

# 华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 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> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
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.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57

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>58</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4	基金投资策略的改变 .....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8	其他重大事件 .....	61
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>62</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
12.1	备查文件目录 .....	62
12.2	存放地点 .....	62
12.3	查阅方式 .....	62

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华安安顺灵活配置混合	
基金主代码	519909	
交易代码	519909	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 5 月 12 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	276,060,186.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安安顺灵活配置混合 A	华安安顺灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	519909	016564
报告期末下属分级基金的份额总额	274,262,034.29 份	1,798,152.63 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，并结合对个股、个券的精选策略，以追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。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	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
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高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨牧云	陆志俊
	联系电话	021-38969999	95559

负责人	电子邮箱	service@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		朱学华	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	上海市陆家嘴东路166号中保大厦36楼

## 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（2023年1月1日至2023年6月30日）	
	华安安顺灵活配置混合 A	华安安顺灵活配置混合 C
本期已实现收益	-35,731,948.72	-104,375.28
本期利润	24,718,891.32	52,102.88
加权平均基金份额本期利润	0.0881	0.1795
本期加权平均净值利润率	2.53%	5.28%
本期基金份额净值增长率	2.48%	2.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	华安安顺灵活配置混合 A	华安安顺灵活配置混合 C

期末可供分配利润	689,117,494.88	4,360,775.97
期末可供分配基金份额利润	2.5126	2.4251
期末基金资产净值	941,747,273.23	6,158,928.60
期末基金份额净值	3.434	3.425
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023 年 6 月 30 日)</b>	
	华安安顺灵活配置混合 A	华安安顺灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	245.80%	-4.20%

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

华安安顺灵活配置混合 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	0.82%	1.04%	0.45%	0.42%	0.37%	0.62%
过去三个月	-3.81%	1.04%	-2.09%	0.39%	-1.72%	0.65%
过去六个月	2.48%	0.97%	0.44%	0.39%	2.04%	0.58%
过去一年	-11.01%	1.05%	-5.62%	0.46%	-5.39%	0.59%
过去三年	41.78%	1.37%	-1.57%	0.57%	43.35%	0.80%
自基金合同生效起至今	245.80%	1.40%	41.83%	0.71%	203.97%	0.69%

华安安顺灵活配置混合 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	0.76%	1.05%	0.45%	0.42%	0.31%	0.63%
过去三个月	-3.90%	1.04%	-2.09%	0.39%	-1.81%	0.65%
过去六个月	2.27%	0.97%	0.44%	0.39%	1.83%	0.58%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.20%	0.93%	1.98%	0.42%	-6.18%	0.51%

注：本基金自 2022 年 11 月 3 日起新增 C 类份额。

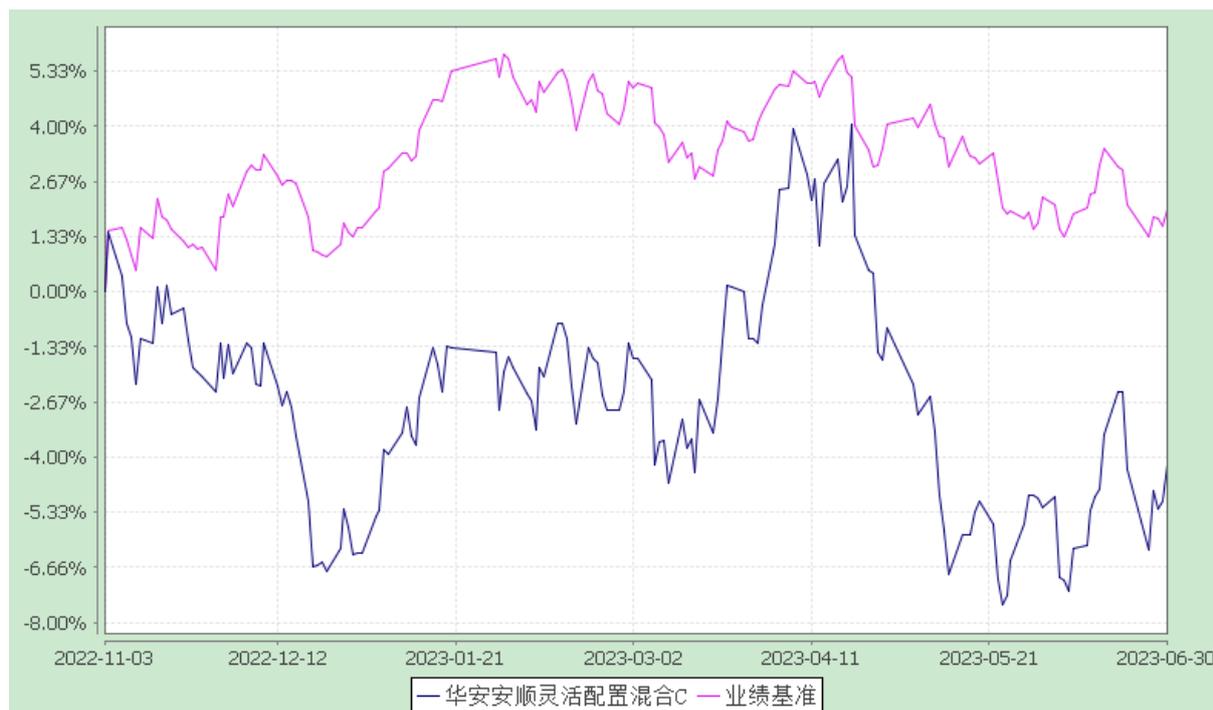
### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安顺灵活配置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  
(2014 年 5 月 12 日至 2023 年 6 月 30 日)

华安安顺灵活配置混合 A



华安安顺灵活配置混合 C



注：本基金自 2022 年 11 月 3 日起新增 C 类份额。

## 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 2023 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 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 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		

高钥群	本基金的基金经理	2019-11-08	-	16 年	硕士研究生，16 年证券、基金从业经验。毕业于英国伦敦政治经济学院，历任 Longview Partners 资产管理公司量化分析师、高盛高华证券金融行业分析师。2011 年 2 月加入华安基金，历任全球投资部研究员、助理投资经理。2017 年 4 月起担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安安华灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月起，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 10 月起，同时担任华安均衡优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 7 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

2023 年以来，美联储加息的次数和幅度超市场预期，2 季度以来美元强势，叠加增长预期下修和人民币弱势，导致 A 股和港股的资金流出。我们认为联邦利率中期顶已经出现，4 季度联储加息可能暂停，新兴市场因而可能得到喘息机会。今年以来，港股和 A 股市场则出现了比较极致的行情分化，市场资金存量有限，AIGC，数字经济等 TMT 行业和“中特估”表现较好，以新能源为代表的成长股和消费医药等行业持续表现疲软。

报告期内，汽车和部分 AIGC 标的为基金做出了正面贡献，我们根据基本面减持了部分医药和消费，增持了部分周期性行业。

#### 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 3.434 元，本报告期份额净值增长率为 2.48%，本基金 C 类份额净值为 3.425 元，本报告期份额净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准增长率为 0.44%。

#### 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，我们认为政府可能出台稳增长政策，经济企稳，A 股应有机会表现，组合配置更加均衡，积极寻找估值合理，增长较高的行业和公司布局。

#### 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，基金托管人在华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，华安基金管理有限公司在华安安顺灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	142,362,363.59	133,174,325.06
结算备付金		3,172,367.81	4,786,798.29
存出保证金		764,683.12	839,488.55
交易性金融资产	6.4.7.2	805,964,377.47	781,337,584.19
其中：股票投资		805,964,377.47	781,337,584.19
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		4,669,984.34	54,694,814.16
应收股利		-	-
应收申购款		273,135.45	64,669.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>957,206,911.78</b>	<b>974,897,679.62</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,897,813.88	627,689.29
应付管理人报酬		1,161,497.00	1,259,870.14
应付托管费		193,582.85	209,978.37
应付销售服务费		2,348.51	2.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		58,900.00	58,900.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,986,567.71	4,732,220.99
负债合计		9,300,709.95	6,888,661.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	254,427,930.98	266,102,284.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	693,478,270.85	701,906,733.78
净资产合计		947,906,201.83	968,009,017.98
负债和净资产总计		957,206,911.78	974,897,679.62

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 276,060,186.92 份，其中 A 类基金份额净值 3.434 元，基金份额总额 274,262,034.29 份；C 类基金份额净值 3.425 元，基金份额总额 1,798,152.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>33,399,379.50</b>	<b>-151,733,251.37</b>
1.利息收入		681,912.91	734,950.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	681,912.91	734,950.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,925,670.30	-217,416,223.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-32,603,698.59	-220,927,197.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	4,678,028.29	3,510,973.97
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	60,607,318.20	64,778,942.21
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	35,818.69	169,078.97
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>8,628,385.30</b>	<b>9,874,389.16</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	7,290,941.36	8,361,274.51
2. 托管费	6.4.10.2	1,215,156.89	1,393,545.79
3. 销售服务费		2,476.34	-
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	119,810.71	119,568.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>24,770,994.20</b>	<b>-161,607,640.53</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,770,994.20</b>	<b>-161,607,640.53</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>24,770,994.20</b>	<b>-161,607,640.53</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	266,102,284.20	-	701,906,733.78	968,009,017.98
二、本期期初净资产（基金净值）	266,102,284.20	-	701,906,733.78	968,009,017.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,674,353.22	-	-8,428,462.93	-20,102,816.15
（一）、综合收益总额	-	-	24,770,994.20	24,770,994.20
（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）	-11,674,353.22	-	-33,199,457.13	-44,873,810.35
其中：1.基金申购款	5,143,751.46	-	13,662,199.05	18,805,950.51
2.基金赎回款	-16,818,104.68	-	-46,861,656.18	-63,679,760.86
（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）	254,427,930.98	-	693,478,270.85	947,906,201.83
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

项目	上年度可比期间			
	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）	278,658,329.84	-	1,047,816,638.93	1,326,474,968.77
二、本期期初净资产（基金净值）	278,658,329.84	-	1,047,816,638.93	1,326,474,968.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,867,223.67	-	-184,253,464.78	-192,120,688.45
（一）、综合收益总额	-	-	-161,607,640.53	-161,607,640.53
（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）	-7,867,223.67	-	-22,645,824.25	-30,513,047.92
其中：1.基金申购款	16,990,570.21	-	53,026,157.93	70,016,728.14
2.基金赎回款	-24,857,793.88	-	-75,671,982.18	-100,529,776.06
（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）	270,791,106.17	-	863,563,174.15	1,134,354,280.32

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：陈松一

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据安顺证券投资基金(以下简称“原基金安顺”)基金份额持有人大会 2014 年 4 月 8 日决议通过的《关于安顺证券投资基金转型有关事项的议案》以及中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证券基金机构监管部部函[2014]66 号《关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》，由原基金安顺转型而成。原基金安顺为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限为 15 年，至 2014 年 6 月 15 日止。本基金的基金管理人向上交所申请提前终止原基金安顺的上市交易，并获得上海证券交易所[2014]184 号文同意，原基金安顺于 2014 年 5 月 9 日进行终止上市权利登记，2014 年 5 月 12 日终止上市，并更名为华安安顺灵活配置混合型证券投资基金。原《安顺证券投资基金基金合同》失效，《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。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为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金管理人华安基金管理有限公司 2022 年 11 月 3 日《华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2022 年 11 月 3 日起对本基金现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额自动转换为 A 类基金份额，并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，由于基金费用的不同，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。C 类基金份额的初始基金份额净值与当日 A 类基金份额的基金份额净值一致。

原基金安顺于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 3,172,904,977.06 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于原安顺证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定，本基金以 2014 年 6 月 9 日为基金份额拆分基准日对投资人持有的原基金安顺份额进行了拆分，拆分比例为 1:1.085545777，并于 2014 年 6 月 10 日进行了变更登记。

本基金自 2014 年 5 月 15 日至 2014 年 6 月 4 日期间内开放集中申购，共募集集中申购资金

1,081,514,229.95 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 390,635.25 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(2014)第 308 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2014 年 6 月 9 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 1,081,514,229.95 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 390,635.25 份基金份额，并于 2014 年 6 月 10 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是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，含普通股和优先股、存托凭证)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、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：50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。

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 2023 年 8 月 28 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《华安安顺灵活配置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 2023 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 2023 年

6 月 30 日的财务状况以及 2023 上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、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 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金

融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中

证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	142,362,363.59
等于：本金	142,335,772.74
加：应计利息	26,590.85

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	142,362,363.59

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	751,005,347.57	-	805,964,377.47	54,959,029.90
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	751,005,347.57	-	805,964,377.47	54,959,029.90

### 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

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,434.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,255,037.13
其中：交易所市场	5,255,037.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	49,588.57
其他	500,000.00
合计	5,986,567.71

6.4.7.7 实收基金

华安安顺灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	288,884,878.16	266,099,248.05
本期申购	3,542,871.33	3,263,440.39
本期赎回（以“-”号填列）	-18,165,715.20	-16,732,910.09
本期末	274,262,034.29	252,629,778.35

华安安顺灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,036.15	3,036.15

本期申购	1,880,311.07	1,880,311.07
本期赎回（以“-”号填列）	-85,194.59	-85,194.59
本期末	1,798,152.63	1,798,152.63

#### 6.4.7.8 未分配利润

华安安顺灵活配置混合 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	836,431,990.70	-134,532,387.52	701,899,603.18
本期利润	-35,731,948.72	60,450,840.04	24,718,891.32
本期基金份额交易产生的变动数	-41,789,470.84	4,288,471.22	-37,500,999.62
其中：基金申购款	10,106,409.66	-968,403.43	9,138,006.23
基金赎回款	-51,895,880.50	5,256,874.65	-46,639,005.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	758,910,571.14	-69,793,076.26	689,117,494.88

华安安顺灵活配置混合 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	8,544.35	-1,413.75	7,130.60
本期利润	-104,375.28	156,478.16	52,102.88
本期基金份额交易产生的变动数	4,914,670.94	-613,128.45	4,301,542.49
其中：基金申购款	5,154,368.91	-630,176.09	4,524,192.82
基金赎回款	-239,697.97	17,047.64	-222,650.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,818,840.01	-458,064.04	4,360,775.97

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	644,357.11
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	30,527.66
其他	7,028.14
合计	681,912.91

### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-32,603,698.59
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	-32,603,698.59

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,832,157,274.81
减：卖出股票成本总额	2,856,227,698.35
减：交易费用	8,533,275.05
买卖股票差价收入	-32,603,698.59

### 6.4.7.11 债券投资收益

无。

### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

### 6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

### 6.4.7.14 衍生工具收益

#### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,678,028.29
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	4,678,028.29

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	60,607,318.20
——股票投资	60,607,318.20
——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	60,607,318.20

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	35,818.69
合计	35,818.69

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00

银行汇划费	1,714.77
合计	119,810.71

#### 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

无。

##### 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、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	912,818,227.18	16.18%	313,091,026.84	5.07%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	850,098.10	16.18%	850,098.10	16.18%
关联方名称	上年度可比期间 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	291,582.67	5.07%	291,582.67	5.07%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,290,941.36	8,361,274.51
其中：支付销售机构的客户维护费	432,550.34	556,745.18

注：支付基金管理人华安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年6月 30日	2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,215,156.89	1,393,545.79

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安顺灵活配置 混合 A	华安安顺灵活配置混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	6.84	6.84
交通银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	6.84	6.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华安安顺灵活配置 混合 A	华安安顺灵活配置混合 C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金，再由华安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
交通银行	142,362,363.59	644,357.11	214,622,078.54	686,514.25

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023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	688361	中科飞测	网下申购	8,137.00	192,033.20
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318.00	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508.00	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581.00	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499.00	30,873.13
上年度可比期间 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	5,986.00	498,058.84
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

公司					
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

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2023 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
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6个月(含)	新股限售	11.10	17.04	3,207.00	35,597.70	54,647.28	-
688361	中科飞测	2023-05-12	1-6个月(含)	新股限售	23.60	64.67	814.00	19,210.40	52,641.38	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6个月(含)	新股限售	23.77	42.89	1,187.00	28,214.99	50,910.43	-
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6个月(含)	新股限售	5.69	5.41	8,791.00	50,020.79	47,559.31	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6个月(含)	新股限售	37.88	29.49	1,456.00	55,153.28	42,937.44	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	1-6个月(含)	新股限售	76.80	107.95	364.00	27,955.20	39,293.80	-
001287	中电港	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	11.88	21.02	1,386.00	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6个月(含)	新股限售	135.80	120.41	240.00	32,592.00	28,898.40	-
688507	索辰科技	2023-04-10	1-6个月(含)	新股限售	245.56	122.11	150.00	36,834.00	18,316.50	-
68850	索辰	2023-0	1-6个	新股	-	122.11	72.00	-	8,791.	-

7	科技	6-20	月 (含)	限售- 送股					92	
68858 2	芯动 联科	2023-0 6-21	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.74	40.68	648.00	17,327 .52	26,360 .64	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	1-6 个 月 (含)	新股 限售	29.60	71.42	333.00	9,856. 80	23,782 .86	-
30130 3	真兰 仪表	2023-0 2-13	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.80	22.32	1,058. 00	28,354 .40	23,614 .56	-
68855 2	航天 南湖	2023-0 5-08	1-6 个 月 (含)	新股 限售	21.17	23.50	956.00	20,238 .52	22,466 .00	-
68857 0	天玛 智控	2023-0 5-29	1-6 个 月 (含)	新股 限售	30.26	25.33	884.00	26,749 .84	22,391 .72	-
30130 7	美利 信	2023-0 4-14	1-6 个 月 (含)	新股 限售	32.34	31.86	687.00	22,217 .58	21,887 .82	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	1-6 个 月 (含)	新股 限售	6.58	7.58	2,846. 00	18,726 .68	21,572 .68	-
30143 9	泓淋 电力	2023-0 3-10	1-6 个 月 (含)	新股 限售	19.99	16.90	949.00	18,970 .51	16,038 .10	-
68862 3	二元 科技	2023-0 5-31	1-6 个 月 (含)	新股 限售	125.88	86.79	178.00	22,406 .64	15,448 .62	-
30139 9	英特 科技	2023-0 5-16	1-6 个 月 (含)	新股 限售	43.99	51.57	293.00	12,889 .07	15,110 .01	-
30130 5	朗坤 环境	2023-0 5-15	1-6 个 月 (含)	新股 限售	25.25	19.69	753.00	19,013 .25	14,826 .57	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	1-6 个 月 (含)	新股 限售	14.16	16.21	888.00	12,574 .08	14,394 .48	-
30139 5	仁信 新材	2023-0 6-21	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.68	26.68	520.00	13,873 .60	13,873 .60	-
30121 0	金杨 股份	2023-0 6-21	1-6 个 月 (含)	新股 限售	57.88	49.17	281.00	16,264 .28	13,816 .77	-

688512	慧智微	2023-05-08	1-6个月(含)	新股限售	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6个月(含)	新股限售	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	1-6个月(含)	新股限售	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	1-6个月(含)	新股限售	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6个月(含)	新股限售	41.20	42.69	262.00	10,794.40	11,184.78	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1-6个月(含)	新股限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	1-6个月(含)	新股限售	10.36	11.84	875.00	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	1-6个月(含)	新股限售	25.28	29.87	336.00	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	1-6个月(含)	新股限售	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6个月(含)	新股限售	72.50	58.42	165.00	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	1-6个月(含)	新股限售	24.66	22.51	420.00	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6个月(含)	新股限售	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6个月(含)	新股限售	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	1-6个月(含)	新股限售	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	1-6个月	新股限售	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-

			(含)							
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6个月(含)	新股限售	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6个月(含)	新股限售	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月(含)	新股限售	44.18	25.10	241.00	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	25.10	97.00	-	2,434.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	1-6个月(含)	新股限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	1-6个月(含)	新股限售	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1-6个月(含)	新股限售	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023-03-28	1-6个月(含)	新股限售	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	1-6个月(含)	新股限售	55.00	55.00	140.00	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1-6个月(含)	新股限售	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6个月(含)	新股限售	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6个月(含)	新股限售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023-03-30	1-6个月(含)	新股限售	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	1-6个月(含)	新股限售	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
00128	三联	2023-0	1-6个	新股	27.93	33.03	105.00	2,932.	3,468.	-

2	锻造	5-15	月 (含)	限售				65	15	
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6个月 (含)	新股限售	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6个月 (含)	新股限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6个月 (含)	新股限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251.00	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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 2023 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 2023 年 6 月 30 日止，本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，基金的预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金。本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。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。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；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合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持全部证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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。

#### 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、流通受限制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 6.4.12。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、存出保证金和债券投资等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	142,362,363.59	-	-	-	142,362,363.59
结算备付金	3,172,367.81	-	-	-	3,172,367.81
存出保证金	764,683.12	-	-	-	764,683.12
交易性金融资产	-	-	-	805,964,377.47	805,964,377.47
应收清算款	-	-	-	4,669,984.34	4,669,984.34
应收申购款	118.00	-	-	273,017.45	273,135.45
资产总计	146,299,532.52	-	-	810,907,379.26	957,206,911.78
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,897,813.88	1,897,813.88
应付管理人报酬	-	-	-	1,161,497.00	1,161,497.00
应付托管费	-	-	-	193,582.85	193,582.85
应付销售服务费	-	-	-	2,348.51	2,348.51
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,986,567.71	5,986,567.71
负债总计	-	-	-	9,300,709.95	9,300,709.95
利率敏感度缺口	146,299,532.52	-	-	801,606,669.31	947,906,201.83
<b>上年度末</b>					
<b>2022 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	133,174,325.06	-	-	-	133,174,325.06
结算备付金	4,786,798.29	-	-	-	4,786,798.29
存出保证金	839,488.55	-	-	-	839,488.55

交易性金融资产	-	-	-	781,337,584.19	781,337,584.19
应收清算款	-	-	-	54,694,814.16	54,694,814.16
应收申购款	1,499.78	-	-	63,169.59	64,669.37
资产总计	138,802,111.68	-	-	836,095,567.94	974,897,679.62
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	627,689.29	627,689.29
应付管理人报酬	-	-	-	1,259,870.14	1,259,870.14
应付托管费	-	-	-	209,978.37	209,978.37
应付销售服务费	-	-	-	2.85	2.85
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
其他负债	-	-	-	4,732,220.99	4,732,220.99
负债总计	-	-	-	6,888,661.64	6,888,661.64
利率敏感度缺口	138,802,111.68	-	-	829,206,906.30	968,009,017.98

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 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 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(2022 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的股票，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在构建和管理投资组合的过程中，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。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。本基金的股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%；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%；权证、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。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	805,964,377. 47	85.03	781,337,584.1 9	80.72
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	805,964,377. 47	85.03	781,337,584.1 9	80.72

#### 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：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	86,510,000.00	81,720,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-86,510,000.00	-81,720,000.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	804,637,245.42	779,459,879.19
第二层次	471,091.22	-
第三层次	856,040.83	1,877,705.00
合计	805,964,377.47	781,337,584.19

###### 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。

## 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	805,964,377.47	84.20
	其中：股票	805,964,377.47	84.20
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	145,534,731.40	15.20
8	其他各项资产	5,707,802.91	0.60
9	合计	957,206,911.78	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	18,063,207.00	1.91
C	制造业	670,454,137.18	70.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,882,440.64	1.99
F	批发和零售业	60,160.60	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	46,178,844.00	4.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,751.14	0.02
J	金融业	29,290,896.00	3.09
K	房地产业	22,801,197.00	2.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	805,964,377.47	85.03

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	600150	中国船舶	1,524,100	50,158,131.00	5.29
2	000425	徐工机械	4,969,600	33,644,192.00	3.55
3	688036	传音控股	226,932	33,359,004.00	3.52
4	000625	长安汽车	2,531,600	32,733,588.00	3.45
5	000063	中兴通讯	710,600	32,360,724.00	3.41
6	002463	沪电股份	1,516,900	31,763,886.00	3.35
7	601577	长沙银行	3,774,600	29,290,896.00	3.09
8	603283	赛腾股份	653,900	29,098,550.00	3.07
9	000333	美的集团	488,600	28,788,312.00	3.04
10	000521	长虹美菱	3,745,500	28,615,620.00	3.02

11	601333	广深铁路	6,741,300	26,695,548.00	2.82
12	600559	老白干酒	1,012,900	24,826,179.00	2.62
13	600276	恒瑞医药	498,400	23,873,360.00	2.52
14	002409	雅克科技	324,600	23,656,848.00	2.50
15	000729	燕京啤酒	1,869,900	23,317,653.00	2.46
16	001979	招商蛇口	1,749,900	22,801,197.00	2.41
17	601689	拓普集团	261,200	21,078,840.00	2.22
18	600732	爱旭股份	683,200	21,008,400.00	2.22
19	300820	英杰电气	248,700	20,487,906.00	2.16
20	601989	中国重工	4,154,500	20,024,690.00	2.11
21	002387	维信诺	2,169,600	19,895,232.00	2.10
22	601865	福莱特	516,500	19,890,415.00	2.10
23	002475	立讯精密	607,100	19,700,395.00	2.08
24	600026	中远海能	1,541,400	19,483,296.00	2.06
25	002984	森麒麟	601,300	18,916,898.00	2.00
26	601800	中国交建	1,730,000	18,874,300.00	1.99
27	688169	石头科技	58,674	18,815,578.32	1.98
28	600584	长电科技	584,900	18,231,333.00	1.92
29	601857	中国石油	2,418,100	18,063,207.00	1.91
30	003038	鑫铂股份	349,100	14,473,686.00	1.53
31	603986	兆易创新	125,168	13,299,100.00	1.40
32	002050	三花智控	323,000	9,773,980.00	1.03
33	002965	祥鑫科技	173,400	9,654,912.00	1.02
34	688120	华海清科	38,266	9,644,945.30	1.02
35	603197	保隆科技	173,800	9,428,650.00	0.99
36	688141	杰华特	199,219	7,789,462.90	0.82
37	688443	智翔金泰	14,558	447,920.26	0.05
38	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.03
39	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
40	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
41	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
42	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
43	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
44	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
45	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
46	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
47	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
48	688472	阿特斯	3,207	54,647.28	0.01
49	688361	中科飞测	814	52,641.38	0.01
50	301358	湖南裕能	1,187	50,910.43	0.01
51	688469	中芯集成	8,791	47,559.31	0.01
52	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
53	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
54	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00

55	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
56	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
57	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
58	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
59	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
60	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
61	601061	中信金属	2,846	21,572.68	0.00
62	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
63	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
64	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
65	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
66	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
67	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
68	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
69	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
70	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
71	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
72	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
73	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
74	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
75	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
76	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
77	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
78	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
79	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
80	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
81	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
82	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
83	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
84	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
85	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
86	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
87	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
88	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
89	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	001367	海森药业	55	2,171.40	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	600026	中远海能	73,401,848.00	7.58
2	000063	中兴通讯	69,475,247.60	7.18
3	002463	沪电股份	50,213,909.46	5.19
4	001979	招商蛇口	48,843,679.50	5.05
5	603986	兆易创新	47,683,594.36	4.93
6	002371	北方华创	40,789,942.68	4.21
7	002230	科大讯飞	40,458,158.18	4.18
8	002415	海康威视	40,215,778.42	4.15
9	002050	三花智控	39,988,290.00	4.13
10	000425	徐工机械	39,265,759.00	4.06
11	688120	华海清科	39,243,470.68	4.05
12	688981	中芯国际	39,014,378.58	4.03
13	601865	福莱特	38,706,736.56	4.00
14	600150	中国船舶	38,412,518.00	3.97
15	600027	华电国际	38,094,562.86	3.94
16	688167	炬光科技	35,185,280.62	3.63
17	000625	长安汽车	33,055,517.40	3.41
18	002409	雅克科技	30,381,470.90	3.14
19	600276	恒瑞医药	30,376,851.72	3.14
20	603019	中科曙光	29,968,966.88	3.10
21	002299	圣农发展	29,939,460.03	3.09
22	601577	长沙银行	29,893,787.52	3.09
23	000066	中国长城	29,825,240.21	3.08
24	600809	山西汾酒	29,502,748.00	3.05
25	600702	舍得酒业	29,257,018.00	3.02
26	600030	中信证券	29,146,761.00	3.01
27	600584	长电科技	28,748,575.76	2.97
28	000333	美的集团	28,720,174.00	2.97
29	000977	浪潮信息	28,629,946.62	2.96
30	601989	中国重工	28,586,104.00	2.95
31	600559	老白干酒	28,395,253.11	2.93
32	688036	传音控股	27,907,064.84	2.88
33	601333	广深铁路	26,195,790.00	2.71
34	300223	北京君正	25,075,731.53	2.59
35	002665	首航高科	24,985,402.43	2.58
36	688297	中无人机	24,694,871.91	2.55
37	300364	中文在线	24,178,982.94	2.50
38	000521	长虹美菱	24,164,225.12	2.50
39	002156	通富微电	24,137,710.23	2.49
40	000729	燕京啤酒	23,339,565.00	2.41
41	000776	广发证券	22,731,287.00	2.35
42	600570	恒生电子	22,056,167.84	2.28

43	300115	长盈精密	21,853,311.05	2.26
44	688008	澜起科技	21,362,370.41	2.21
45	600028	中国石化	20,626,129.70	2.13
46	601377	兴业证券	20,564,120.70	2.12
47	002555	三七互娱	20,544,466.00	2.12
48	300785	值得买	20,511,935.47	2.12
49	600375	汉马科技	20,364,387.59	2.10
50	603993	洛阳钼业	20,322,643.00	2.10
51	002138	顺络电子	20,161,290.18	2.08
52	002179	中航光电	20,028,949.14	2.07
53	002906	华阳集团	19,999,755.00	2.07
54	002594	比亚迪	19,906,714.00	2.06
55	600502	安徽建工	19,870,457.80	2.05
56	601872	招商轮船	19,869,032.68	2.05
57	688123	聚辰股份	19,811,004.74	2.05
58	603885	吉祥航空	19,764,931.90	2.04
59	601728	中国电信	19,680,186.00	2.03
60	300613	富瀚微	19,675,719.10	2.03
61	000983	山西焦煤	19,661,991.10	2.03
62	688301	奕瑞科技	19,646,240.49	2.03
63	688111	金山办公	19,606,790.88	2.03
64	601003	柳钢股份	19,605,774.00	2.03
65	300759	康龙化成	19,604,007.52	2.03
66	600325	华发股份	19,575,477.00	2.02
67	300058	蓝色光标	19,527,216.28	2.02
68	002458	益生股份	19,467,974.15	2.01
69	002475	立讯精密	19,389,935.96	2.00
70	002236	大华股份	19,382,906.55	2.00
71	688220	翱捷科技	19,367,890.35	2.00

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	600809	山西汾酒	75,753,004.80	7.83
2	600026	中远海能	48,392,717.56	5.00
3	000063	中兴通讯	48,167,063.84	4.98
4	600030	中信证券	46,485,681.80	4.80
5	002415	海康威视	42,906,180.00	4.43
6	600325	华发股份	42,546,259.95	4.40

7	002230	科大讯飞	42,046,131.96	4.34
8	601888	中国中免	41,741,331.44	4.31
9	002897	意华股份	41,109,877.28	4.25
10	688981	中芯国际	39,214,752.34	4.05
11	002371	北方华创	38,939,648.76	4.02
12	600702	舍得酒业	38,854,253.00	4.01
13	600027	华电国际	36,497,428.00	3.77
14	603019	中科曙光	32,004,081.73	3.31
15	000568	泸州老窖	31,755,986.00	3.28
16	300782	卓胜微	31,095,125.86	3.21
17	688120	华海清科	30,931,952.51	3.20
18	600559	老白干酒	30,532,251.93	3.15
19	603986	兆易创新	30,388,675.60	3.14
20	002050	三花智控	29,918,764.00	3.09
21	300957	贝泰妮	29,324,903.31	3.03
22	000977	浪潮信息	29,253,169.63	3.02
23	688167	炬光科技	28,808,469.51	2.98
24	000066	中国长城	28,001,142.22	2.89
25	002555	三七互娱	27,972,326.26	2.89
26	601155	新城控股	27,239,709.59	2.81
27	600258	首旅酒店	25,587,612.00	2.64
28	300058	蓝色光标	25,413,003.76	2.63
29	601728	中国电信	24,307,599.96	2.51
30	002299	圣农发展	24,127,183.57	2.49
31	300785	值得买	23,962,887.67	2.48
32	002049	紫光国微	23,635,938.20	2.44
33	002156	通富微电	23,628,897.00	2.44
34	688122	西部超导	23,575,280.42	2.44
35	002236	大华股份	23,521,473.10	2.43
36	600570	恒生电子	23,137,676.71	2.39
37	688297	中无人机	22,829,098.88	2.36
38	002463	沪电股份	22,754,322.40	2.35
39	600586	金晶科技	22,613,700.00	2.34
40	688376	美埃科技	22,582,212.88	2.33
41	002665	首航高科	22,575,144.00	2.33
42	600029	南方航空	22,448,488.00	2.32
43	300364	中文在线	22,437,877.00	2.32
44	300366	创意信息	22,409,425.76	2.32
45	001979	招商蛇口	22,202,206.00	2.29
46	300598	诚迈科技	22,187,293.50	2.29
47	688220	翱捷科技	22,031,919.85	2.28
48	002532	天山铝业	22,031,488.00	2.28
49	300613	富瀚微	21,968,576.10	2.27
50	600233	圆通速递	21,921,023.00	2.26

51	000776	广发证券	21,476,719.00	2.22
52	688111	金山办公	21,234,412.99	2.19
53	300003	乐普医疗	21,232,970.00	2.19
54	600028	中国石化	21,219,299.90	2.19
55	300223	北京君正	20,862,148.00	2.16
56	300548	博创科技	20,544,812.00	2.12
57	600502	安徽建工	20,400,487.00	2.11
58	000729	燕京啤酒	20,391,748.99	2.11
59	300759	康龙化成	20,350,690.71	2.10
60	300896	爱美客	20,263,700.00	2.09
61	300054	鼎龙股份	19,995,374.00	2.07
62	300115	长盈精密	19,928,142.00	2.06
63	600131	国网信通	19,828,746.40	2.05
64	300133	华策影视	19,806,688.00	2.05
65	603345	安井食品	19,596,068.00	2.02
66	300496	中科创达	19,462,562.00	2.01
67	603871	嘉友国际	19,372,043.79	2.00

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	2,820,247,173.43
卖出股票的收入（成交）总额	2,832,157,274.81

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

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。

**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 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**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**

无。

**7.11.2 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**

2023 年 1 月 31 日，长沙银行因未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，被中国人民银行长沙中心支行（长银罚决字〔2023〕1 号）给予罚款 80 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。

本报告期内，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，也没有在本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	764,683.12
2	应收清算款	4,669,984.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	273,135.45

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,707,802.91

#### 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。

### 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
华安安顺灵活配置混合 A	20,524	13,362.99	26,076,052.97	9.51%	248,185,981.32	90.49%
华安安顺灵活配置混合 C	43	41,817.50	1,766,799.54	98.26%	31,353.09	1.74%
合计	20,567	13,422.48	27,842,852.51	10.09%	248,217,334.41	89.91%

#### 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	华安安顺灵活配置混合 A	204,133.25	0.07%
	华安安顺灵活配置混合 C	0.28	0.00%
	合计	204,133.53	0.07%

#### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人	华安安顺灵活配置混合 A	-

持有本开放式基金	华安安顺灵活配置混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开 放式基金	华安安顺灵活配置混合 A	0~10
	华安安顺灵活配置混合 C	-
	合计	0~10

注：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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安安顺灵活配置混合 A	华安安顺灵活配置混合 C
基金合同生效日（2014 年 5 月 12 日）基金份额总额	3,000,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	288,884,878.16	3,036.15
本报告期基金总申购份额	3,542,871.33	1,880,311.07
减：本报告期基金总赎回份额	18,165,715.20	85,194.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	274,262,034.29	1,798,152.63

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## 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：

无。

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 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。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理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及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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	
中信建投	2	2,078,676,046.37	36.84%	1,935,873.86	36.84%	-
海通证券	1	1,839,276,080.01	32.60%	1,712,913.88	32.60%	-
国泰君安证券	1	912,818,227.18	16.18%	850,098.10	16.18%	-
东方证券	2	811,927,512.65	14.39%	756,151.29	14.39%	-
高盛(中国)证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信证券	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：

无。

**10.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 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	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023-01-20
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（亿道信息）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-03
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（多利科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-02-17
4	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（宿迁联盛）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-15
5	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
6	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金 2023 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	2023-04-21
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（友车科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-05
8	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(中科飞测)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-13
9	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29
10	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金(华安安顺灵活配置混合 A)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29
11	华安安顺灵活配置混合型证券投资基金(华安安顺灵活配置混合 C)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-05-29

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、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金合同》
- 2、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安顺灵活配置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  
二〇二三年八月三十日