

华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 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 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安进灵活配置混合发起式
基金主代码	002768
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2019 年 1 月 15 日
报告期末基金份额总额	1,349,245,970.62 份
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投资收益机会，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

	<p>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。</p> <p>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。</p>	
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%</p>	
风险收益特征	<p>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。</p>	
基金管理人	<p>华安基金管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>招商银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>华安安进灵活配置混合发起式 A</p>	<p>华安安进灵活配置混合发起式 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>002768</p>	<p>016182</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>1,095,736,501.49 份</p>	<p>253,509,469.13 份</p>

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	华安安进灵活配置混合发起式 A	华安安进灵活配置混合发起式 C
1.本期已实现收益	5,742,908.15	3,694,308.69
2.本期利润	-50,449,062.32	-1,361,911.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0469	-0.0111
4.期末基金资产净值	1,127,787,419.28	260,210,422.70

5.期末基金份额净值	1.0293	1.0264
------------	--------	--------

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、华安安进灵活配置混合发起式 A:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-4.35%	1.08%	-2.67%	0.49%	-1.68%	0.59%
过去六个月	-4.17%	0.98%	-0.01%	0.50%	-4.16%	0.48%
过去一年	-6.95%	0.93%	-8.10%	0.59%	1.15%	0.34%
过去三年	9.98%	0.66%	-2.57%	0.71%	12.55%	-0.05%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	23.77%	0.61%	18.80%	0.74%	4.97%	-0.13%

2、华安安进灵活配置混合发起式 C:

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	-4.45%	1.08%	-2.67%	0.49%	-1.78%	0.59%
过去六个月	-4.35%	0.98%	-0.01%	0.50%	-4.34%	0.48%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-7.30%	0.96%	-5.05%	0.59%	-2.25%	0.37%

注：华安安进灵活配置混合发起式证券投资基金自2022年7月21日起新增C类份额。

3.2.2 自基金转型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

华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金
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

(2019 年 1 月 15 日至 2023 年 6 月 30 日)

1. 华安安进灵活配置混合发起式 A:



2. 华安安进灵活配置混合发起式 C:



注：华安安进灵活配置混合发起式证券投资基金自 2022 年 7 月 21 日起新增 C 类份额。

§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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部高级总监	2016-07-05	-	25 年	硕士研究生，25 年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011 年 6 月至 2021 年 3 月，同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月至 2017 年 6 月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 10 月至 2017 年 7 月同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金、华安现金富利投资基金的基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 7 月同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 6 月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 5 月至 2017 年 7 月，担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月至 2018 年 9 月，担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 月至 2019 年 12 月，同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 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 2018 年

					<p>8 月,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 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 月起,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。2016 年 11 月至 2017 年 12 月,同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月,同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起,同时担任华安新活力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。2019 年 1 月至 2020 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。2019 年 6 月至 2020 年 10 月,同时担任华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 5 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。2021 年 1 月起,同时担任华安锦源 0-7 年金融债 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 8 月起,同时担任华安宁享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 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。</p>
孙澍	本基金的基金经理	2022-07-25	-	16 年	<p>硕士研究生,16 年证券、基金行业从业经验。曾任 Alex Forrest, Inc.研究部数量研究员、芝加哥期权交易所权益研究部数量研究员、平安资产管理有限责任公司量化交易研究员、工银瑞信基金管理有限公司权益投资部投资经理。2021</p>

					年 9 月加入华安基金，2022 年 3 月起担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获

得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合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 5 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

今年二季度的 A 股市场呈现出全面回落的走势。代表白马股风格的上证 50 和沪深 300 指数本季度的收益分别为-6.38%和-5.15%，代表赛道风格的创业板指本季度收益为-7.69%，代表科技风格的科创 50 指数本季度的收益为-7.06%。

本基金在本季度初减持了部分被 AI 概念拉动的 TMT 板块的个股，同时在季度中旬减持了部分消费板块的个股，加仓了一些金融和船舶板块的个股，主要思路依然是沿着基本面趋势和估值的匹配程度来做的调整。AI 相关的成长方向虽然具备新一轮科技浪潮的潜力，但是短期兑现在基本面上的难度还是比较大的，因此短期还是将这个板块当作主题投资来对待。消费板块目前的基

本面数据确实难以支撑当前的估值，板块景气度的扭转依赖于政策的变化，但是目前市场对于这一块的预期也在降低，因此板块当前的配置性价比并不是很高。然而对于金融和船舶板块来说，他们的基本面已经出现或者在下半年将会出现底部反转，比如保险的负债端在今年一季度已经确立了底部反转，银行的利润在今年一季度也已经触底、收入和息差在未来也有望触底，船舶在下半年也有望开始兑现高价格订单，业绩底部拐点可期。这些基本面在底部、股价在底部的板块未来迎来戴维斯双击的可能性还是比较大的，配置价值非常高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0293 元，本报告期份额净值增长率为-4.35%，同期业绩比较基准增长率为-2.67%；本基金 C 类份额净值为 1.0264 元，本报告期份额净值增长率为-4.45%，同期业绩比较基准增长率为-2.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于三季度的 A 股市场我们仍然维持乐观，尤其是在指数层面。我们判断三季度乃至到今年年底，A 股市场有较大概率将处于经济回升、利率上行的宏观环境中，这与我们在一季报中对于经济的判断是一致的，目前为止没有变化。二季度市场基于一些行业的高频数据，对经济的预期确实比较悲观，叠加降息预期，导致利率水平也出现相应的下行，使得我们的判断在二季度有些落空，但是展望三季度，我们认为这一判断兑现的概率还是比较大的。从经济的方面，一季度大幅增长的信贷增速对经济的支撑作用将在三季度后开始体现；上半年的财政政策力度相对比较温和，在下半年有望接力货币政策开始逐步发力，这也将对经济形成支撑；6 月份召开的国常会也明确指出正在抓紧研究出台一系列的稳经济的政策，这也有助于稳定市场的预期。总的来说，我们对于三季度乃至下半年的经济依然维持乐观。从利率的方面，下半年国内的 PPI 和 CPI 在基数的影响下，大概率将呈现触底回升的走势，这对名义利率将有一定的向上拉动作用；下半年美国的通胀受基数影响也将止跌回升，同时根据目前市场的一致预期，下半年美联储还将有两次加息，美债收益率对国内利率也将有一定的拉动；一季度央行公布的贷款加权平均利率开始出现明显的反弹，这也表明实体的真实融资需求在稳固恢复，这也是利率稳步回升的核心驱动力量。因此，综合来看，我们依然认为国内利率水平在未来是有一定概率出现回升的。

在经济回升利率上行的环境下，相对有利的风格还是大盘股和价值股。同时在这个风格领域中，的确有很多板块基本面均已经或将要出现底部向上的拐点，比如大金融中的保险和银行、投资链中的建筑、制造业中的船舶等，我们认为这些板块在下半年均有望走出持续性的行情，也将是本基金未来主要的关注方向。在成长方向上，我们认为随着未来利率水平的上行，对于那些缺

乏基本面支撑的概念或题材板块来说，会面临一定的估值压力，因此在成长板块内选股的容错度下半年要比上半年高很多，只有基本面确实有边际变化且市场关注度尚不高的板块和个股，在下半年才有望能够为组合贡献收益，目前来看主要关注信创方向。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,181,132,138.47	82.02
	其中：股票	1,181,132,138.47	82.02
2	固定收益投资	123,092,465.68	8.55
	其中：债券	123,092,465.68	8.55
	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	120,268,333.13	8.35
7	其他各项资产	15,582,672.98	1.08
8	合计	1,440,075,610.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	32,549,208.00	2.35
C	制造业	83,619,556.51	6.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	244,420,730.64	17.61
F	批发和零售业	59,575.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	36,763,192.00	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	147,851,130.18	10.65
J	金融业	635,788,781.92	45.81
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	79,964.22	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,181,132,138.47	85.10

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	601628	中国人寿	3,060,101	106,981,130.96	7.71
2	600536	中国软件	2,267,291	106,290,602.08	7.66
3	601319	中国人保	15,855,700	92,597,288.00	6.67
4	601668	中国建筑	16,082,500	92,313,550.00	6.65
5	601318	中国平安	1,849,760	85,828,864.00	6.18
6	601288	农业银行	19,330,100	68,235,253.00	4.92
7	601995	中金公司	1,839,498	65,338,968.96	4.71
8	600030	中信证券	3,204,400	63,383,032.00	4.57
9	601390	中国中铁	7,277,000	55,159,660.00	3.97

10	600970	中材国际	3,267,800	41,664,450.00	3.00
----	--------	------	-----------	---------------	------

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	102,386,447.05	7.38
	其中：政策性金融债	50,687,041.10	3.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,706,018.63	1.49
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,092,465.68	8.87

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	092202001	22 国开清发 01	500,000	50,687,041.10	3.65
2	232280012	22 广州银行二级资本债 01	300,000	31,585,438.36	2.28
3	102101578	21 宁德国投 MTN002	200,000	20,706,018.63	1.49
4	137957	22 中泰 Y1	100,000	10,065,938.08	0.73
5	232380021	23 浙商银行二级资本债 01	100,000	10,048,029.51	0.72

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

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。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.12022 年 8 月 22 日，中国平安因未按照规定进行国际收支统计申报，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2022〕23 号）责令改正、给予警告，并处罚款人民币 30 万元。

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	582,670.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,000,002.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,582,672.98

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	华安安进灵活配置混合 发起式A	华安安进灵活配置混合 发起式C

本报告期期初基金份额总额	1,525,065,880.97	211,819,902.14
报告期期间基金总申购份额	46,913,983.22	152,797,468.53
减：报告期期间基金总赎回份额	476,243,362.70	111,107,901.54
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	1,095,736,501.49	253,509,469.13

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	华安安进灵活配置混合发起式A	华安安进灵活配置混合发起式C
报告期期初管理人持有的基金份额	10,001,350.14	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	10,001,350.14	-
报告期期末管理人持有的基金份额	0.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2023-04-27	-10,001,350.14	-10,002,350.14	0.00%
合计			-10,001,350.14	-10,002,350.14	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2022 年 1 月 15 日，华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20230401-20230630	344,850,776.27	17,009,508.54	0.00	361,860,284.81	26.82%
	2	20230401-20230630	770,150,687.36	29,218,354.02	177,777,778.00	621,591,263.38	46.07%
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

10.2 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>。

10.3 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

二〇二三年七月二十日