

# 华安精致生活混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	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	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
<b>8 基金份额持有人信息</b>	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4	基金投资策略的改变 .....	57
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	58
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.9	其他重大事件 .....	60
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1	备查文件目录 .....	61
12.2	存放地点 .....	61
12.3	查阅方式 .....	61

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安精致生活混合型证券投资基金	
基金简称	华安精致生活混合	
基金主代码	011128	
交易代码	011128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 9 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,310,317,041.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
下属分级基金的交易代码	011128	011129
报告期末下属分级基金的份额总额	2,408,703,520.27 份	901,613,521.57 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	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%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨牧云	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66596688

负责人	电子邮箱	service@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
本期已实现收益	8,646,710.84	4,412,548.81
本期利润	-64,454,986.00	25,193,799.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0300	0.0327
本期加权平均净值利润率	-2.40%	2.65%
本期基金份额净值增长率	-3.16%	-3.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C

期末可供分配利润	789,414,696.04	286,168,817.80
期末可供分配基金份额利润	0.3277	0.3174
期末基金资产净值	3,198,118,216.31	1,187,782,339.37
期末基金份额净值	1.3277	1.3174
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b>	
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
基金份额累计净值增长率	32.77%	31.74%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安精致生活混合 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	7.93%	1.01%	6.24%	0.84%	1.69%	0.17%
过去三个月	7.72%	1.40%	4.25%	1.12%	3.47%	0.28%
过去六个月	-3.16%	1.44%	-7.22%	1.18%	4.06%	0.26%
过去一年	27.54%	1.58%	-11.07%	0.98%	38.61%	0.60%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	32.77%	1.39%	-8.32%	0.94%	41.09%	0.45%

华安精致生活混合 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	7.88%	1.01%	6.24%	0.84%	1.64%	0.17%
过去三个月	7.56%	1.40%	4.25%	1.12%	3.31%	0.28%
过去六个月	-3.44%	1.44%	-7.22%	1.18%	3.78%	0.26%
过去一年	26.78%	1.58%	-11.07%	0.98%	37.85%	0.60%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	31.74%	1.39%	-8.32%	0.94%	40.06%	0.45%

### 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

华安精致生活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

(2021 年 3 月 9 日至 2022 年 6 月 30 日)

华安精致生活混合 A



华安精致生活混合 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 2022 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 206 只证券投资基金，管理资产规模达到 5,985.16 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		
王斌	本基金的基金经理	2021-03-09	-	10 年	硕士研究生，10 年基金行业从业经验。2011 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。2018 年 10 月起，担任华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2022 年 1 月，同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安精致生活混合型证券投资基金、华安聚嘉精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月起，同时担任华安汇嘉精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 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 12 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

今年上半年，国内股票市场波动较大，国内市场先跌后涨。上半年，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，创业板综下跌 15.91%。整体上半年货币政策相对比较宽松，在股市估值下探到历史较低位置后，市场在二季度后半段经历了一轮较快速的反弹。

行业方面，上半年煤炭、交运、美容护理等行业表现较好，电子、计算机、传媒等行业表现较差。

2022 年上半年，本基金主要抓住了化工、汽车、电力设备、地产等行业的机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.3277 元，本报告期份额净值增长率为-3.16%；本基金 C 类份额净值为 1.3174 元，本报告期份额净值增长率为-3.44%。同期业绩比较基准增长率为-7.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好未来市场的结构性机会。

近几年，能源问题是全球关注的焦点。在投资上，能源也是贯穿始终的主线之一。

在传统能源上，我们看到了因为过去几年在这些行业上的资本支出不足导致的供给增速放缓。在需求端，我们也看到了新能源的建设对传统能源的需求拉动。供给和需求的增速不匹配导致了商品价格在一个新的高度寻找平衡。

另一方面，我们也看到了大家拥抱新能源的决心。这个决心不仅仅来自于大家对未来新能源愿景的美好渴望，也来自于大家为了摆脱传统能源的焦虑。这个情况在欧洲区域表现的尤为明显。在经历了较高电价的 2021 年冬天后，欧洲区域的居民对能源安全尤为重视。这直接拉动了光伏、户用储能、微型逆变器的需求。而这些产品的产业链主要来自国内企业，这也间接拉动了国内这类企业的景气。

相信未来一段时间，上述传统和新能源的投资机会会相互交织，我们也会在这些领域继续发掘机会。

从国内的角度来看，目前较宽松的货币环境似乎使一些行业也在发生变化。地产销售及下游相关的产业链也是我们未来的研究方向之一。

最后，作为基金经理，我会秉着勤勉尽责的原则，为投资者带来更好的回报。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安精致生活混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	495,391,875.15	584,002,150.70
结算备付金		3,228,709.27	7,542,009.68
存出保证金		982,599.71	1,090,430.19
交易性金融资产	6.4.7.2	3,897,364,464.51	3,227,634,961.63
其中：股票投资		3,897,364,464.51	3,227,634,961.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		16,890,423.24	15,058,659.13
应收股利		12,502,664.58	-
应收申购款		5,689,765.41	2,433,896.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	57,608.48
<b>资产总计</b>		<b>4,432,050,501.87</b>	<b>3,837,819,716.34</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		18,681,320.14	3,297,251.54
应付赎回款		14,583,153.96	14,636,233.40
应付管理人报酬		5,169,862.99	4,901,954.47
应付托管费		861,643.81	816,992.43
应付销售服务费		585,623.81	445,309.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,268,341.48	16,046,519.46
负债合计		46,149,946.19	40,144,260.51
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	3,310,317,041.84	2,773,223,875.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,075,583,513.84	1,024,451,580.40
净资产合计		4,385,900,555.68	3,797,675,455.83
负债和净资产总计		4,432,050,501.87	3,837,819,716.34

注：（1）报告截至日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,310,317,041.84 份，其中 A 类基金份额净值 1.3277 元，基金份额总额 2,408,703,520.27 份；C 类基金份额净值 1.3174 元，基金份额总额 901,613,521.57 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期/年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基 金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-4,762,547.08</b>	<b>322,071,014.41</b>
1.利息收入		1,025,423.71	17,646,038.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,025,423.71	6,691,283.58
债券利息收入		-	3,710,465.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,244,289.63
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,764,226.29	80,593,198.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,516,139.14	59,612,414.08
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	412,217.16	1,478,750.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	42,835,869.99	19,502,034.68
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-52,320,446.31	222,615,707.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	768,249.23	1,216,069.63
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>34,498,639.58</b>	<b>47,920,014.24</b>
1. 管理人报酬		26,989,945.27	32,455,540.21
2. 托管费		4,498,324.23	5,409,256.69
3. 销售服务费		2,820,561.96	1,066,504.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		4.74	1.83
8. 其他费用	6.4.7.18	189,803.38	8,988,711.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-39,261,186.66</b>	<b>274,151,000.17</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-39,261,186.66</b>	<b>274,151,000.17</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-39,261,186.66</b>	<b>274,151,000.17</b>

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期/年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期/年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	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）	2,773,223,875.43	-	1,024,451,580.40	3,797,675,455.83
二、本期期初净资产（基金净值）	2,773,223,875.43	-	1,024,451,580.40	3,797,675,455.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	537,093,166.41	-	51,131,933.44	588,225,099.85
（一）、综合收益总额	-	-	-39,261,186.66	-39,261,186.66
（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）	537,093,166.41	-	90,393,120.10	627,486,286.51
其中：1.基金申购款	1,482,178,083.54	-	326,502,991.61	1,808,681,075.15
2.基金赎回款	-945,084,917.13	-	-236,109,871.51	-1,181,194,788.64
（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）	3,310,317,041.84	-	1,075,583,513.84	4,385,900,555.68

项目	上年度可比期间			
	2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	实收基金
一、上期期末净资产（基金净值）	6,996,143,384.72	-	-	6,996,143,384.72
二、本期期初净资产（基金净值）	6,996,143,384.72	-	-	6,996,143,384.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-585,831,952.68	-	261,969,070.73	-323,862,881.95
（一）、综合收益	-	-	274,151,000.17	274,151,000.17

总额				7
(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)	-585,831,952.68	-	-12,181,929.44	-598,013,882.12
其中: 1.基金申购款	13,620,837.34	-	264,026.27	13,884,863.61
2.基金赎回款	-599,452,790.02	-	-12,445,955.71	-611,898,745.73
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	6,410,311,432.04	-	261,969,070.73	6,672,280,502.77

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

华安精致生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]3467号《关于准予华安精致生活混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,992,604,677.94 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0153 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,996,143,384.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,538,706.78 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华安精致生活混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购费/申购费用，但不

从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分设置代码。由于基金费用不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式由为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票(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、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、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、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%；投资精致生活主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 x65%+中证港股通综合指数收益率 x15%+中债综合全价指数收益率 x20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2022 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，

但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.4 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：(a) 金融工具 根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 584,002,150.70 元、7,542,009.68 元、1,090,430.19 元、57,608.48 元、15,058,659.13 元和 2,433,896.53 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 584,053,431.55 元、7,547,554.13 元、1,091,213.37 元、0.00 元、15,058,659.13 元和 2,433,896.53 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,227,634,961.63 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 3,227,634,961.63 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,297,251.54 元、14,636,233.40 元、

4,901,954.47 元、816,992.43 元、445,309.21 元、15,812,495.49 元和 6,023.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,297,251.54 元、14,636,233.40 元、4,901,954.47 元、816,992.43 元、445,309.21 元、15,812,495.49 元和 6,023.97 元。(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债

以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	495,391,875.15
等于：本金	495,334,580.61
加：应计利息	57,294.54
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	495,391,875.15

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,665,456,829.93	-	3,897,364,464.51	231,907,634.58
贵金属投资-金交所 黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	-	-	-	-
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,665,456,829.93	-	3,897,364,464.51	231,907,634.58

### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

### 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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,448.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,052,838.10

其中：交易所市场	6,052,838.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	159,507.37
预提审计费	54,547.97
合计	6,268,341.48

#### 6.4.7.7 实收基金

华安精致生活混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,120,008,646.22	2,120,008,646.22
本期申购	772,628,062.10	772,628,062.10
本期赎回（以“-”号填列）	-483,933,188.05	-483,933,188.05
本期末	2,408,703,520.27	2,408,703,520.27

华安精致生活混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	653,215,229.21	653,215,229.21
本期申购	709,550,021.44	709,550,021.44
本期赎回（以“-”号填列）	-461,151,729.08	-461,151,729.08
本期末	901,613,521.57	901,613,521.57

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安精致生活混合 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	809,755,556.59	-23,295,092.77	786,460,463.82

本期利润	8,646,710.84	-73,101,696.84	-64,454,986.00
本期基金份额交易产生的变动数	105,432,960.54	-38,023,742.32	67,409,218.22
其中：基金申购款	287,467,692.51	-97,438,348.79	190,029,343.72
基金赎回款	-182,034,731.97	59,414,606.47	-122,620,125.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	923,835,227.97	-134,420,531.93	789,414,696.04

## 华安精致生活混合 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	244,947,555.34	-6,956,438.76	237,991,116.58
本期利润	4,412,548.81	20,781,250.53	25,193,799.34
本期基金份额交易产生的变动数	86,808,956.94	-63,825,055.06	22,983,901.88
其中：基金申购款	254,437,951.31	-117,964,303.42	136,473,647.89
基金赎回款	-167,628,994.37	54,139,248.36	-113,489,746.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	336,169,061.09	-50,000,243.29	286,168,817.80

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	942,861.15
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	73,060.29
其他	9,502.27
合计	1,025,423.71

## 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,516,139.14
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	2,516,139.14

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	3,012,805,708.27
减：卖出股票成本总额	3,000,091,037.11
减：交易费用	10,198,532.02
买卖股票差价收入	2,516,139.14

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,313.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	410,903.74
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	412,217.16

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,995,260.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,583,000.00
减：应计利息总额	1,352.82
减：交易费用	3.64
买卖债券差价收入	410,903.74

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	42,835,869.99
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	42,835,869.99

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-52,320,446.31
——股票投资	-52,320,446.31
——债券投资	-
——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	-52,320,446.31

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期

	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	689,619.54
转换费收入	78,629.69
合计	768,249.23

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	31,114.21
证券组合费	26,033.83
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	189,803.38

#### 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 2022 年 3 月 15 日发布的公告，经基金管理人股东会第七十三次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可【2022】469 号文核准，基金管理人股东上海上国投资产管理有限公司将其持有的本公司 15% 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(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售

	机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,343,403,365.74	49.70%	4,964,713,116.95	75.28%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同生效日） 至2021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	3,995,260.20	52.72%	0.00	0.00%

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

国泰君安证券股份有 限公司	2,966,175.10	49.00%	2,966,175.10	49.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同生效日）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	4,334,420.69	74.18%	2,774,013.64	64.77%

#### 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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,989,945.27	32,455,540.21
其中：支付销售机构的客户维护费	9,304,210.66	14,885,507.60

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同 生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,498,324.23	5,409,256.69

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.3 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 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		
	华安精致生活混合A	华安精致生活混合C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	247,177.14	247,177.14
华安基金管理有限公司	-	1,163,906.59	1,163,906.59
中国银行股份有限公司	-	258,211.11	258,211.11
合计	-	1,669,294.84	1,669,294.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安精致生活混合A	华安精致生活混合C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	593,440.89	593,440.89
华安基金管理有限公司	-	11,423.64	11,423.64
中国银行股份有限公司	-	65,486.94	65,486.94
合计	-	670,351.47	670,351.47

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年3月9日（基金合同生效日） 至2021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
中国银行	495,391,875.15	942,861.15	2,762,442,383.66	4,006,668.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759.00	562,375.50
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775.00	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813.00	135,783.09
上年度可比期间 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）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	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	301009	可靠股份	网下申购	8,007.00	100,407.78
国泰君安	688276	百克生物	网下申购	3,486.00	127,349.68
国泰君安	688087	英科再生	网下申购	2,469.00	54,490.34

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688306	均普智能	2022-03-15	1-6 个月(含)	新股限售	5.08	5.19	47,094.00	239,237.52	244,417.86	-

301219	腾远钴业	2022-03-10	1-6个月(含)	新股限售	173.98	87.82	578.00	55,847.58	50,759.96	-
301200	大族数控	2022-02-18	1-6个月(含)	新股限售	76.56	51.92	857.00	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股限售	109.30	45.69	945.00	68,859.00	43,177.05	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	1-6个月(含)	新股限售	56.88	56.42	569.00	32,364.72	32,102.98	-
301201	诚达药业	2022-01-12	1-6个月(含)	新股限售	72.69	71.54	353.00	25,659.57	25,253.62	-
301263	泰恩康	2022-03-22	1-6个月(含)	新股限售	19.93	31.38	682.00	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股限售	50.31	70.37	301.00	15,143.31	21,181.37	-
300834	星辉环材	2022-01-06	1-6个月(含)	新股限售	55.57	30.03	635.00	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	8.05	10.08	1,831.00	14,739.55	18,456.48	-
301123	奕东电子	2022-01-14	1-6个月(含)	新股限售	37.23	25.39	656.00	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	1-6个月(含)	新股限售	42.50	32.02	507.00	16,575.00	16,234.14	-
301235	华康医疗	2022-01-21	1-6个月(含)	新股限售	39.30	37.93	418.00	16,427.40	15,854.74	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	1-6个月(含)	新股限售	46.80	54.44	262.00	12,261.60	14,263.28	-
301130	西点药业	2022-02-16	1-6个月(含)	新股限售	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
301228	实朴检测	2022-01-21	1-6个月	新股限售	20.08	20.34	373.00	7,489.84	7,586.82	-

			(含)							
--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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。

##### 6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

##### 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。

#### 6.4.13.3 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。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。于 2022 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 4,396,055,363.48 元,超过经确认的当日净赎回金额。

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 2022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	495,391,875.15	-	-	-	495,391,875.15
结算备付金	3,228,709.27	-	-	-	3,228,709.27
存出保证金	982,599.71	-	-	-	982,599.71
交易性金融资产	-	-	-	3,897,364,464.51	3,897,364,464.51
应收清算款	-	-	-	16,890,423.24	16,890,423.24
应收股利	-	-	-	12,502,664.58	12,502,664.58
应收申购款	-	-	-	5,689,765.41	5,689,765.41
资产总计	499,603,184.13	-	-	3,932,447,317.74	4,432,050,501.87
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	-	-	-	18,681,320.14	18,681,320.14
应付赎回款	-	-	-	14,583,153.96	14,583,153.96
应付管理人报酬	-	-	-	5,169,862.99	5,169,862.99

应付托管费	-	-	-	861,643.81	861,643.81
应付销售服务费	-	-	-	585,623.81	585,623.81
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,268,341.48	6,268,341.48
负债总计	-	-	-	46,149,946.19	46,149,946.19
利率敏感度缺口	499,603,184.13	-	-	3,886,297,371.55	4,385,900,555.68
<b>上年度末</b>					
<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	584,002,150.70	-	-	-	584,002,150.70
结算备付金	7,542,009.68	-	-	-	7,542,009.68
存出保证金	1,090,430.19	-	-	-	1,090,430.19
交易性金融资产	-	-	-	3,227,634,961.63	3,227,634,961.63
应收清算款	-	-	-	15,058,659.13	15,058,659.13
其他资产	-	-	-	57,608.48	57,608.48
应收申购款	-	-	-	2,433,896.53	2,433,896.53
资产总计	592,634,590.57	-	-	3,245,185,125.77	3,837,819,716.34
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	-	-	-	3,297,251.54	3,297,251.54
应付赎回款	-	-	-	14,636,233.40	14,636,233.40
应付管理人报酬	-	-	-	4,901,954.47	4,901,954.47
应付托管费	-	-	-	816,992.43	816,992.43
应付销售服务费	-	-	-	445,309.21	445,309.21
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	16,046,519.46	16,046,519.46
负债总计	-	-	-	40,144,260.51	40,144,260.51
利率敏感度缺口	592,634,590.57	-	-	3,205,040,865.26	3,797,675,455.83

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	536,453,737.71	536,453,737.71
应收股利	-	12,502,664.58	12,502,664.58
资产合计	-	548,956,402.29	548,956,402.29
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外	-	548,956,402.29	548,956,402.29

汇风险敞口净额			
项目	上年度末 2021年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	823,477,913.63	823,477,913.63
资产合计	-	823,477,913.63	823,477,913.63
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	823,477,913.63	823,477,913.63

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一汇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：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	27,450,000.00	41,170,000.00
	港币相对人民币贬值 5%	-27,450,000.00	-41,170,000.00

#### 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。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	3,897,364,46 4.51	88.86	3,227,634,961 .63	84.99
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	3,897,364,46 4.51	88.86	3,227,634,961 .63	84.99

#### 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		
	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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	247,390,000.00	147,330,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-247,390,000.00	-147,330,000.00

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上期末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,896,764,619.82	3,225,358,883.97
第二层次	-	5,504.49
第三层次	599,844.69	2,270,573.17
合计	3,897,364,464.51	3,227,634,961.63

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 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	3,897,364,464.51	87.94
	其中：股票	3,897,364,464.51	87.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	498,620,584.42	11.25
8	其他各项资产	36,065,452.94	0.81
9	合计	4,432,050,501.87	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 536,453,737.71 元，占基金资产净值比例为 12.23%。

### 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	19,025.40	0.00
B	采矿业	314,916,810.06	7.18
C	制造业	2,471,232,029.16	56.34

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	164,892,385.25	3.76
E	建筑业	7,002,726.00	0.16
F	批发和零售业	70,873,713.24	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	244,591,935.33	5.58
H	住宿和餐饮业	38,494,800.00	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,217,047.83	0.46
J	金融业	28,450,480.03	0.65
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	170,006.36	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	33,534.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,360,910,726.80	76.63

### 7.2.2 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（%）
能源	85,009,477.80	1.94
原材料	127,221,553.57	2.90
工业	106,631,066.97	2.43
非日常生活消费品	3,589,868.69	0.08
医疗保健	20,625,164.55	0.47
公用事业	162,358,864.83	3.70
房地产	31,017,741.30	0.71
合计	536,453,737.71	12.23

### 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	002129	TCL 中环	2,947,200	173,560,608.00	3.96
2	600519	贵州茅台	73,800	150,921,000.00	3.44

3	600029	南方航空	13,316,700	97,345,077.00	2.22
3	01055	中国南方航空股份	10,774,000	41,830,729.45	0.95
4	002340	格林美	12,936,230	117,719,693.00	2.68
5	00753	中国国航	9,866,000	57,542,416.96	1.31
5	601111	中国国航	4,449,099	51,654,039.39	1.18
6	002597	金禾实业	2,081,600	90,195,728.00	2.06
7	301035	润丰股份	1,066,876	87,963,926.20	2.01
8	02380	中国电力	20,616,000	87,800,373.26	2.00
9	600690	海尔智家	3,113,200	85,488,472.00	1.95
10	00883	中国海洋石油	9,595,000	85,009,477.80	1.94
11	600216	浙江医药	5,593,888	76,356,571.20	1.74
12	00189	东岳集团	8,669,000	72,801,965.52	1.66
13	000519	中兵红箭	2,440,863	71,151,156.45	1.62
14	002460	赣锋锂业	472,500	70,260,750.00	1.60
15	601225	陕西煤业	3,189,499	67,553,588.82	1.54
16	600546	山煤国际	3,408,600	66,331,356.00	1.51
17	002074	国轩高科	1,318,300	60,114,480.00	1.37
18	002539	云图控股	3,748,298	59,935,285.02	1.37
19	000913	钱江摩托	3,216,900	56,488,764.00	1.29
20	600521	华海药业	2,480,700	56,311,890.00	1.28
21	603885	吉祥航空	2,996,346	53,904,264.54	1.23
22	601001	晋控煤业	2,996,600	53,189,650.00	1.21
23	300750	宁德时代	98,758	52,736,772.00	1.20
24	600888	新疆众和	5,472,000	50,342,400.00	1.15
25	603067	振华股份	3,852,677	48,274,042.81	1.10
26	600529	山东药玻	1,695,100	47,378,045.00	1.08
27	600438	通威股份	767,600	45,948,536.00	1.05
28	000630	铜陵有色	14,022,100	45,712,046.00	1.04
29	601058	赛轮轮胎	3,981,093	44,866,918.11	1.02
30	300775	三角防务	911,725	43,899,558.75	1.00
31	002594	比亚迪	125,600	41,886,344.00	0.96
32	601816	京沪高铁	8,301,800	41,675,036.00	0.95
33	002192	融捷股份	268,600	41,283,820.00	0.94
34	603639	海利尔	1,950,595	40,669,905.75	0.93
35	600256	广汇能源	3,668,800	38,669,152.00	0.88
36	600754	锦江酒店	612,000	38,494,800.00	0.88
37	002009	天奇股份	2,061,100	38,130,350.00	0.87
38	00546	阜丰集团	8,820,000	37,940,162.27	0.87
39	600023	浙能电力	10,538,600	36,568,942.00	0.83
40	603558	健盛集团	2,986,700	36,497,474.00	0.83
41	600027	华电国际	9,127,000	35,869,110.00	0.82
42	688063	派能科技	112,449	35,106,577.80	0.80
43	600582	天地科技	7,097,367	33,925,414.26	0.77

44	600559	老白干酒	1,158,900	33,248,841.00	0.76
45	600875	东方电气	1,937,600	31,873,520.00	0.73
46	002935	天奥电子	1,378,650	31,447,006.50	0.72
47	600025	华能水电	4,471,800	31,257,882.00	0.71
48	00688	中国海外发展	1,462,500	31,017,741.30	0.71
49	00916	龙源电力	2,350,000	30,466,998.94	0.69
50	601012	隆基绿能	414,100	27,591,483.00	0.63
51	600497	驰宏锌锗	5,194,548	26,959,704.12	0.61
52	000977	浪潮信息	1,007,736	26,684,849.28	0.61
53	301216	万凯新材	788,200	24,867,710.00	0.57
54	601985	中国核电	3,520,400	24,149,944.00	0.55
55	300610	晨化股份	1,255,200	23,384,376.00	0.53
56	600642	申能股份	4,029,600	22,888,128.00	0.52
57	605020	永和股份	926,618	22,813,335.16	0.52
58	600884	杉杉股份	732,500	21,769,900.00	0.50
59	000762	西藏矿业	374,400	20,940,192.00	0.48
60	02005	石四药集团	5,756,000	20,625,164.55	0.47
61	00392	北京控股	851,000	20,304,690.65	0.46
62	600547	山东黄金	1,087,400	20,182,144.00	0.46
63	300041	回天新材	1,131,400	19,652,418.00	0.45
64	002353	杰瑞股份	470,582	18,964,454.60	0.43
65	002017	东信和平	1,550,500	18,683,525.00	0.43
66	000933	神火股份	1,410,900	18,454,572.00	0.42
67	300896	爱美客	30,000	18,000,300.00	0.41
68	002801	微光股份	586,150	17,496,577.50	0.40
69	601717	郑煤机	1,180,800	17,015,328.00	0.39
70	600985	淮北矿业	1,152,527	16,780,793.12	0.38
71	600456	宝钛股份	281,100	16,697,340.00	0.38
72	002810	山东赫达	451,870	16,443,549.30	0.37
73	002056	横店东磁	569,300	15,154,766.00	0.35
74	002532	天山铝业	2,257,700	14,742,781.00	0.34
75	300438	鹏辉能源	239,200	14,698,840.00	0.34
76	000731	四川美丰	1,615,000	14,696,500.00	0.34
77	300763	锦浪科技	64,700	13,781,100.00	0.31
78	01083	港华智慧能源	3,848,000	13,755,423.28	0.31
79	002046	国机精工	985,100	13,476,168.00	0.31
80	00826	天工国际	5,442,000	13,170,661.46	0.30
81	600919	江苏银行	1,847,000	13,150,640.00	0.30
82	600123	兰花科创	782,400	12,870,480.00	0.29
83	601126	四方股份	791,500	12,830,215.00	0.29
84	300502	新易盛	478,462	12,535,704.40	0.29
85	688349	三一重能	287,926	11,732,984.50	0.27
86	600131	国网信通	845,100	11,366,595.00	0.26
87	600309	万华化学	117,100	11,357,529.00	0.26

88	603267	鸿远电子	81,500	10,947,895.00	0.25
89	000686	东北证券	1,556,400	10,879,236.00	0.25
90	600166	福田汽车	3,841,700	10,872,011.00	0.25
91	300765	新诺威	756,600	10,796,682.00	0.25
92	300130	新国都	865,500	10,611,030.00	0.24
93	603585	苏利股份	539,000	10,472,770.00	0.24
94	601020	华钰矿业	673,300	10,153,364.00	0.23
95	601238	广汽集团	665,758	10,146,151.92	0.23
96	00902	华能国际电力股份	3,000,000	10,031,378.70	0.23
97	300026	红日药业	1,302,300	10,027,710.00	0.23
98	605117	德业股份	34,100	9,544,249.00	0.22
99	600507	方大特钢	1,303,100	9,108,669.00	0.21
100	300613	富瀚微	104,200	8,836,160.00	0.20
101	002986	宇新股份	331,856	7,791,978.88	0.18
102	688323	瑞华泰	310,277	7,518,011.71	0.17
103	600886	国投电力	694,300	7,290,150.00	0.17
104	03898	时代电气	219,300	7,257,920.56	0.17
105	688089	嘉必优	221,319	7,248,197.25	0.17
106	601669	中国电建	889,800	7,002,726.00	0.16
107	601222	林洋能源	829,800	6,928,830.00	0.16
108	600336	澳柯玛	1,012,100	6,882,280.00	0.16
109	000591	太阳能	817,200	6,823,620.00	0.16
110	002545	东方铁塔	581,600	6,618,608.00	0.15
111	000975	银泰黄金	650,300	6,333,922.00	0.14
112	000739	普洛药业	267,200	5,515,008.00	0.13
113	603337	杰克股份	219,100	4,706,268.00	0.11
114	600837	海通证券	446,800	4,383,108.00	0.10
115	603368	柳药集团	253,900	4,372,158.00	0.10
116	09618	京东集团—S W	16,605	3,589,868.69	0.08
117	688529	豪森股份	114,807	3,522,278.76	0.08
118	002734	利民股份	346,200	3,482,772.00	0.08
119	01818	招金矿业	564,000	3,308,764.32	0.08
120	603938	三孚股份	64,760	3,201,086.80	0.07
121	688606	奥泰生物	20,787	2,528,114.94	0.06
122	688377	迪威尔	75,768	2,345,019.60	0.05
123	688519	南亚新材	67,683	1,917,459.39	0.04
124	688329	艾隆科技	57,413	1,857,310.55	0.04
125	601208	东材科技	124,000	1,602,080.00	0.04
126	300911	亿田智能	6,100	468,785.00	0.01
127	688234	天岳先进	6,759	452,853.00	0.01
128	688306	均普智能	47,094	244,417.86	0.01
129	688190	云路股份	3,026	235,271.50	0.01
130	300834	星辉环材	6,349	191,974.69	0.00

131	301123	奕东电子	6,551	170,810.09	0.00
132	301235	华康医疗	4,178	162,419.54	0.00
133	301166	优宁维	2,528	148,798.08	0.00
134	301189	奥尼电子	4,345	144,731.95	0.00
135	301199	迈赫股份	4,014	128,608.56	0.00
136	300223	北京君正	1,156	122,825.00	0.00
137	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.00
138	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.00
139	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.00
140	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.00
141	002483	润邦股份	9,110	58,850.60	0.00
142	301010	晶雪节能	2,172	55,060.20	0.00
143	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
144	301036	双乐股份	2,047	46,016.56	0.00
145	600032	浙江新能	3,045	44,609.25	0.00
146	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
147	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
148	600927	永安期货	1,859	37,496.03	0.00
149	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
150	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.00
151	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
152	300981	中红医疗	1,082	27,288.04	0.00
153	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
154	605339	南侨食品	864	21,919.68	0.00
155	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
156	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
157	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.00
158	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
159	605296	神农集团	740	19,025.40	0.00
160	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
161	301082	久盛电气	915	16,973.25	0.00
162	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
163	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
164	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
165	603209	兴通股份	595	13,518.40	0.00
166	001218	丽臣实业	490	11,701.20	0.00
167	301108	洁雅股份	280	11,079.60	0.00
168	603511	爱慕股份	553	9,660.91	0.00
169	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
170	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
171	300996	普联软件	1	29.55	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	002129	TCL 中环	134,367,029.36	3.54
2	002340	格林美	122,132,386.56	3.22
3	601398	工商银行	88,283,722.00	2.32
4	601001	晋控煤业	88,196,316.51	2.32
5	601899	紫金矿业	84,135,779.00	2.22
6	00883	中国海洋石油	80,612,932.44	2.12
7	600521	华海药业	79,367,920.73	2.09
8	600690	海尔智家	79,249,715.20	2.09
9	600029	南方航空	71,545,346.06	1.88
10	002460	赣锋锂业	69,183,174.93	1.82
11	600547	山东黄金	66,374,980.93	1.75
12	000933	神火股份	64,352,551.80	1.69
13	601225	陕西煤业	61,380,251.32	1.62
14	600256	广汇能源	60,339,203.39	1.59
15	002539	云图控股	59,668,741.94	1.57
16	002074	国轩高科	56,777,732.58	1.50
17	000630	铜陵有色	55,901,584.06	1.47
18	00688	中国海外发展	49,661,529.70	1.31
19	601666	平煤股份	48,968,536.54	1.29
20	000519	中兵红箭	47,914,938.00	1.26

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	00700	腾讯控股	113,703,452.60	2.99
2	000519	中兵红箭	92,434,921.30	2.43
3	600048	保利发展	87,446,454.94	2.30
4	601398	工商银行	86,589,056.00	2.28
5	601899	紫金矿业	84,799,932.88	2.23
6	00688	中国海外发展	80,674,518.74	2.12
7	601058	赛轮轮胎	76,932,764.95	2.03
8	001979	招商蛇口	67,560,898.14	1.78

9	00189	东岳集团	65,255,427.21	1.72
10	601666	平煤股份	62,100,756.57	1.64
11	600010	包钢股份	61,644,659.00	1.62
12	00836	华润电力	61,448,216.29	1.62
13	600166	福田汽车	59,352,164.52	1.56
14	000933	神火股份	54,235,250.08	1.43
15	300750	宁德时代	52,936,504.00	1.39
16	002258	利尔化学	50,487,928.49	1.33
17	600036	招商银行	47,526,781.22	1.25
18	600030	中信证券	46,632,437.06	1.23
19	002206	海利得	44,455,714.92	1.17
20	601600	中国铝业	44,259,270.57	1.17

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	3,722,140,986.30
卖出股票的收入（成交）总额	3,012,805,708.27

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

## 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

### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

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

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	982,599.71

2	应收清算款	16,890,423.24
3	应收股利	12,502,664.58
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,689,765.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,065,452.94

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的股票。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
华安精致生活混合 A	48,047	50,132.24	727,104,553.81	30.19%	1,681,598,966.46	69.81%
华安精致生活混合 C	51,337	17,562.65	557,801,322.79	61.87%	343,812,198.78	38.13%
合计	99,384	33,308.35	1,284,905,876.60	38.82%	2,025,411,165.24	61.18%

**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	华安精致生活混合 A	612,343.16	0.03%
	华安精致生活混合 C	447,746.27	0.05%
	合计	1,060,089.43	0.03%

**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

项目	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 9 日）基金份额总额	6,409,375,385.65	586,767,999.07
本报告期期初基金份额总额	2,120,008,646.22	653,215,229.21
本报告期基金总申购份额	772,628,062.10	709,550,021.44
减：本报告期基金总赎回份额	483,933,188.05	461,151,729.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,408,703,520.27	901,613,521.57

**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：

2022 年 4 月 30 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告》，范伟隽先生离任本基金管理人的首席信息官。

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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内，无涉及本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，基金管理人、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	
国泰君安证券	3	3,343,403,365.74	49.70%	2,966,175.10	49.00%	-
华创证券	1	758,836,711.65	11.28%	706,716.40	11.68%	-
申万宏源	1	661,249,214.28	9.83%	579,612.73	9.58%	-
国海证券	1	615,891,216.00	9.16%	573,580.38	9.48%	-
中泰证券	1	468,968,633.49	6.97%	436,747.44	7.22%	-
华西证券	1	422,478,844.37	6.28%	393,459.23	6.50%	-
长江证券	1	330,908,934.77	4.92%	280,005.19	4.63%	-
国信证券	1	65,492,176.42	0.97%	60,995.80	1.01%	-
安信证券	1	59,643,027.08	0.89%	55,545.83	0.92%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
西南证券	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，最大限度地调调整体资源，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：

2022 年 1 月完成租用托管在中国银行的华创证券上交所 54442 交易单元

2022 年 1 月完成租用托管在中国银行的国海证券上交所 38584 交易单元

2022 年 2 月完成租用托管在中国银行的国泰君安北交所 720223 交易单元

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
国泰君安证券	3,995,260.20	52.72%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国海证券	3,583,000.00	47.28%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（天岳先进）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-06
3	华安精致生活混合型证券投资基金 2021 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	2022-01-21
4	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-01-26
5	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（万控智造）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-04
6	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	2022-03-15
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（泰恩康）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-03-23
8	华安精致生活混合型证券投资基金 2021 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	2022-03-30
9	华安精致生活混合型证券投资基金 2022 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	2022-04-21
10	华安基金管理有限公司关于首席信息官离任的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2022-04-30

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、《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安精致生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安精致生活混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安精致生活混合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住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日