

# 华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	1,232,705,753.80 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>1,011,739,789.23 份</p>	<p>220,965,964.57 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 7 月 1 日-2023 年 9 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	4,399,158.98	299,624.10
2.本期利润	-17,749,263.55	775,317.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0162	0.0071
4.期末基金资产净值	1,026,655,801.39	223,384,862.67

5.期末基金份额净值	1.0147	1.0109
------------	--------	--------

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	-1.42%	1.25%	-2.35%	0.53%	0.93%	0.72%
过去六个月	-5.70%	1.17%	-4.96%	0.51%	-0.74%	0.66%
过去一年	-3.55%	1.09%	-1.36%	0.58%	-2.19%	0.51%
过去三年	-6.15%	0.70%	-9.71%	0.68%	3.56%	0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	22.02%	0.66%	16.00%	0.73%	6.02%	-0.07%

##### 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	-1.51%	1.25%	-2.35%	0.53%	0.84%	0.72%
过去六个月	-5.89%	1.17%	-4.96%	0.51%	-0.93%	0.66%
过去一年	-3.92%	1.09%	-1.36%	0.58%	-2.56%	0.51%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-8.70%	1.03%	-7.28%	0.58%	-1.42%	0.45%

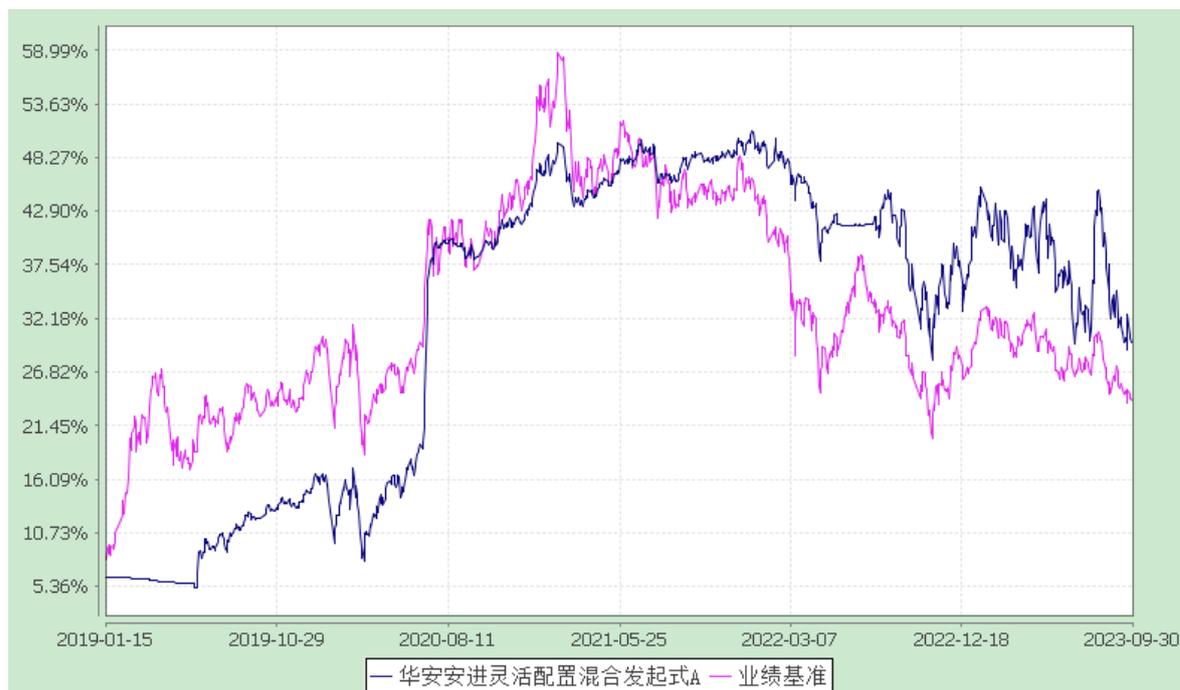
注：华安安进灵活配置混合发起式证券投资基金自2022年7月21日起新增C类份额。

#### 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

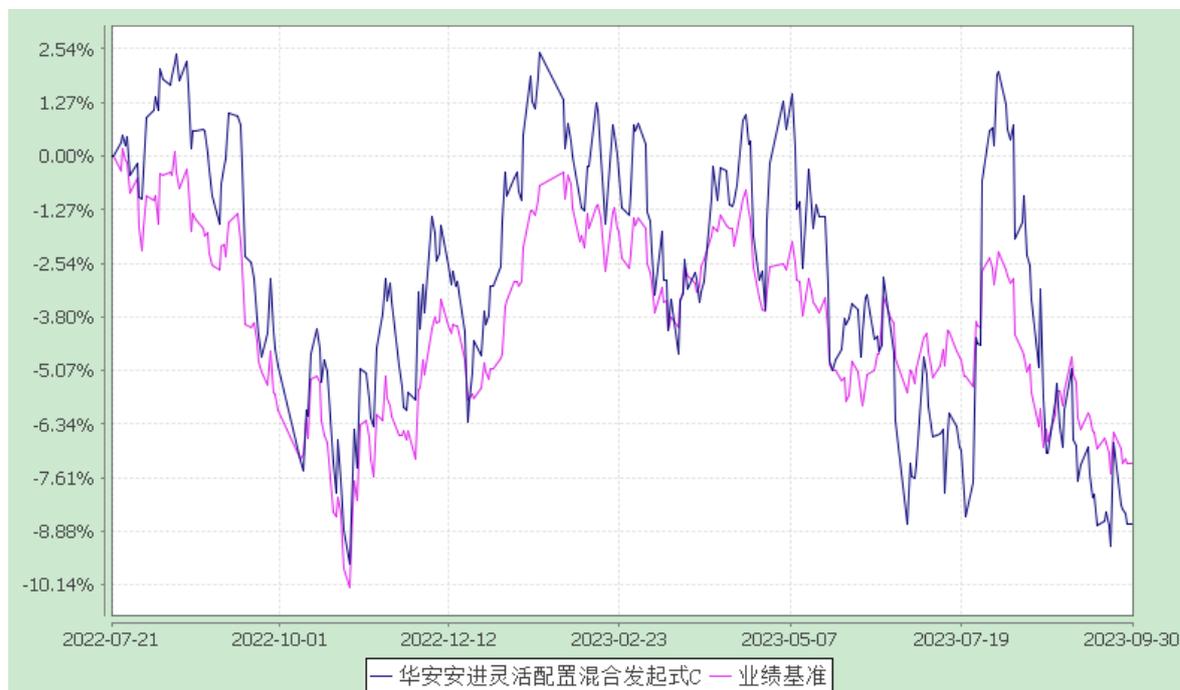
华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 1 月 15 日至 2023 年 9 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	-	26 年	<p>硕士研究生，26 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>

					<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	-	17 年	<p>硕士研究生,17 年金融基金行业从业经验,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 年 9</p>

					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。2023 年 8 月起，同时担任华安红利精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 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

今年第三季度的 A 股市场整体波动较大，风格分化也比较明显。从市场主要指数的表现来看，代表白马风格的上证 50 和沪深 300 三季度分别微涨 0.6% 和下跌-3.98%，代表赛道风格的创业板指三季度下跌-9.53%，代表科技风格的科创 50 指数三季度下跌-11.67%。

本基金在三季度没有过多操作，虽然所重仓配置的一些板块在报告期内一度有明显涨幅，但是我们还是没有选择兑现收益，主要还是考虑到这些板块都是处于基本面和估值的最底部，短期的涨幅还是明显低于买入时的预期收益，因此选择了坚守持仓。在季度末，开始逐渐进行持仓的

调整，主要减持了之前所持有的信创板块，增加了一些上游资源品板块，这一调整主要出于对经济复苏的信心在增强，希望更多配置一些受益于经济的顺周期板块的原因。上游周期品板块目前处于供需紧平衡、库存低、短期产能受限的状态，一旦需求恢复价格弹性非常可观，当前的配置性价比还是非常高的。

#### 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 1.0147 元，本报告期份额净值增长率为-1.42%，同期业绩比较基准增长率为-2.35%；本基金 C 类份额净值为 1.0109 元，本报告期份额净值增长率为-1.51%，同期业绩比较基准增长率为-2.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为当前正处于需求侧改善的验证期，对于四季度 A 股市场的表现我们维持乐观。

三季度开始我们已经开始观察到需求端的改善，这将带动企业盈利在三季度出现改善。在房地产政策的持续优化下，9 月份以来，30 大中城市商品房成交面积的同比负增速明显收窄，同时，一线城市的供应土地占地面积从 8 月份开始也持续环比正增长；PMI 自 7 月份出现拐头向上之后，8 月、9 月持续改善，9 月份已经回到荣枯线 50 之上，新订单 PMI 在 8 月份率先回到 50 之上，显示了需求重回扩张区间；8 月的工业企业产成品库存也在 PPI 触底回升的拉动下出现了今年以来的首次回升，同时，8 月的工业企业利润总额也实现了自去年 6 月以来的首次转正，在需求改善的背景下企业经营开始回暖也有利于进一步提示企业的投资动力。根据工业企业利润与上市公司盈利的相关性判断，今年三季度有可能将成为年内公司盈利的转折点，这也是支撑市场走好的最关键的一个因素。

从利率的角度可以看到，自 8 月底以来，10 年期国债收益率已经从 2.55 左右回升至目前的 2.7 左右。我们在之前的季报中所判断的利率回升的场景已经开始兑现，目前来看我们认为这一过程仍将持续，利率的上行过程还没有结束。

经济复苏、利率回升的大环境仍将维持，因此，我们对于未来市场风格的判断也没有变化，依然看好以低估值蓝筹未代表的大盘价值股。我们之前在这个方向上已经有了比较充分的关注，如金融、船舶等板块，未来将增加几个重点关注的方向，主要集中在上中游的资源品板块上。当前一些主要工业品的供需都处在一个紧平衡的状态，体现为在去年 4 季度和今年 2 季度需求最差的时期，商品价格均有明显支撑，同时他们的库存水平也都处于历史较低的位置，如果未来需求开始出现边际改善，这些工业品的价格弹性将会是巨大的，进而也将为上市公司带来可观的利润贡献，未来我们要做的就是密切跟踪需求的恢复和这些商品的供需变化，并发掘出板块中最受益

的公司。

#### 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	1,061,351,420.08	80.27
	其中：股票	1,061,351,420.08	80.27
2	固定收益投资	167,275,804.20	12.65
	其中：债券	167,275,804.20	12.65
	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	67,280,017.00	5.09
7	其他各项资产	26,334,208.99	1.99
8	合计	1,322,241,450.27	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	6,234,724.95	0.50
C	制造业	161,721,221.57	12.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	213,640,510.29	17.09
F	批发和零售业	64,419.30	0.01
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	59,337,142.90	4.75
J	金融业	620,343,098.32	49.63
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	10,302.75	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,061,351,420.08	84.91

### 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	2,761,524	100,132,860.24	8.01
2	601319	中国人保	15,855,700	93,548,630.00	7.48
3	601318	中国平安	1,701,460	82,180,518.00	6.57
4	601668	中国建筑	14,363,300	79,429,049.00	6.35
5	600030	中信证券	3,204,400	69,407,304.00	5.55
6	601288	农业银行	17,914,900	64,493,640.00	5.16
7	601995	中金公司	1,688,098	63,236,151.08	5.06
8	688318	财富趋势	415,730	59,337,142.90	4.75
9	601390	中国中铁	7,277,000	49,629,140.00	3.97
10	600150	中国船舶	1,762,000	49,159,800.00	3.93

#### 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	14,598,183.45	1.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	152,677,620.75	12.21
	其中：政策性金融债	50,905,438.36	4.07
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	167,275,804.20	13.38

#### 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	50,905,438.36	4.07
2	232280012	22 广州银行二级资本债 01	300,000	31,899,657.53	2.55
3	232380033	23 成都银行二级资本债 01	200,000	19,701,650.27	1.58
4	019694	23 国债 01	144,000	14,598,183.45	1.17
5	137957	22 中泰 Y1	100,000	10,154,101.92	0.81

#### 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

5.11.1 2023 年 8 月 15 日，农业银行因农户贷款发放后流入房地产企业、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位等违法违规行为，被国家金融监督管理总局（金罚决字〔2023〕8 号）没收违法所得并处罚款合计 4420.184584 万元，其中，对总行罚款 1760.092292 万元，没收违法所得 60.092292 万元，对分支机构罚款 2600 万元。

2023 年 8 月 23 日，广州银行因违反金融统计业务管理规定、违反支付结算管理规定等违法违规事项，被中国人民银行广东省分行（广东银罚决字（2023）1 号）给予警告，并处罚款人民币 896.9 万元的行政处罚。

2022 年 12 月 13 日，成都银行因违规发放土地储备贷款、违规置换他行贷款、贷款风险分类不准确、违规向不符合信贷条件的项目承接主体授信，严重违反审慎经营规则，被中国银行保险监督管理委员会四川监管局（川银保监罚决字（2022）95 号）给予罚款人民币 650 万元的行政处罚。

2022 年 11 月 11 日，重庆农商行因审查审批不尽职，超需求发放流动资金贷款形成风险，掩盖不良贷款等违法违规事项，被中国银保监会重庆监管局（渝银保监罚决字（2022）44 号）给予罚款共计 1285 万元的行政处罚。

2023 年 8 月 7 日，厦门国际银行因办理企业资本金结汇业务违规、2020 年部分未结清内保外贷业务违规，被国家外汇管理局厦门市分局（厦门汇检罚（2023）2 号）给予警告，合计处罚款 644.30 万元人民币，没收违法所得 194.00 万元人民币的行政处罚。2023 年 9 月 20 日，厦门国际银行因发行收益与实际承担风险不相匹配的结构性存款、贷款风险分类不准确、个别贷款“三查”不到位、个人经营性贷款内控不到位，被国家金融监督管理总局厦门监管局（厦金罚决字（2023）6 号）给予罚款 220 万元的行政处罚。

2023 年 2 月 7 日，湖南银行因信用卡系统安全管理不到位、员工异常行为排查不到位，被中国银行保险监督管理委员会湖南监管局（湘银保监罚决字(2023)32 号）给予合计罚款 70 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	504,455.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,829,753.56

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,334,208.99

#### 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

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	1,095,736,501.49	253,509,469.13
报告期期间基金总申购份额	14,697,289.77	132,510,458.56
减：报告期期间基金总赎回份额	98,694,002.03	165,053,963.12
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,011,739,789.23	220,965,964.57

### §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本基 金份额	0.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-

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	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	-

### §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	20230701-20230930	361,860,284.81	0.00	0.00	361,860,284.81	29.35%
	2	20230701-20230930	621,591,263.38	0.00	98,619,330.00	522,971,933.38	42.42%
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  
二〇二三年十月二十四日