

**华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金**  
**2022 年第 4 季度报告**  
**2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                            |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华安添祥 6 个月持有混合                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 011390                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2021 年 7 月 21 日                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 630,919,319.29 份                                                                                                                                           |
| 投资目标       | 本基金在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                               |
| 投资策略       | 本基金采用多因素分析框架，从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面，采取定量与定性相结合的分析方法，给出股票、债券和货币市场工具等大类资产投资机会的整体评估，作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期，调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。 |

|                 |                                                    |                 |
|-----------------|----------------------------------------------------|-----------------|
| 业绩比较基准          | 中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中债综合全价指数收益率×80% |                 |
| 风险收益特征          | 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。     |                 |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司                                         |                 |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司                                       |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安添祥 6 个月持有混合 A                                    | 华安添祥 6 个月持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 011390                                             | 016181          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 630,917,306.00 份                                   | 2,013.29 份      |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) |                 |
|----------------|-------------------------------------------|-----------------|
|                | 华安添祥 6 个月持有混合 A                           | 华安添祥 6 个月持有混合 C |
|                |                                           |                 |
| 1.本期已实现收益      | -3,048,228.00                             | -10.84          |
| 2.本期利润         | 20,781,837.52                             | 56.50           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0312                                    | 0.0281          |
| 4.期末基金资产净值     | 620,565,420.34                            | 1,977.05        |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9836                                    | 0.9820          |

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

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

## 3.2 基金净值表现

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

#### 1、华安添祥 6 个月持有混合 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 3.04%      | 0.48%         | 0.48%          | 0.27%                 | 2.56%  | 0.21% |
| 过去六个月          | -1.97%     | 0.45%         | -2.07%         | 0.23%                 | 0.10%  | 0.22% |
| 过去一年           | -5.95%     | 0.53%         | -3.17%         | 0.27%                 | -2.78% | 0.26% |
| 过去三年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -      | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -0.20%     | 0.46%         | -3.39%         | 0.25%                 | 3.19%  | 0.21% |

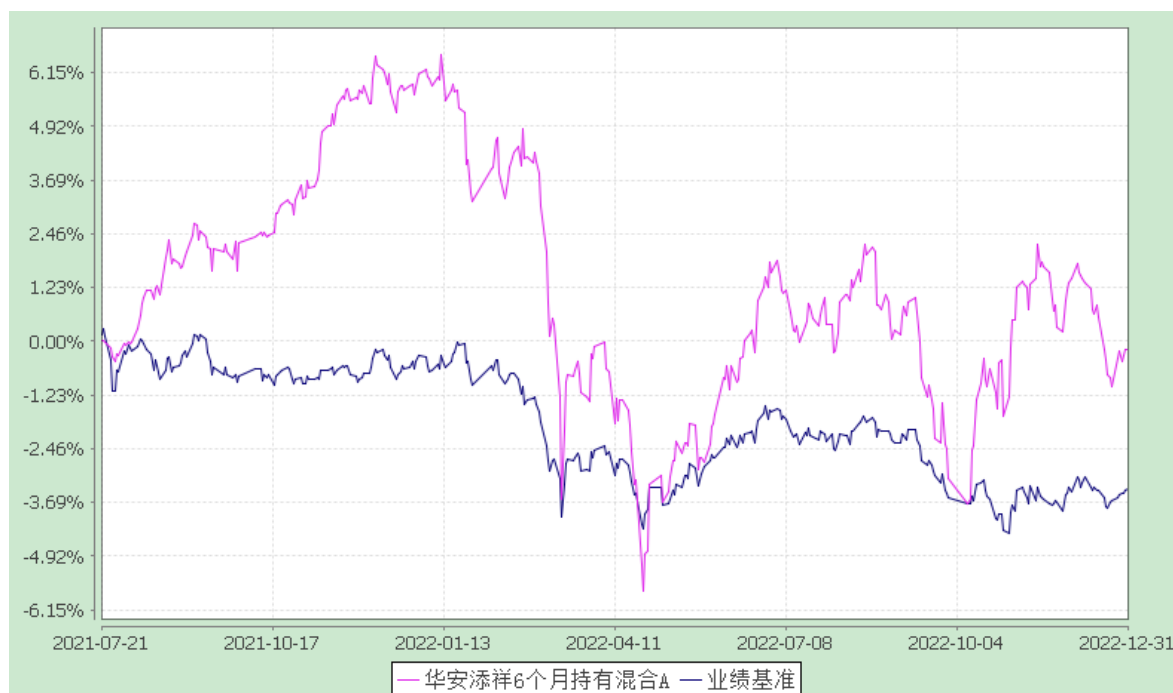
#### 2、华安添祥 6 个月持有混合 C：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 2.95%      | 0.48%         | 0.48%          | 0.27%                 | 2.47% | 0.21% |
| 过去六个月          | -          | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 过去一年           | -          | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 过去三年           | -          | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 过去五年           | -          | -             | -              | -                     | -     | -     |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -1.15%     | 0.46%         | -1.43%         | 0.23%                 | 0.28% | 0.23% |

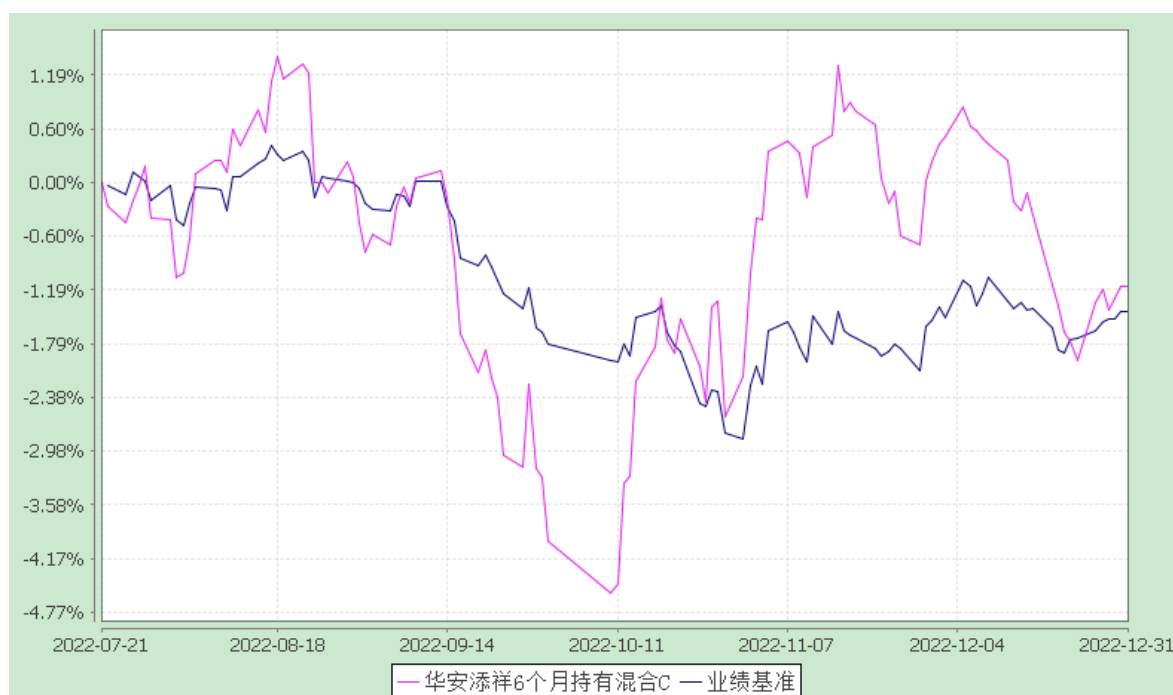
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021 年 7 月 21 日至 2022 年 12 月 31 日)

#### 1. 华安添祥 6 个月持有混合 A：



## 2. 华安添祥 6 个月持有混合 C:



注：本基金自 2022 年 7 月 21 日起增设 C 类基金份额，原基金份额自动转换为 A 类基金份额。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|----------|-------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 陆奔  | 本基金的基金经理 | 2021-07-21  | -    | 11     | 硕士研究生，11 年基金行业从业经历。2011 年加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 9 月起，担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月至 2019 年 1 月，同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月至 2020 年 2 月，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，同时担任华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月起，同时担任华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安兴安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 孙丽娜 | 本基金的基金经理 | 2021-07-21  | -    | 12     | 硕士研究生，12 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月至 2017 年 7 月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理，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                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|     |          |            |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|----------|------------|---|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |    | <p>年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。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。2016 年 12 月至 2021 年 3 月，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月至 2020 年 1 月，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2018 年 9 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安浦债券型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安鑫福 42 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金、华安日日鑫货币市场基金、华安现金宝货币市场基金、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 7 月起，同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 石雨欣 | 本基金的基金经理 | 2021-07-23 | - | 16 | <p>硕士研究生，16 年相关行业从业经验，曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司，历任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月至 2017 年 6 月担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2018 年 8 月，担任华安安康保本混合型证券投资</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>资基金的基金经理。2018 年 8 月起,同时担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起,同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 1 月至 2018 年 9 月,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 6 月,同时担任华安丰利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 2 月,同时担任华安安盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起,同时担任华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月起,同时担任华安鼎安优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合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。

#### 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场所公开竞价交易中，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 2 次，未出现异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年四季度美国通胀预期开始有所降温，美债收益率冲高回落，人民币汇率压力显著缓解。国内疫情管控政策大幅放松，地产刺激政策持续加码，但由于出口下滑以及内需仍然偏弱的影响，国内经济基本面依然较弱。四季度国内通胀水平进一步回落，央行货币政策继续维持宽松，央行宣布降准 25BP 继续释放流动性，资金面总体保持宽松。债市受到疫情和地产政策的调整收益率出现快速调整，理财赎回进一步加剧债市调整，收益率普遍快速上行，信用债调整幅度相对更大。总体看，四季度债券收益率先下后上总体上行，信用债整体表现弱于利率债，期内中债综合全价(总值)指数下跌 0.60%。

2022 年四季度 A 股市场筑底企稳，港股市场显著反弹，随着地产和防疫政策的积极调整，地产链和消费等疫后修复板块涨幅领先。我们维持 A 股目前处于有吸引力的价值内，中期而言大概率是重要底部的判断。

报告期内，本基金继续按照“固收+”策略布局投资，仓位维持中性水平，风格均衡偏成长，稳健参与市场结构性机会。债券部分以高等级信用债配置为主，适度增加了商金债和政金债的配置，灵活调整组合久期，积极防范信用风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.9836 元，本报告期份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准增长率为 0.48%，本基金 C 类份额净值为 0.9820 元，本报告期份额净值增长率为 2.95%，同期业绩比较基准增长率为 0.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为市场信心和经济活力恢复需要时间，但大概率是 2023 年的确定性方向。防疫政策的调整其实就是重要的稳增长举措，随着上游通胀压力的回落，中游制造和消费板块的成本压力有望缓解，叠加明年需求的修复预期，必然带来相应公司的盈利回升。整体而言，我们继续认为市场进入中期非常有吸引力的价值区间，而且底部纠结期大概率过去，基本面右侧即将到来。从风格来看，我们认为价值成长的性价比处于势均力敌的状态，这意味着未来的投资机会

可能更加均衡。操作上，我们会把重心放到自下而上选股，回到公司底层基本面变化，深度布局投资机会。对债市来说，中长端债券受到经济回升预期的增强可能有所承压，中短端债券在资金相对宽松背景下风险可控，债券投资短端的安全性相对较高，继续注重票息收益。

本基金下一阶段投资会维持当前风格，选股更注重中期视角，在控制波动的前提下适度提高持股集中度。债券部分将继续保持中短久期信用债的基本配置，增加流动性较好的金融债的配置，提高组合流动性，合理控制债券部分久期，严控信用风险。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 200,584,243.37 | 30.32        |
|    | 其中：股票             | 200,584,243.37 | 30.32        |
| 2  | 固定收益投资            | 398,646,674.91 | 60.27        |
|    | 其中：债券             | 398,646,674.91 | 60.27        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 62,028,940.11  | 9.38         |
| 7  | 其他各项资产            | 191,749.59     | 0.03         |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 8 | 合计 | 661,451,607.98 | 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22285273.17元，占基金资产净值比例为3.59%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 225,030.00     | 0.04         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 132,529,208.24 | 21.36        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,563,325.00   | 0.74         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 22,165.00      | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 26,770.50      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 10,609,573.09  | 1.71         |
| J  | 金融业              | 8,672,882.38   | 1.40         |
| 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       | 4,553,528.35   | 0.73         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,165,436.00   | 0.67         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 5,957,294.64   | 0.96         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 6,973,757.00   | 1.12         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 178,298,970.20 | 28.73        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 6,647,911.86  | 1.07         |
| 医疗保健     | 15,637,361.31 | 2.52         |

|    |               |      |
|----|---------------|------|
| 合计 | 22,285,273.17 | 3.59 |
|----|---------------|------|

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 601567 | 三星医疗 | 1,116,240 | 15,046,915.20 | 2.42         |
| 2  | 300733 | 西菱动力 | 641,100   | 13,257,948.00 | 2.14         |
| 3  | 02273  | 固生堂  | 197,900   | 8,927,295.72  | 1.44         |
| 4  | 603239 | 浙江仙通 | 531,300   | 7,778,232.00  | 1.25         |
| 5  | 300035 | 中科电气 | 343,700   | 7,073,346.00  | 1.14         |
| 6  | 603338 | 浙江鼎力 | 146,800   | 7,024,380.00  | 1.13         |
| 7  | 300320 | 海达股份 | 660,200   | 6,773,652.00  | 1.09         |
| 8  | 00570  | 中国中药 | 2,116,000 | 6,710,065.59  | 1.08         |
| 9  | 000768 | 中航西飞 | 263,500   | 6,706,075.00  | 1.08         |
| 10 | 03690  | 美团-W | 42,600    | 6,647,911.86  | 1.07         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 81,555,793.98  | 13.14        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,317,298.63  | 6.50         |
| 4  | 企业债券      | 40,396,032.88  | 6.51         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 276,556,852.58 | 44.57        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 137,995.47     | 0.02         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 398,646,674.91 | 64.24        |

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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 102101267 | 21 上海大众 MTN003      | 400,000 | 40,706,452.60 | 6.56         |
| 2  | 102101561 | 21 武商贸集 MTN002      | 400,000 | 40,483,254.79 | 6.52         |
| 3  | 188620    | 21 航租 05            | 400,000 | 40,396,032.88 | 6.51         |
| 4  | 101900437 | 19 建发集 MTN001       | 300,000 | 31,392,575.34 | 5.06         |
| 5  | 102100485 | 21 川高速 MTN003(权益出资) | 300,000 | 31,135,180.27 | 5.02         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2022 年 3 月 21 日，农业银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报贷款核销业务 EAST 数据、未报送权益类投资业务 EAST 数据等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕12 号）给予罚款 480 万元的行政处罚。2022 年 9 月

30 日，农业银行因理财业务存在（1）作为托管机构，存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况（2）理财托管业务违反资产独立性原则要求，操作管理不到位的违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2022〕52 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 191,151.97 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 597.62     |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 191,749.59 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安添祥6个月持有混<br>合A | 华安添祥6个月持有混<br>合C |
|----|------------------|------------------|
|----|------------------|------------------|

|                |                |          |
|----------------|----------------|----------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 699,065,348.53 | 2,013.29 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 441,648.33     | -        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 68,589,690.86  | -        |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -        |
| 本报告期期末基金份额总额   | 630,917,306.00 | 2,013.29 |

## §7 影响投资者决策的其他重要信息

### 7.1 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。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、《华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》

### 8.2 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>。

### 8.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司  
二〇二三年一月二十日