

华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

2023年第3季度报告

2023年9月30日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF） |
| 基金主代码 | 013254 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 298,913,380.36 份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金通过严谨的资产配置策略与证券投资基金精选策略，在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产持续稳定增值。</p> <p>本基金为目标风险策略基金，在大类资产配置层面将严格遵循纪律化、自上而下的决策流程，采用战略型资产配置和战术型资产配置相结合的大类资产配置策略。</p> |

| | | |
|-----------------|--|---------------------------|
| | <p>本基金的战略型大类资产配置目标比例将遵循基金合同的约定，即权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金（仅指最近连续四个季度披露的基金定期报告中显示股票投资比例高于基金资产的60%或在基金合同中明确约定基金资产60%以上投资于股票的混合型基金），下同）的战略配置中枢比例为20%。</p> <p>基金管理人将综合考虑各项宏观经济基本面指标、各子类资产的历史估值水平及波动率变化等多种因素，紧密跟踪研究各类资产的风险收益特征，构建战术型大类资产配置框架，在基金合同约定的范围内对各时间段内的大类资产配置比例进行动态调整。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×80% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金及货币市场型基金中基金、低于股票型基金中基金。 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）A | 华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码 | 013254 | 017348 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 294,557,531.74份 | 4,355,848.62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 | <p>报告期</p> <p>(2023年7月1日-2023年9月30日)</p> |
|--------|--|

| | 华安优享稳健养老目标 一年持有混合发起式 (FOF) A | 华安优享稳健养老目标 一年持有混合发起式 (FOF) Y |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -2,312,676.54 | -29,901.21 |
| 2.本期利润 | -4,917,669.42 | -66,674.22 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0156 | -0.0156 |
| 4.期末基金资产净值 | 287,521,018.89 | 4,262,846.07 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9761 | 0.9786 |

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、华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）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 | -1.63% | 0.17% | -0.32% | 0.17% | -1.31% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.98% | 0.17% | 0.03% | 0.16% | -2.01% | 0.01% |
| 过去一年 | -1.94% | 0.16% | 2.17% | 0.18% | -4.11% | -0.02% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | -2.39% | 0.14% | 0.99% | 0.22% | -3.38% | -0.08% |

2、华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式（FOF）Y：

| 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 | -1.56% | 0.17% | -0.32% | 0.17% | -1.24% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.83% | 0.17% | 0.03% | 0.16% | -1.86% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -0.76% | 0.15% | 2.20% | 0.16% | -2.96% | -0.01% |

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

华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

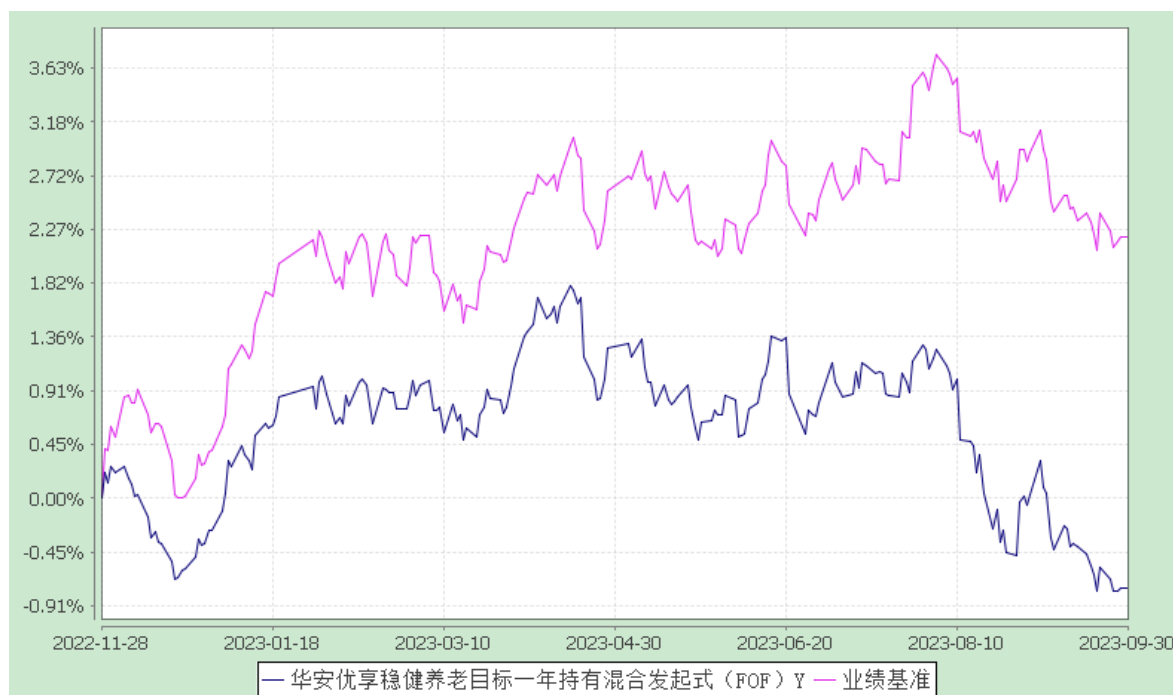
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 12 月 7 日至 2023 年 9 月 30 日)

1. 华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式 (FOF) A:



2. 华安优享稳健养老目标一年持有混合发起式 (FOF) Y:



注：本基金自 2022 年 11 月 16 日起增设 Y 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 | | |
| 杨志远 | 本基金的基金经理、基金组合投资部助理总监 | 2021-12-07 | - | 12 年 | 硕士研究生，12 年证券、基金行业从业经验。曾任上海证券有限责任公司研究员、东海基金管理有限公司产品经理、中银基金管理有限公司高级产品经理。2016 年 8 月加入华安基金，现任基金组合投资部基金经理。2019 年 4 月至 2022 年 1 月，担任华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的基金经理。2019 年 11 月起，同时担任华安稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)的基金经理。2020 年 12 月至 2022 年 1 月，同 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|--|
| | | | | | <p>时担任华安平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 5 月起，同时担任华安养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 10 月起，同时担任华安慧萃组合精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、华安民享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 3 月起，同时担任华安盈安稳健优选 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 5 月起，同时担任华安盈瑞稳健优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。</p> |
| 袁冠群 | 本基金的基金经理 | 2021-12-07 | - | 13 年 | <p>硕士研究生，13 年证券、基金行业从业经验，历任上海证券有限责任公司投资经理、上海尚湖投资管理有限公司量化投资经理、太平洋资产管理有限责任公司投资经理。2021 年 1 月加入华安基金，2021 年 10 月起，担任华安慧萃组合精选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、华安民享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 2 月起，同时担任华安慧心楚选配置三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。2023 年 4 月起，同时担任华安锐进积极配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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 0 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

三季度国内 PMI 环比连续回升至 50.2，CPI 7 月触底回升，CPI-PPI 剪刀差有所收窄。社融增速先降后升，政府债券同比显著多增。为稳定市场预期，保持流动性合理充裕，支持经济在年内更好地修复，央行 9 月下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点。7 月美联储加息 25bp，9 月议息会议暂停加息，自 2022 年 7 月以来第二次暂停加息，未来美联储将更多权衡加息过多及加息不足可能导致的风险。

三季度 A 股市场低迷，中小创跌幅较大。上证指数下跌 2.86%，沪深 300 下跌 3.98%，创业板指下跌 9.53%，科创 50 下跌 10.21%。结构来看，三季度多个行业跌幅明显，其中电力设备、传媒、计算机跌幅居前，分别下跌 15.68%、15.58%、11.71%；小部分行业上涨，非银金融、煤炭涨幅居前，分别为 5.62%、5.26%。债券市场方面，三季度 10 年期国债收益率低位窄幅震荡，波动区间为 2.54%至 2.70%。信用债三季度总体走势和国债类似，信用利差普遍压缩，收益率、信用利差于 8 月下旬小幅回升。

报告期内，管理人积极优化资产配置结构，本基金权益配置比例略低于中枢水平。纯债部分资产以中短久期信用债为主，8 月波动期间小幅减仓转向现金管理。固收+部分配置基金多为风险性价比较好的品种，贡献了一定的超额收益。权益资产配置风格相对均衡，更多的在基金品种上

进行调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年9月30日,本基金A类份额净值为0.9761元,本报告期份额净值增长率为-1.63%;本基金Y类份额净值为0.9786元,本报告期份额净值增长率为-1.56%,同期业绩比较基准增长率为-0.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观环境来看,目前市场仍对经济处于“弱现实”定价。7月政治局会议后,稳增长预期略有强化,政府与各部委针对地产政策调控、活跃资本市场、支持民营经济等方面落地相关政策,权益市场风险偏好有所修复,但因基本面好转为慢变量,权益市场博弈思维仍然较重。8月国内宏观数据呈现见底回升迹象,价格指数及生产较好,需求有待企稳。居民消费信心不足,货币政策预计将持续为经济复苏护航。海外来看,美联储加息仍未见止,美国经济数据环比向上、通胀水平略有缓解,整体呈现较好的复苏态势。目前受制于美债收益率超预期上行,资金外流明显。市场对于后续政策的持续性存疑,权益市场成交寡淡,关注点依旧聚焦在活跃资本市场、地方债务、稳增长等方面。

在目前的估值水平下,权益市场仍有结构性机会,顺周期底部修复及优质成长均有良好的布局窗口。在中美货币政策相向而行的阶段,我们布局了部分黄金等资产,对组合形成一定的保护效果。国内债券收益率曲线仍较为平缓,中短久期基金性价比较高,需跟踪资金面情况进行跟踪,组合将随收益率上行久期相机抉择。信用分化将持续,需防范信用风险。

“稳中求进”仍是我们未来投资操作的主旋律,组合层面,我们仍将保持多元化、分散化的配置,为短期波动做好防御准备。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式证券投资基金。

§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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 250,356,281.78 | 85.12 |
| 3 | 固定收益投资 | 15,422,861.10 | 5.24 |
| | 其中：债券 | 15,422,861.10 | 5.24 |
| | 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 | -16,477.50 | -0.01 |
| | 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 | 4,765,196.13 | 1.62 |
| 8 | 其他各项资产 | 23,607,001.01 | 8.03 |
| 9 | 合计 | 294,134,862.52 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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 | 15,422,861.10 | 5.29 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 15,422,861.10 | 5.29 |

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 | 019703 | 23 国债 10 | 153,000 | 15,422,861.10 | 5.29 |

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

无。

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

5.11.1 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。

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 | 67,965.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | 23,529,856.57 |
| 3 | 应收股利 | 273.43 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 6,568.11 |
| 6 | 其他应收款 | 2,337.36 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,607,001.01 |

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------------|------|---------------|---------------|-----------|------------------------|
| 1 | 040040 | 华安纯债债券 A | 开放式 | 27,592,818.89 | 29,455,334.17 | 10.09% | 是 |
| 2 | 003280 | 鹏华丰恒债券 | 开放式 | 25,801,111.91 | 28,388,963.43 | 9.73% | 否 |
| 3 | 003847 | 华安鼎丰债券发起式 A | 开放式 | 24,899,807.85 | 27,982,404.06 | 9.59% | 是 |
| 4 | 000191 | 富国信用债债券 A | 开放式 | 15,531,063.83 | 19,312,877.87 | 6.62% | 否 |
| 5 | 040026 | 华安信用四季红债券 A | 开放式 | 16,857,062.32 | 17,662,829.90 | 6.05% | 是 |
| 6 | 519137 | 海富通瑞福债券 A | 开放式 | 12,456,224.47 | 13,756,654.30 | 4.71% | 否 |
| 7 | 010435 | 富国双债增强债券 A | 开放式 | 11,173,751.15 | 11,552,541.31 | 3.96% | 否 |
| 8 | 100050 | 富国全球债券(QDII)人民币 A | 开放式 | 8,870,962.62 | 11,145,477.44 | 3.82% | 否 |
| 9 | 005709 | 华安鼎益债券 A | 开放式 | 9,409,993.41 | 10,279,476.80 | 3.52% | 是 |
| 10 | 511360 | 海富通中证短融 ETF | 开放式 | 57,200.00 | 6,177,542.80 | 2.12% | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费 | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 60,793.50 | 40,500.29 |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 47,036.76 | 6,601.65 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 370,336.23 | 101,759.42 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 85,680.30 | 27,555.04 |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | 4,970.45 | 121.07 |

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安优享稳健养老目标 一年持有混合发起式 (FOF) A | 华安优享稳健养老目标 一年持有混合发起式 (FOF) Y |
|----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 340,152,995.91 | 4,193,588.69 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 36,832.46 | 162,259.93 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 45,632,296.63 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 294,557,531.74 | 4,355,848.62 |

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 华安优享稳健养老目标一 年持有混合发起式 (FOF) A | 华安优享稳健养老目标一 年持有混合发起式 (FOF) Y |
|-------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基 金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基 金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例 (%) | 3.35 | - |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额 总数 | 持有份额占 基金总份额 比例 | 发起份额 总数 | 发起份额占 基金总份额 比例 | 发起份额承诺 持有期限 |
|-------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,00 0.00 | 3.35% | 10,000,00 0.00 | 3.35% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,00 0.00 | 3.35% | 10,000,00 0.00 | 3.35% | - |

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- 2、《华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》
- 3、《华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所和基金托管人住所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

11.3 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住所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二三年十月二十四日