

华安添悦 6 个月持有期混合型证券投资基金
2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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 2024 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安添悦 6 个月持有混合
基金主代码	016821
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 20 日
报告期末基金份额总额	117,460,255.86 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 2、债券投资策略 3、股票投资策略 4、存托凭证投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、参与融资业务投资策略
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+中证 800 指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×5%
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。本基金若投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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	华安添悦 6 个月持有混合 A	华安添悦 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	016821	016822
报告期末下属分级基金的份额总额	114,855,849.71 份	2,604,406.15 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	华安添悦 6 个月持有混合 A	华安添悦 6 个月持有混合 C
1. 本期已实现收益	-1,236,826.06	-49,334.67
2. 本期利润	-678,033.52	-18,958.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0027	-0.0033
4. 期末基金资产净值	113,801,964.13	2,575,127.51
5. 期末基金份额净值	0.9908	0.9888

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、本基金于 2023 年 6 月 20 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

华安添悦 6 个月持有混合 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	0.07%	0.15%	-0.63%	0.16%	0.70%	-0.01%
过去六个月	-1.00%	0.13%	-1.48%	0.17%	0.48%	-0.04%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-0.92%	0.12%	-1.85%	0.17%	0.93%	-0.05%

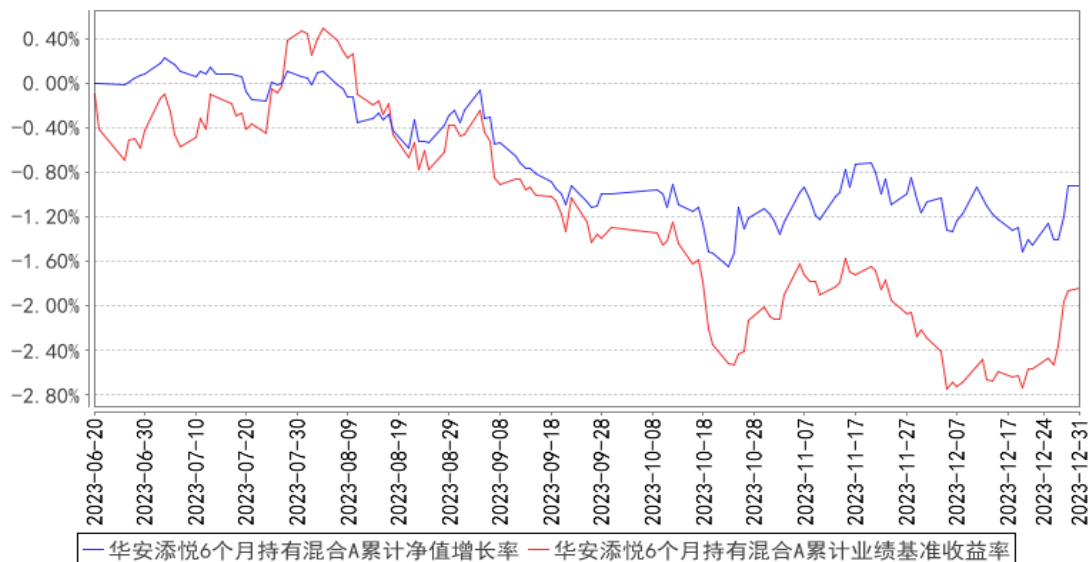
华安添悦6个月持有混合C

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	-0.02%	0.15%	-0.63%	0.16%	0.61%	-0.01%
过去六个月	-1.19%	0.13%	-1.48%	0.17%	0.29%	-0.04%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-1.12%	0.12%	-1.85%	0.17%	0.73%	-0.05%

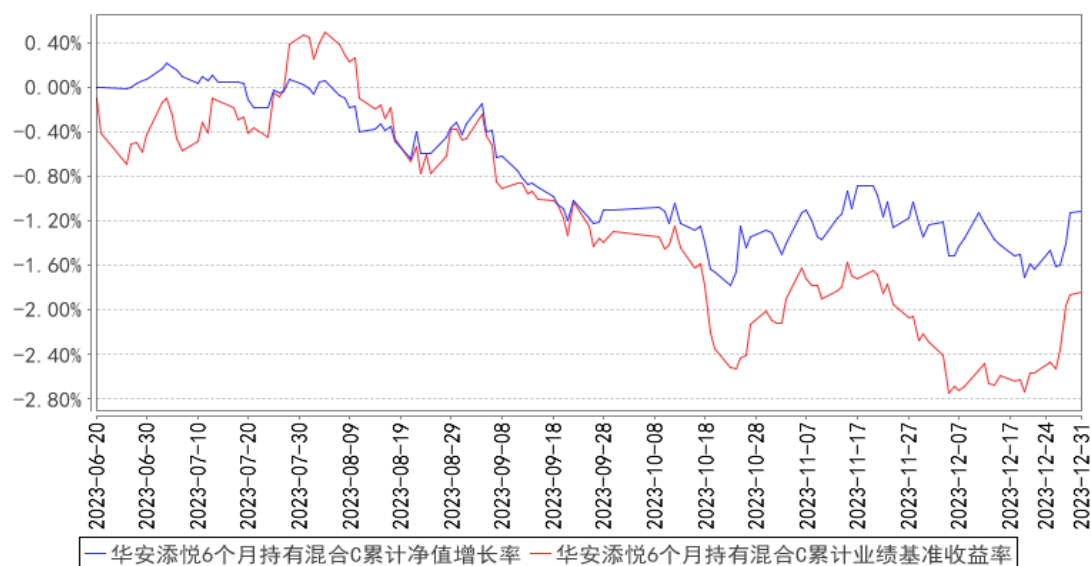
注：本基金于2023年06月20日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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

华安添悦6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华安添悦6个月持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金于2023年06月20日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

§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		
石雨欣	本基金的基金经理	2023年6月20日	-	17年	硕士研究生，17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，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月至2021年3月，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的基金经理。2016年12月至2022年12月，同时担任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

				<p>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月至2023年2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。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。2023年5月起，同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2023年6月起，同时担任华安添悦6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p>
舒灏	本基金的基金经理	2023年6月20日	-	<p>15年</p> <p>硕士研究生，15年证券、基金行业从业经验。曾任海通证券股份有限公司研究员。2011年6月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018年7月至2019年6月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019年6月至2022年3月，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。2018年11月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年12月起，同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年1月至2023年7月，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年9月至2021年6月，同时担任华安安利混合型证券投资基金的基金经理。2021年6月起，同时担任华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021年8月至2023年1月，同时担任华安添禧灵活配置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。2023年6月起，同时担任华安添悦6个月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。

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 1 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年初市场在地产政策边际放松，疫情政策优化的背景下，A 股经历了快速上涨，2 月以后，各大指数陆续开始回调，上证指数于 5 月 9 日达到高点后开始回调，其他创业板、沪深 300 等指数 2 月开始回调，这一轮调整原因，我们认为有两点：一是海外经济扰动，美元持续加息引发市场对金融风险的担忧；二是二季度以来经济平稳复苏，市场对国内经济复苏持续性持观望态度。从行情结构看，上半年市场热点主要在科技板块和“中特估”相关行业。在 ChatCPT 为代表的人工智能概念持续上涨。在一带一路、中国特色估值体系概念催化下，相关央企也有一轮持续性上涨。二季度以来市场调整，总体缺乏亮点，市场以轮动为主。本基金 2023 年四季度整体维持了中性仓位，均衡配置，仓位分散在科技、消费、能源、制造业等板块。

债券方面，四季度货币政策继续保持稳健，央行在公开市场不断加大逆回购以及 MLF 的投放量，但由于地方债和国债进入发行高峰期，资金利率震荡上行，带动债券收益率出现波动。临近年底资金面逐步恢复宽松，12 月下旬多家商业银行宣布下调存款利率，进一步推动债券收益率普遍快速回落，期内中债综合全价(总值)指数上涨 0.82%。转债市场由于估值普遍偏高且权益市场偏弱，期内转债表现相对偏弱。四季度债券部分以配置高等级信用债为主，灵活调整组合久期，阶段性参与利率债和商金债的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 0.9908 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 0.07%，本基金 C 类份额净值为 0.9888 元，本报告期 C 类份额净值增长率为-0.02%，同期业绩比较基准增长率为-0.63%。

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	17,587,509.27	14.94
	其中：股票	17,587,509.27	14.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	92,667,473.34	78.72
	其中：债券	92,667,473.34	78.72
	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	7,415,195.24	6.30
8	其他资产	44,525.99	0.04
9	合计	117,714,703.84	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	-	-
C	制造业	14,737,548.63	12.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,590,903.64	1.37
J	金融业	646,816.00	0.56
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	-	-
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	612,241.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	17,587,509.27	15.11

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	002698	博实股份	94,700	1,438,493.00	1.24
2	002859	洁美科技	54,300	1,354,785.00	1.16
3	605333	沪光股份	66,500	1,323,350.00	1.14
4	603236	移远通信	21,500	1,155,625.00	0.99
5	002179	中航光电	25,800	1,006,200.00	0.86
6	000039	中集集团	108,550	830,407.50	0.71
7	300308	中际旭创	6,600	745,206.00	0.64
8	300114	中航电测	15,800	691,250.00	0.59
9	002531	天顺风能	59,300	687,880.00	0.59
10	300733	西菱动力	56,900	685,076.00	0.59

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	92,667,473.34	79.63
	其中:政策性金融债	51,213,541.10	44.01
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	92,667,473.34	79.63

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	230203	23 国开 03	200,000	20,733,041.10	17.82
2	230208	23 国开 08	200,000	20,348,327.87	17.48
3	2128022	21 交通银行永续债	100,000	10,508,923.50	9.03
4	2028042	20 兴业银行永续债	100,000	10,430,642.62	8.96
5	2028023	20 招商银行永续债 01	100,000	10,357,956.28	8.90

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

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

无。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2023 年 11 月 27 日，招商银行因办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事项，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2023〕42 号）没收违法所得人民币 89.03 万元，罚款人民币 475 万元。2023 年 12 月 13 日，招商银行因未按规定承担小微企业押品评估费等违法违规事项，被国家金融监督管理总局深圳监管局（深金罚决字〔2023〕81 号）罚款 160 万元。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	44,525.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	44,525.99

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安添悦 6 个月持有混合 A	华安添悦 6 个月持有混合 C
报告期期初基金份额总额	263,313,427.26	6,046,653.07
报告期期间基金总申购份额	14,670.25	2,543.56
减:报告期期间基金总赎回份额	148,472,247.80	3,444,790.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	114,855,849.71	2,604,406.15

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20231001~20231231	80,022,111.11	0.00	40,011,000.00	40,011,111.11	34.06
	2	20231221~20231231	29,999,000.00	0.00	0.00	29,999,000.00	25.54
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 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

9.3 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

2024 年 1 月 19 日