444,844.27
期末基金份额净值	1.2816
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.22%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.75%	0.17%	-1.27%	0.48%	3.02%	-0.31%
过去三个月	3.43%	0.14%	2.27%	0.59%	1.16%	-0.45%
过去六个月	4.57%	0.23%	0.24%	0.79%	4.33%	-0.56%
过去一年	10.57%	0.31%	14.97%	0.79%	-4.40%	-0.48%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.22%	0.29%	22.39%	0.75%	-3.17%	-0.46%

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

华安稳健回报混合型证券投资基金

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

(2019 年 6 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日)



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 2021 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 163 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,256.69 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		
郑可成	本基金的基金 经理、固定收 益部副总监	2013-05-1 4	-	19 年	硕士研究生，19 年证券基金从业经历。历任闽发证券有限责任公司担任研究员，福建儒林投资顾问有限公司任研究员，益民基金管理有限公司基金经理。2009 年 8 月加入华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月至 2019 年 2 月，同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 2 月起，同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安稳健回报混合型证券投资

				资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月起，同时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。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 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。2015 年 5 月至 2018 年 6 月，同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 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。2015 年 11 月至 2018 年 5 月，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月至 2018 年 1 月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 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。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 8 月，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 3 月，同时担任华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安添益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

舒灏	本基金的基金经理	2018-07-02	-	13 年	硕士研究生，13 年证券、基金行业从业经验。曾任海通证券股份有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 7 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 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。2018 年 11 月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起，同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 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。2020 年 9 月起，同时担任华安安利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安添禧一年持有期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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行

投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 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，国内经济宏观经济指标冲高回落，社融增速有所下降，经济复苏两极分化的趋势仍然较为明显。随着疫苗接种率的上升，国外发达国家新冠疫情总体呈现受控的格局，消费复苏从实物逐渐转进到服务，外需仍然较为强劲，中国的出口仍然保持了较高的增速。由于原材料价格上涨，中国制造业成本上升较为明显，制造业投资和居民消费仍保持较低增速。为此，央行保持了中性的货币政策，政策利率保持不变，贯彻了不急转弯的指导思想。同时海外主要发达国家也在货币层面维持了宽松的格局，低利率的环境得以维持。债券市场在春节后逐渐走上慢牛的格局，权益市场也演绎出了明显的结构化牛市行情。

报告期内，本基金适度提升了久期，仍保持较低的杠杆水平。资产配置中高等级债券为主，在长久期利率债上增加了配置。权益部分保持了中性仓位，新增配置新能源、军工、医药等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2816 元，本报告期份额净值增长率为 4.57%，同期业绩比较基准增长率为 0.24%。

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，新冠疫情的影响仍不可轻言结束，但对国民经济的冲击力度将逐渐淡化，经济活动的正常化可以预期。海外主要央行仍将保持对经济复苏的呵护态度，预期不会轻易退出宽松政策。在欧美经济逐渐恢复的过程中，中国出口的韧性仍将保持，但国内经济内生的动力仍然不足，居民和企业加杠的意愿和能力处于较低水平。因此，逆周期的宏观政策可以预期，财政政策潜力较大，货币政策仍将维持中性偏宽松的格局，不排除进一步下调政策利率的可能性。经济基本面有利于债券市场，预期利率中枢将保持下降的趋势，收益率曲线呈现平坦化。权益市场仍然存在结构性行情的机会，仍然可以保持积极的投资态度。

本基金将保持灵活的久期策略，维持中高等级信用债的配置，适时调节长久期利率债的仓位，防范信用风险。保持中等权益仓位，捕捉自下而上的结构化行情。积极参与网下新股申购。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

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：华安稳健回报混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,831,421.82	5,509,444.76
结算备付金		585,971.91	754,673.36
存出保证金		72,160.52	144,461.41
交易性金融资产	6.4.7.2	383,070,327.92	660,532,660.57
其中：股票投资		69,572,913.82	136,673,702.95
基金投资		-	-
债券投资		313,497,414.10	523,858,957.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,000,205.00	-
应收证券清算款		295,729.62	-
应收利息	6.4.7.5	6,643,577.31	7,768,396.85
应收股利		-	-
应收申购款		373,351.00	292,983.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		403,872,745.10	675,002,620.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		2,000,000.00	24,999,865.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		822,268.97	1,061,364.61
应付管理人报酬		228,550.07	380,441.32
应付托管费		65,300.03	108,697.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	191,132.96	638,721.55
应交税费		25,217.92	39,327.88
应付利息		390.68	9,222.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	95,040.20	180,784.31
负债合计		3,427,900.83	27,418,424.50
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	177,827,025.39	300,726,080.16
未分配利润	6.4.7.10	222,617,818.88	346,858,116.03
所有者权益合计		400,444,844.27	647,584,196.19
负债和所有者权益总计		403,872,745.10	675,002,620.69

注：报告截至日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2816 元，基金份额总额 312,453,422.39 份。

6.2 利润表

会计主体：华安稳健回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		24,288,145.88	17,200,320.44
1.利息收入		7,733,866.97	4,575,056.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	28,594.73	64,738.95
债券利息收入		7,623,631.18	4,337,496.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		81,641.06	172,820.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,062,581.62	14,585,818.78
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,413,169.52	11,840,417.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-38,580.53	2,561,692.78
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	6.4.7.14	687,992.63	183,708.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	-3,873,512.37	-2,329,949.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	365,209.66	369,394.95
减：二、费用		3,241,332.32	2,546,780.23
1. 管理人报酬	6.4.9.2	1,697,860.67	1,083,014.21
2. 托管费	6.4.9.2	485,103.03	309,432.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.17	462,531.85	596,378.15
5. 利息支出		450,752.15	423,223.09
其中：卖出回购金融资产支出		450,752.15	423,223.09
6.税金及附加		21,062.82	12,046.57
7. 其他费用	6.4.6.18	124,021.80	122,685.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,046,813.56	14,653,540.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,046,813.56	14,653,540.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳健回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	300,726,080.16	346,858,116.03	647,584,196.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,046,813.56	21,046,813.56
三、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）	-122,899,054.77	-145,287,110.71	-268,186,165.48
其中：1.基金申购款	45,872,668.42	54,130,255.26	100,002,923.68
2.基金赎回款	-168,771,723.19	-199,417,365.97	-368,189,089.16
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	177,827,025.39	222,617,818.88	400,444,844.27

金净值)			
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	145,817,992.44	137,065,116.05	282,883,108.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,653,540.21	14,653,540.21
三、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）	8,412,247.94	8,159,052.31	16,571,300.25
其中：1.基金申购款	100,744,569.18	100,591,156.42	201,335,725.60
2.基金赎回款	-92,332,321.24	-92,432,104.11	-184,764,425.35
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	154,230,240.38	159,877,708.57	314,107,948.95

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：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安稳健回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安保本混合型证券投资基金转型而成。华安保本混合型证券投资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[2013]218 号文《关于核准华安保本混合型证券投资基金募集的批复》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 2013 年 5 月 14 日生效，首次设立募集为 901,938,256.03 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安保本混合型证券投资基金基金合同》以及《华安保本混合型证券投资基金保本到期安排及转型为华安稳健回报混合型证券投资基金相关业务规则的公告》的约定，本基金自 2019 年 6 月 28 日起转型为非保本的混合型证券投资基金并更名为华安稳健回报混合型证券投资基金。

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股票（包括中小板、

创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、国债、金融债、中央银行票据、地方政府债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证券、次级债、城投债、中小企业私募债、债券回购、银行存款、权证、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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票的投资比例为基金资产的 0%-95%;债券的投资比例不低于基金资产的 5%;权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%;扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。

本基金整体业绩比较基准: 60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

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、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金 2021 年上半年度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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等

增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《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。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,831,421.82
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,831,421.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		62,042,741.70	69,572,913.82	7,530,172.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	135,623,261.89	133,062,414.10	-2,560,847.79
	银行间市场	180,590,312.30	180,435,000.00	-155,312.30
	合计	316,213,574.19	313,497,414.10	-2,716,160.09
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		378,256,315.89	383,070,327.92	4,814,012.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2021 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	10,000,205.00	-
合计	10,000,205.00	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	778.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	237.33
应收债券利息	6,640,545.12
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,986.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	29.25
合计	6,643,577.31

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	179,307.17
银行间市场应付交易费用	11,825.79
合计	191,132.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	820.65
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	34,712.18
合计	95,040.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	528,396,146.83	300,726,080.16
本期申购	80,601,590.84	45,872,668.42
本期赎回（以“-”号填列）	-296,544,315.28	-168,771,723.19
本期末	312,453,422.39	177,827,025.39

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	341,857,347.02	5,000,769.01	346,858,116.03
本期利润	24,920,325.93	-3,873,512.37	21,046,813.56
本期基金份额交易产生的变动数	-145,383,080.55	95,969.84	-145,287,110.71
其中：基金申购款	54,871,222.82	-740,967.56	54,130,255.26
基金赎回款	-200,254,303.37	836,937.40	-199,417,365.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,394,592.40	1,223,226.48	222,617,818.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,086.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	5,581.51
其他	926.37
合计	28,594.73

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	174,748,062.93
减：卖出股票成本总额	155,334,893.41
买卖股票差价收入	19,413,169.52

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	587,154,732.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	579,922,592.97
减：应收利息总额	7,270,720.00
买卖债券差价收入	-38,580.53

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	687,992.63
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	687,992.63

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-3,873,512.37
——股票投资	-3,532,980.31

——债券投资	-340,532.06
——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	-3,873,512.37

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	353,360.86
转换费收入	11,848.80
合计	365,209.66

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	453,764.35
银行间市场交易费用	8,767.50
合计	462,531.85

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行汇划费	11,772.25
账户维护费	17,430.00
其他费用	600.00
合计	124,021.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金管理人于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经基金管理人股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2021】669 号文核准，基金管理人股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	64,719,706.63	25.13%	30,467,626.73	8.46%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	92,162.30	9.40%	5,635,217.94	2.35%

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	58,979.02	24.78%	242.24	0.14%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	27,765.36	8.33%	27,765.36	8.33%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,697,860.67	1,083,014.21
其中：支付销售机构的客户维护费	245,113.06	424,377.47

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：

$$H=E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	485,103.03	309,432.68

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

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。

6.4.10.3 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	2,831,421.82	22,086.85	35,273,206.59	58,537.42

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.4 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	605005	合兴股份	网下申购	634.00	4,044.92
国泰君安	688070	纵横股份	网下申购	2,407.00	56,024.85
国泰君安	688677	海泰新光	网下申购	1,768.00	63,539.80
国泰君安	605089	味知香	网下申购	370.00	10,556.10
国泰君安	605180	华生科技	网下申购	384.00	8,593.92
国泰君安	688395	正弦电气	网下申购	1,627.00	26,080.40

国泰君安	605319	无锡振华	网下申购	764.00	8,572.08
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	2,172.00	79,346.96
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,345.00	51,753.68
国泰君安	113042	上银转债	老股东配售	1,240.00	124,000.00
国泰君安	113045	环旭转债	老股东配售	350.00	35,000.00
国泰君安	113050	南银转债	老股东配售	2,000.00	200,000.00

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股限售	36.48	133.69	1,174.00	42,827.52	156,952.06	-
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	新股限售	36.65	32.39	2,681.00	98,258.65	86,837.59	-
688607	康众医疗	2021-01-25	2021-08-02	新股限售	23.21	44.50	1,890.00	43,866.90	84,105.00	-
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	新股限售	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	-
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	7.15	16.50	3,919.00	28,020.85	64,663.50	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2022-01-05	新股限售	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股限售	9.39	14.00	2,464.00	23,136.96	34,496.00	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	新股限售	11.53	17.94	1,717.00	19,797.01	30,802.98	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
30095	恒辉	2021-0	2021-0	新股	11.72	27.08	340.00	3,984.	9,207.	-

2	安防	3-03	9-13	限售				80	20	
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	13.00	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,345.00	51,496.20	51,496.20	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	配债未上市	100.00	100.00	2,000.00	200,000.00	200,000.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额人民币 2,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。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。本基金通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制

以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、超短期融资券、政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、超短期融资券、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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%。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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	2,831,421.82	-	-	-	2,831,421.82
结算备付金	585,971.91	-	-	-	585,971.91
存出保证金	72,160.52	-	-	-	72,160.52
交易性金融资产	188,744,414.10	84,935,000.00	39,818,000.00	69,572,913.82	383,070,327.92
买入返售金融资产	10,000,205.00	-	-	-	10,000,205.00
应收证券清算款	-	-	-	295,729.62	295,729.62
应收利息	-	-	-	6,643,577.31	6,643,577.31
应收申购款	-	-	-	373,351.00	373,351.00
资产总计	202,234,173.35	84,935,000.00	39,818,000.00	76,885,571.75	403,872,745.10
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	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	822,268.97	822,268.97
应付管理人报酬	-	-	-	228,550.07	228,550.07
应付托管费	-	-	-	65,300.03	65,300.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	191,132.96	191,132.96
应交税费	-	-	-	25,217.92	25,217.92
应付利息	-	-	-	390.68	390.68
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	95,040.20	95,040.20
负债总计	2,000,000.00	-	-	1,427,900.83	3,427,900.83
利率敏感度缺口	200,234,173.35	84,935,000.00	39,818,000.00	75,457,670.92	400,444,844.27
上年度末 2020 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	5,509,444.76	-	-	-	5,509,444.76
结算备付金	754,673.36	-	-	-	754,673.36
存出保证金	144,461.41	-	-	-	144,461.41
交易性金融资产	409,741,457.62	75,064,500.00	39,053,000.00	136,673,702.95	660,532,660.57
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,768,396.85	7,768,396.85
应收申购款	-	-	-	292,983.74	292,983.74
资产总计	416,150,037.15	75,064,500.00	39,053,000.00	144,735,083.54	675,002,620.69
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	24,999,865.00	-	-	-	24,999,865.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,061,364.61	1,061,364.61
应付管理人报酬	-	-	-	380,441.32	380,441.32
应付托管费	-	-	-	108,697.50	108,697.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	638,721.55	638,721.55
应交税费	-	-	-	39,327.88	39,327.88
应付利息	-	-	-	9,222.33	9,222.33
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,784.31	180,784.31
负债总计	24,999,865.00	-	-	2,418,559.50	27,418,424.50
利率敏感度缺口	391,150,172.15	75,064,500.00	39,053,000.00	142,316,524.04	647,584,196.19

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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：人民币万元）

	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
市场利率下降 25 个基点	增加约 99	增加约 162
市场利率上升 25 个基点	减少约 98	减少约 160

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票的投资比例为基金资产的 0%-95%；债券的投资比例不低于基金资产的 5%；权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	69,572,913.82	17.37	136,673,702.95	21.11
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	69,572,913.82	17.37	136,673,702.95	21.11

6.4.13.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 495	增加约 1,181
	业绩比较基准下降 5%	减少约 495	减少约 1,181

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 25 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	69,572,913.82	17.23
	其中：股票	69,572,913.82	17.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	313,497,414.10	77.62
	其中：债券	313,497,414.10	77.62
	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	10,000,205.00	2.48
	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	3,417,393.73	0.85
8	其他各项资产	7,384,818.45	1.83
9	合计	403,872,745.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,026,752.00	1.01
C	制造业	27,791,605.03	6.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,960,503.10	2.49
E	建筑业	541,579.44	0.14
F	批发和零售业	1,378,124.68	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	5,158,675.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,694,252.40	0.92
J	金融业	10,029,943.14	2.50
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	256,074.06	0.06
M	科学研究和技术服务业	2,176,240.76	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	1,939,516.21	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	452,100.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	2,167,548.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	69,572,913.82	17.37

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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.29
2	603799	华友钴业	20,000	2,284,000.00	0.57
3	600893	航发动力	38,500	2,047,815.00	0.51
4	601398	工商银行	381,700	1,973,389.00	0.49
5	601088	中国神华	100,000	1,952,000.00	0.49
6	601288	农业银行	612,500	1,855,875.00	0.46
7	600674	川投能源	142,700	1,759,491.00	0.44
8	600760	中航沈飞	28,280	1,705,284.00	0.43
9	603259	药明康德	10,440	1,634,799.60	0.41
10	600377	宁沪高速	165,700	1,617,232.00	0.40
11	601006	大秦铁路	207,600	1,366,008.00	0.34
12	600360	华微电子	150,000	1,359,000.00	0.34
13	600498	烽火通信	59,900	1,115,937.00	0.28
14	601857	中国石油	200,000	1,058,000.00	0.26
15	601009	南京银行	100,000	1,052,000.00	0.26
16	600886	国投电力	109,400	1,051,334.00	0.26
17	600900	长江电力	50,300	1,038,192.00	0.26
18	600436	片仔癀	2,284	1,023,917.20	0.26
19	600028	中国石化	233,200	1,016,752.00	0.25
20	600033	福建高速	372,200	978,886.00	0.24
21	601229	上海银行	118,200	969,240.00	0.24
22	601998	中信银行	186,700	952,170.00	0.24
23	601988	中国银行	303,000	933,240.00	0.23
24	600426	华鲁恒升	30,094	931,409.30	0.23
25	601985	中国核电	183,500	928,510.00	0.23

26	601995	中金公司	14,951	919,486.50	0.23
27	600519	贵州茅台	400	822,680.00	0.21
28	603659	璞泰来	5,600	764,960.00	0.19
29	600104	上汽集团	34,500	757,965.00	0.19
30	601601	中国太保	25,100	727,147.00	0.18
31	600009	上海机场	14,100	678,633.00	0.17
32	600085	同仁堂	16,300	665,855.00	0.17
33	601200	上海环境	53,861	644,716.17	0.16
34	603444	吉比特	1,200	636,000.00	0.16
35	603986	兆易创新	3,276	615,560.40	0.15
36	688131	皓元医药	1,564	541,441.16	0.14
37	603707	健友股份	12,780	533,565.00	0.13
38	601668	中国建筑	114,100	530,565.00	0.13
39	601333	广深铁路	244,300	517,916.00	0.13
40	603136	天目湖	31,385	515,969.40	0.13
41	601137	博威合金	44,818	514,062.46	0.13
42	600037	歌华有线	51,400	493,954.00	0.12
43	600216	浙江医药	30,800	493,108.00	0.12
44	601928	凤凰传媒	68,700	490,518.00	0.12
45	601607	上海医药	22,900	483,877.00	0.12
46	600703	三安光电	14,900	477,545.00	0.12
47	600380	健康元	34,000	466,820.00	0.12
48	603516	淳中科技	21,560	459,228.00	0.11
49	600261	阳光照明	116,400	455,124.00	0.11
50	600763	通策医疗	1,100	452,100.00	0.11
51	603383	顶点软件	15,900	452,037.00	0.11
52	600536	中国软件	7,900	449,747.00	0.11
53	600373	中文传媒	45,200	445,672.00	0.11
54	600522	中天科技	44,400	444,000.00	0.11
55	603345	安井食品	1,725	438,184.50	0.11
56	600633	浙数文化	59,500	427,210.00	0.11
57	603103	横店影视	28,800	423,936.00	0.11
58	601012	隆基股份	4,760	422,878.40	0.11
59	600323	瀚蓝环境	19,400	422,726.00	0.11
60	603228	景旺电子	15,960	418,152.00	0.10
61	603160	汇顶科技	3,200	414,816.00	0.10
62	600372	中航电子	24,900	412,095.00	0.10
63	600845	宝信软件	8,060	410,254.00	0.10
64	601098	中南传媒	45,800	403,956.00	0.10
65	600977	中国电影	32,200	403,466.00	0.10
66	603019	中科曙光	14,480	399,792.80	0.10
67	600990	四创电子	9,800	389,746.00	0.10
68	601138	工业富联	30,700	380,987.00	0.10
69	600584	长电科技	10,100	380,568.00	0.10

70	601231	环旭电子	22,000	369,820.00	0.09
71	600570	恒生电子	3,900	363,675.00	0.09
72	603916	苏博特	17,542	362,066.88	0.09
73	600183	生益科技	15,100	353,491.00	0.09
74	600529	山东药玻	10,300	349,685.00	0.09
75	600438	通威股份	7,900	341,833.00	0.09
76	601336	新华保险	7,300	335,143.00	0.08
77	603236	移远通信	1,950	332,689.50	0.08
78	600588	用友网络	9,850	327,611.00	0.08
79	600309	万华化学	3,000	326,460.00	0.08
80	603658	安图生物	4,160	315,203.20	0.08
81	603588	高能环境	21,597	312,724.56	0.08
82	600276	恒瑞医药	4,584	311,574.48	0.08
83	688538	和辉光电	79,683	303,592.23	0.08
84	600486	扬农化工	2,600	290,602.00	0.07
85	603939	益丰药房	5,096	285,834.64	0.07
86	601100	恒立液压	3,300	283,536.00	0.07
87	603883	老百姓	5,380	283,418.40	0.07
88	603218	日月股份	10,400	281,632.00	0.07
89	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.07
90	603233	大参林	5,160	263,727.60	0.07
91	600031	三一重工	8,900	258,723.00	0.06
92	601888	中国中免	800	240,080.00	0.06
93	603338	浙江鼎力	3,060	179,591.40	0.04
94	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.04
95	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04
96	600918	中泰证券	14,487	156,749.34	0.04
97	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.04
98	688682	霍莱沃	946	121,277.20	0.03
99	601456	国联证券	7,843	120,782.20	0.03
100	688533	上声电子	3,493	91,865.90	0.02
101	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.02
102	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.02
103	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.02
104	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.02
105	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.02
106	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
107	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.01
108	688087	英科再生	2,345	51,496.20	0.01
109	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
110	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
111	605089	味知香	370	32,197.40	0.01
112	688981	中芯国际	500	30,910.00	0.01
113	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01

114	605099	共创草坪	624	26,445.12	0.01
115	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.01
116	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
117	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
118	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
119	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
120	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
121	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
122	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
123	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
124	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
125	002916	深南电路	80	8,890.40	0.00
126	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
127	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
128	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
129	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
130	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
131	002602	世纪华通	40	256.80	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	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.53
2	601288	农业银行	2,500,361.00	0.39
3	601398	工商银行	2,497,656.00	0.39
4	601328	交通银行	2,182,341.00	0.34
5	600050	中国联通	2,035,317.00	0.31
6	601088	中国神华	2,032,217.88	0.31
7	600674	川投能源	1,811,035.00	0.28
8	600377	宁沪高速	1,807,609.73	0.28
9	600548	深高速	1,779,691.00	0.27
10	601006	大秦铁路	1,662,773.00	0.26
11	600760	中航沈飞	1,516,130.00	0.23
12	600360	华微电子	1,337,755.00	0.21
13	600033	福建高速	1,250,588.50	0.19
14	600900	长江电力	1,250,514.00	0.19
15	601988	中国银行	1,250,058.00	0.19
16	601229	上海银行	1,249,585.00	0.19
17	600426	华鲁恒升	1,249,410.72	0.19

18	601601	中国太保	1,249,116.00	0.19
19	601985	中国核电	1,248,838.00	0.19
20	601998	中信银行	1,248,812.00	0.19

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	300059	东方财富	8,117,751.00	1.25
2	000568	泸州老窖	4,469,787.00	0.69
3	300760	迈瑞医疗	4,457,137.44	0.69
4	300124	汇川技术	4,090,187.00	0.63
5	300750	宁德时代	3,992,443.00	0.62
6	300015	爱尔眼科	3,592,158.50	0.55
7	601328	交通银行	2,563,650.00	0.40
8	600050	中国联通	2,537,503.00	0.39
9	600563	法拉电子	2,424,325.00	0.37
10	002142	宁波银行	2,373,716.00	0.37
11	600031	三一重工	2,188,197.00	0.34
12	600548	深高速	2,108,103.00	0.33
13	601100	恒立液压	2,011,636.32	0.31
14	300122	智飞生物	1,887,461.00	0.29
15	600905	三峡能源	1,797,364.80	0.28
16	600438	通威股份	1,778,790.00	0.27
17	601012	隆基股份	1,770,910.00	0.27
18	300529	健帆生物	1,748,250.70	0.27
19	600763	通策医疗	1,703,016.00	0.26
20	600309	万华化学	1,621,368.65	0.25

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	91,767,084.59
卖出股票的收入（成交）总额	174,748,062.93

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	19,624,000.00	4.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,640,000.00	20.14
	其中：政策性金融债	40,382,000.00	10.08
4	企业债券	125,539,000.00	31.35
5	企业短期融资券	30,108,000.00	7.52
6	中期票据	50,063,000.00	12.50
7	可转债（可交换债）	7,523,414.10	1.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	313,497,414.10	78.29

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	112801	18 龙控 05	350,000	35,203,000.00	8.79
2	1820061	18 渤海银行 02	300,000	30,279,000.00	7.56
3	012003762	20 广物控股 SCP008	300,000	30,108,000.00	7.52
4	120306	12 进出 06	200,000	20,276,000.00	5.06
5	101682005	16 恒信租赁 MTN004	200,000	20,164,000.00	5.04

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股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.12020 年 10 月 26 日，工商银行因违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务，被国家外汇管理局北京外汇管理部（京汇罚〔2020〕31 号）给予罚款 100 万元人民币的行政处罚，并要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 11 月 6 日，工商银行因违

反洗钱法被中国人民银行衡水市中心支行（衡银罚字[2020]第 1 号）给予罚款 21 万元的行政处罚。

2020 年 12 月 25 日，工商银行因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2020）71 号）给予罚款 5470 万元的行政处罚。

2020 年 7 月 13 日，农业银行因向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2020）36 号）给予没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元的行政处罚。2020 年 12 月 7 日，农业银行因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费），被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2020）66 号）给予没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元的行政处罚。2021 年 1 月 19 日，农业银行因发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）1 号）给予罚款 420 万元的行政处罚。

2021 年 5 月 17 日，渤海银行因地方政府购买服务项目贷款不合规、违规向资本金不足的房地产项目发放贷款等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字（2021）13 号）给予罚款 9720 万元的行政处罚。

本基金投资工商银行、农业银行、18 渤海银行 02 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。

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

7.12.3 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	72,160.52
2	应收证券清算款	295,729.62
3	应收股利	-
4	应收利息	6,643,577.31
5	应收申购款	373,351.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,384,818.45
---	----	--------------

7.12.4 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	128081	海亮转债	1,023,390.00	0.26
2	123049	维尔转债	701,090.00	0.18
3	113027	华钰转债	684,670.00	0.17
4	113014	林洋转债	542,000.00	0.14
5	128022	众信转债	530,876.00	0.13
6	113025	明泰转债	528,552.60	0.13
7	113037	紫银转债	515,850.00	0.13
8	128116	瑞达转债	506,500.00	0.13
9	128117	道恩转债	405,440.00	0.10
10	128108	蓝帆转债	360,750.00	0.09
11	128121	宏川转债	323,820.00	0.08
12	128090	汽模转 2	219,680.00	0.05
13	110060	天路转债	216,760.00	0.05
14	123045	雷迪转债	114,350.00	0.03
15	113593	沪工转债	109,700.00	0.03
16	113602	景 20 转债	61,760.40	0.02
17	110061	川投转债	61,565.30	0.02
18	110048	福能转债	34,730.80	0.01
19	113614	健 20 转债	19,822.40	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	1.29	新股流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
16,276	19,197.19	187,662,449.90	60.06%	124,790,972.49	39.94%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	16,021.39	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 6 月 28 日）基金份额总额	428,919,854.63
本报告期期初基金份额总额	528,396,146.83
本报告期基金总申购份额	80,601,590.84
减：本报告期基金总赎回份额	296,544,315.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	312,453,422.39

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：

2021 年 2 月 6 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，杨牧云先

生新任本基金管理人的督察长。

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

本报告期内无管理人、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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

粤开证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	93,075,122.11	36.14%	86,680.98	36.41%	-
国泰君安证券	1	64,719,706.63	25.13%	58,979.02	24.78%	-
上海证券	3	45,128,585.37	17.52%	42,028.20	17.66%	-
天风证券	2	13,780,658.95	5.35%	12,558.45	5.28%	-
申万宏源	3	11,032,784.10	4.28%	10,054.36	4.22%	-
华泰证券	1	8,586,776.68	3.33%	7,997.07	3.36%	-
招商证券	3	8,049,838.56	3.13%	7,496.73	3.15%	-
华安证券	1	3,759,053.54	1.46%	3,500.86	1.47%	-
国盛证券	1	3,631,668.53	1.41%	3,382.37	1.42%	-
长江证券	2	3,127,740.08	1.21%	2,913.06	1.22%	-
银河证券	1	2,571,334.92	1.00%	2,394.68	1.01%	-
兴业证券	1	62,435.78	0.02%	58.17	0.02%	-

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：

2021 年 3 月完成租用托管在建设银行的中信建投证券上交所 49968 交易单元

2021 年 6 月完成托管在建设银行的申万宏源深交所 278300 交易单元退租

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
万联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	15,476.67	1.58%	-	-	-	-
中金公司	124,000.00	12.64%	99,000.00 0.00	22.80%	-	-
国泰君安证券	92,162.30	9.40%	-	-	-	-

上海证券	-	-	40,000,000.00	9.21%	-	-
天风证券	123,552.58	12.60%	20,000,000.00	4.61%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	8,000,000.00	1.84%	-	-
招商证券	67,573.10	6.89%	31,700,000.00	7.30%	-	-
华安证券	279,878.30	28.54%	54,000,000.00	12.44%	-	-
国盛证券	-	-	98,000,000.00	22.57%	-	-
长江证券	200,000.00	20.39%	16,000,000.00	3.68%	-	-
银河证券	-	-	43,300,000.00	9.97%	-	-
兴业证券	78,141.00	7.97%	24,200,000.00	5.57%	-	-

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	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(合兴股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-12
2	华安稳健回报混合型证券投资基金 2020 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	2021-01-21
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(上银转债)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-01-27
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(纵横股份)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-03
5	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-06
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(海泰新光)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-02-19

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（环旭转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-06
8	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-09
9	关于旗下部分基金参加盈米基金费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-03-24
10	华安稳健回报混合型证券投资基金 2020 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	2021-03-30
11	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（味知香）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-20
12	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（华生科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-21
13	华安稳健回报混合型证券投资基金 2021 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	2021-04-21
14	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（正弦电气）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-04-22
15	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（无锡振华）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-05-31
16	关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-07
17	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（南银转债）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-17
18	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（百克生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-18
19	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2021-06-28

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210201-20210329	84,683,567.30	0.00	84,683,567.30	0.00	0.00%
	2	20210201-20210526	84,127,676.14	0.00	23,900,000.00	60,227,676.14	19.28%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安保本混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安保本混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安保本混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、《华安稳健回报混合型证券投资基金基金合同》
- 6、《华安稳健回报混合型证券投资基金招募说明书》
- 7、《华安稳健回报混合型证券投资基金托管协议》
- 8、中国证监会批准华安稳健回报混合型证券投资基金设立的文件；
- 9、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；
- 10、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 11、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 12、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

二〇二一年八月三十日