

华安精致生活混合型证券投资基金 2023 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 27 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。本年度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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63

8.3 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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 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	71
8.7 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	71
8.8 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	71
8.9 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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.3 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情况	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
11.2 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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
§ 13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安精致生活混合型证券投资基金	
基金简称	华安精致生活混合	
基金主代码	011128	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年3月9日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,304,767,740.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
下属分级基金的交易代码	011128	011129
报告期末下属分级基金的份额总额	1,780,909,819.67份	523,857,921.03份

2.2 基金产品说明

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、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、参与融资业务投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×15%+中债综合全价指数收益率×20%
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低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金将投资港股通标的股票，需承担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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨牧云	许俊
	联系电话	021-38969999	010-66596688
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566

传真	021-68863414	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	朱学华	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
本期已实现收益	- 129,302,211.60	- 45,204,477.18	- 55,952,644.16	- 32,461,580.01	1,091,283,942.61	189,290,687.93
本期利润	- 164,250,363.11	- 41,613,720.64	- 344,940,523.60	- 99,291,668.02	1,462,102,491.98	102,700,219.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0811	-0.0578	-0.1531	-0.1103	0.3493	0.1783

本期加权平均净值利润率	-6.67%	-4.79%	-12.19%	-8.89%	31.00%	14.67%
本期基金份额净值增长率	-7.56%	-8.12%	-11.77%	-12.28%	37.10%	36.43%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	210,465,403.60	52,103,732.52	471,950,588.12	215,819,603.41	786,460,463.82	237,991,116.58
期末可供分配基金份额利润	0.1182	0.0995	0.2097	0.1967	0.3710	0.3643
期末基金资产净值	1,991,375,223.27	575,961,653.55	2,722,174,309.10	1,313,046,488.19	2,906,469,110.04	891,206,345.79
期末基金份额净值	1.1182	1.0995	1.2097	1.1967	1.3710	1.3643
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	11.82%	9.95%	20.97%	19.67%	37.10%	36.43%

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

华安精致生活混合 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
过去三个月	-6.28%	0.68%	-4.99%	0.63%	-1.29%	0.05%

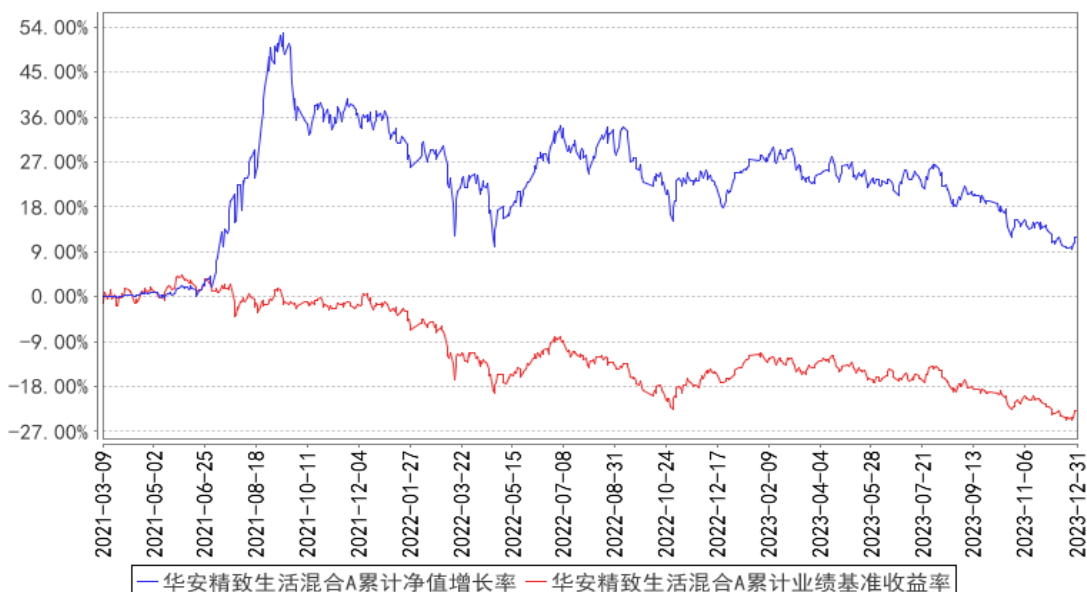
过去六个月	-9.27%	0.72%	-8.34%	0.67%	-0.93%	0.05%
过去一年	-7.56%	0.72%	-8.27%	0.66%	0.71%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	11.82%	1.13%	-22.80%	0.84%	34.62%	0.29%

华安精致生活混合 C

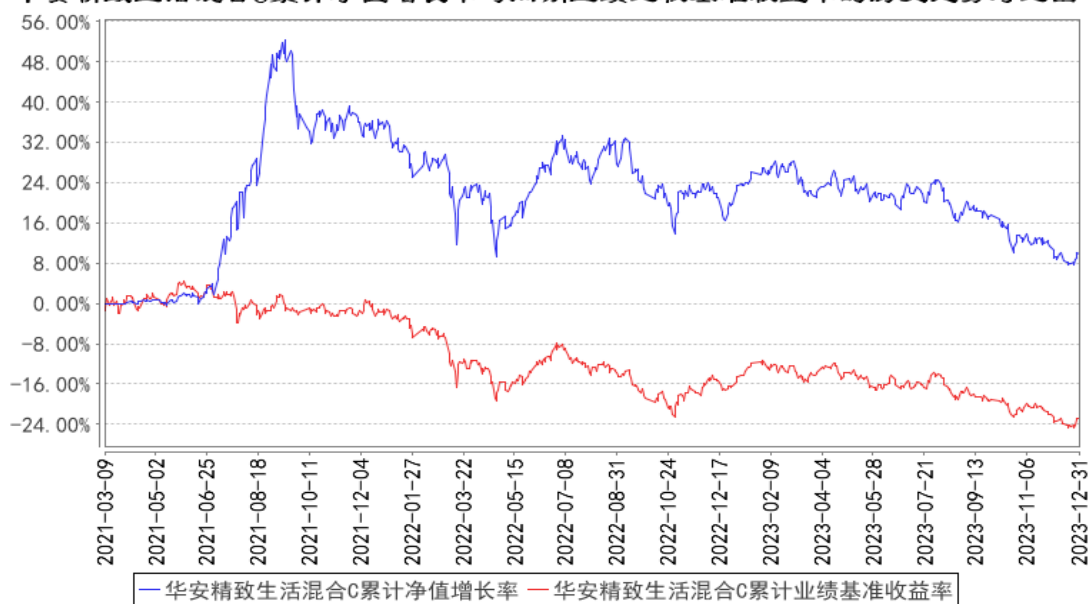
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.42%	0.68%	-4.99%	0.63%	-1.43%	0.05%
过去六个月	-9.54%	0.72%	-8.34%	0.67%	-1.20%	0.05%
过去一年	-8.12%	0.72%	-8.27%	0.66%	0.15%	0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.95%	1.13%	-22.80%	0.84%	32.75%	0.29%

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

华安精致生活混合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

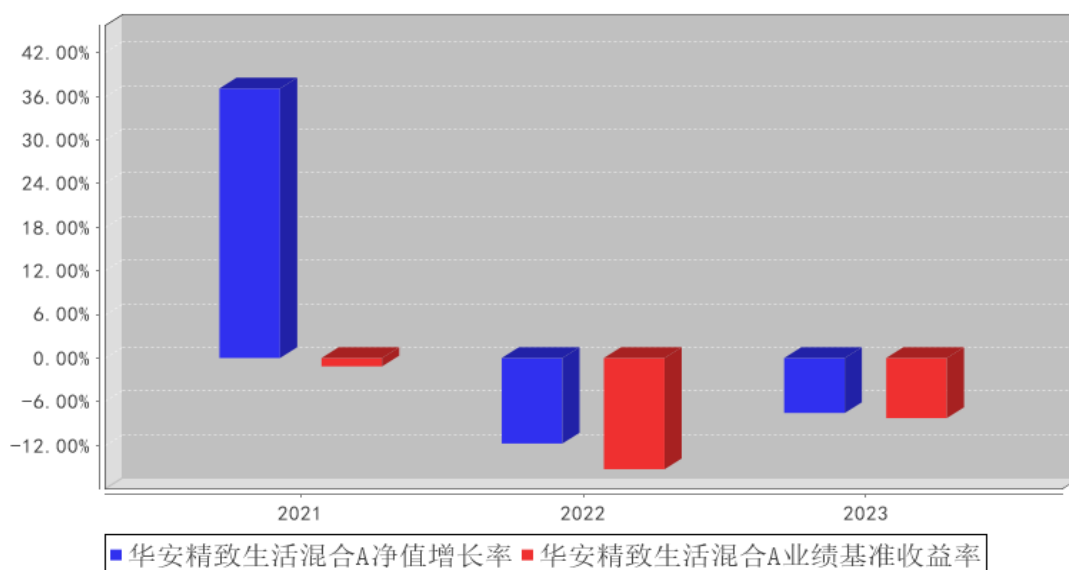


华安精致生活混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

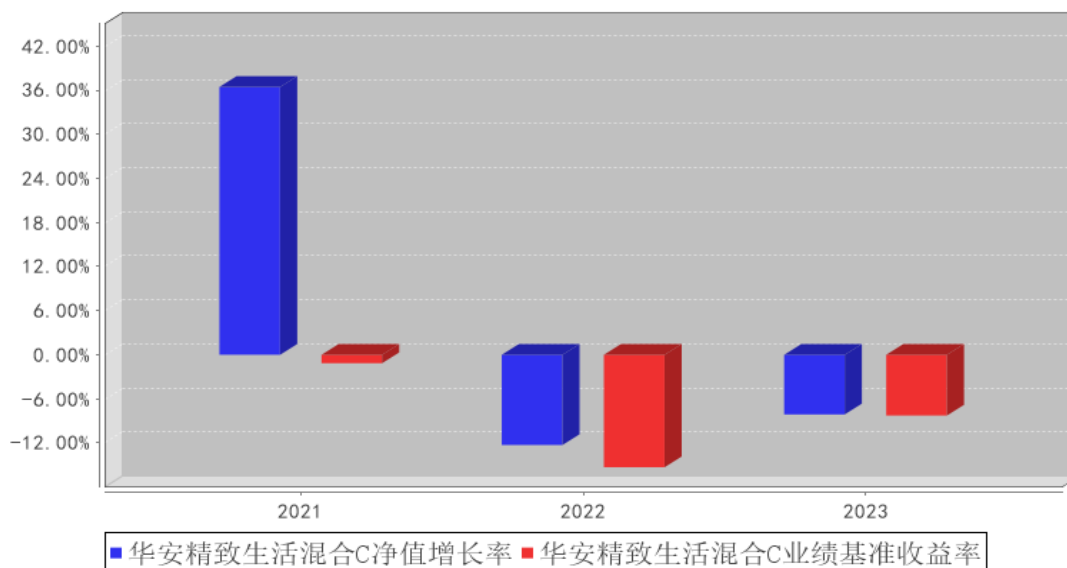


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安精致生活混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



华安精致生活混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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12月31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248只证券投资基金，管理资产规模达到6,040.77亿元人民币。

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		
王斌	本基金的基金经理	2021年3月9日	-	12年	硕士研究生，12年基金行业从业经验。2011年7月应届毕业生加入华安基金。历

					任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 10 月起，担任华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2022 年 1 月，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 3 月起，同时担任华安精致生活混合型证券投资基金、华安聚嘉精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月起，同时担任华安汇嘉精选混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安优嘉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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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 8 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，上证指数下跌 3.7%，沪深 300 指数下跌 11.38%，创业板综下跌 5.41%。行业方面，通信、传媒、计算机表现较好，商贸零售、房地产、电力设备表现较差。

2023 年，本基金主要抓住了公用事业、汽车、机械等行业的机会。

4.4.2 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 1.1182 元，本报告期份额净值增长率为-7.56%；本基金 C 类份额净值为 1.0995 元，本报告期份额净值增长率为-8.12%，同期业绩比较基准增长率为-8.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好结构性机会。

出口的韧性预期可能超出市场的预期。一方面海外部分国家的需求回落速度较慢，另一方面，国内的出口结构也在发生较大的优化。出口结构中，除了过去我们看到的轻工、纺织服装、家电等传统的品类保持一定的韧性之外，国内的高端制造业也展现了比过去更强的实力。2023 年汽车及汽车零部件、电池、工程机械、船舶等出口都有较好的表现。背后也是国内高端制造在全球具备更强竞争力的体现。从盈利的角度，部分出口海外的产品，其盈利能力较高，对企业的整体综合盈利能力带动较强。预期在未来一段时间行业还会保持这种特征。

红利策略是当前市场比较关注的一类策略。在关注这类策略时，我们应该避免“刻舟求剑”的状态，应避免静态地把股息率高低作为选行业和选公司主要依据的方法论。我们应该根据对行业和公司未来盈利的判断和分红比例的变化，动态地去筛选优质的高股息的公司。

最后，作为基金经理，我会秉着勤勉尽责的原则，为投资者带来更好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作：

在合规风控方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险基础。坚持全流程风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在内审稽核方面，定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提

升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、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。

4.8 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。

4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安精致生活混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21175 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安精致生活混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华安精致生活混合型证券投资基金(以下简称“华安精致生活基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华安精致生活基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安精致生活基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华安精致生活基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安精致生活基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安精致生活基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华安精致生活基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对导致对华安精致生活基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华安精致生活基金不能持续经营。</p>

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	楼茜蓉
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 22 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	219,960,851.78	571,210,243.14
结算备付金		6,989,909.20	3,602,048.47
存出保证金		301,803.59	400,579.15
交易性金融资产	7.4.7.2	2,350,331,623.86	3,524,858,407.74
其中：股票投资		2,349,599,575.73	3,524,858,407.74
基金投资		-	-
债券投资		732,048.13	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,302,385.63	-
应收股利		-	-
应收申购款		190,281.35	3,408,986.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		2, 581, 076, 855. 41	4, 103, 480, 264. 94
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		810, 495. 70	133. 99
应付赎回款		4, 091, 003. 10	55, 150, 214. 94
应付管理人报酬		2, 653, 906. 56	5, 266, 492. 36
应付托管费		442, 317. 78	877, 748. 73
应付销售服务费		297, 083. 40	690, 343. 20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1. 57	1. 45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7. 4. 7. 6	5, 445, 170. 48	6, 274, 532. 98
负债合计		13, 739, 978. 59	68, 259, 467. 65
净资产:			
实收基金	7. 4. 7. 7	2, 304, 767, 740. 70	3, 347, 450, 605. 76
其他综合收益		-	-
未分配利润	7. 4. 7. 8	262, 569, 136. 12	687, 770, 191. 53
净资产合计		2, 567, 336, 876. 82	4, 035, 220, 797. 29
负债和净资产总计		2, 581, 076, 855. 41	4, 103, 480, 264. 94

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2, 304, 767, 740. 70 份，其中华安精致生活混合 A 份额净值 1. 1182 元，基金份额总额 1, 780, 909, 819. 67 份；华安精致生活混合 C 份额净值 1. 0995 元，基金份额总额 523, 857, 921. 03 份。

7.2 利润表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-146, 728, 502. 70	-368, 314, 886. 26
1. 利息收入		1, 380, 503. 72	2, 213, 723. 55
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 9	1, 380, 503. 72	2, 213, 723. 55
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-116,991,530.34	-16,599,361.34
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-178,660,200.62	-90,878,257.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	2,920,061.63	2,069,970.47
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	58,748,608.65	72,208,925.35
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-31,357,394.97	-355,817,967.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	239,918.89	1,888,718.98
减：二、营业总支出		59,135,581.05	75,917,305.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	45,897,278.44	59,038,372.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,649,546.43	9,839,728.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,244,556.47	6,668,487.54
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		4.11	9.11
8. 其他费用	7.4.7.18	344,195.60	370,707.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-205,864,083.75	-444,232,191.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-205,864,083.75	-444,232,191.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-205,864,083.75	-444,232,191.62

7.3 净资产变动表

会计主体：华安精致生活混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,347,450,605.76	-	687,770,191.53	4,035,220,797.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,347,450,605.76	-	687,770,191.53	4,035,220,797.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,042,682,865.06	-	425,201,055.41	1,467,883,920.47
(一)、综合收益总额	-	-	205,864,083.75	-205,864,083.75
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,042,682,865.06	-	219,336,971.66	1,262,019,836.72
其中：1. 基金申购款	491,292,405.62	-	114,498,582.67	605,790,988.29
2. 基金赎回款	1,533,975,270.68	-	333,835,554.33	1,867,810,825.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,304,767,740.70	-	262,569,136.12	2,567,336,876.82
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,773,223,875.43	-	1,024,451,580.40	3,797,675,455.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,773,223,875.43	-	1,024,451,580.40	3,797,675,455.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	574,226,730.33	-	-336,681,388.87	237,545,341.46
(一)、综合收益总额	-	-	444,232,191.62	-444,232,191.62
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	574,226,730.33	-	107,550,802.75	681,777,533.08
其中：1. 基金申购款	2,460,191,469.98	-	584,994,618.12	3,045,186,088.10
2. 基金赎回款	-1,885,964,739.65	-	-477,443,815.37	-2,363,408,555.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,347,450,605.76	-	687,770,191.53	4,035,220,797.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>朱学华</u>	<u>朱学华</u>	<u>陈松一</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安精致生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3467号《关于准予华安精致生活混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,992,604,677.94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(2021)第0153号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,996,143,384.72份基金份额,其中认购资金利息折合3,538,706.78份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华安精致生活混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购费/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额设置代码。由于基金费用不同,本基金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,计算公式由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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》的有

关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%–95%；投资精致生活主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；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%，其中现金不包含结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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：中证 800 指数收益率 x65%+中证港股通综合指数收益率 x15%+中债综合全价指数收益率 x20%。

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 2024 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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》、《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融

工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比列份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总

额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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、债券投资和资产支持证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、市盈率法、现金流量折现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(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外)，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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	219,960,851.78	571,210,243.14
等于：本金	219,939,293.73	571,153,641.79
加：应计利息	21,558.05	56,601.35
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	219,960,851.78	571,210,243.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,452,546,857.26	-	2,349,599,575.73	- 102,947,281.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	732,000.00	48.13	732,048.13	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	732,000.00	48.13	732,048.13	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,453,278,857.26	48.13	2,350,331,623.86	- 102,947,281.53
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,596,448,294.30	-	3,524,858,407.74	-71,589,886.56
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		3,596,448,294.30	-	3,524,858,407.74	-71,589,886.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	58.14	189.93
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	5,225,112.34	6,044,343.05
其中：交易所市场	5,225,112.34	6,044,343.05
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	230,000.00
合计	5,445,170.48	6,274,532.98

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安精致生活混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,250,223,720.98	2,250,223,720.98
本期申购	289,705,840.14	289,705,840.14
本期赎回（以“-”号填列）	-759,019,741.45	-759,019,741.45
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,780,909,819.67	1,780,909,819.67

华安精致生活混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,097,226,884.78	1,097,226,884.78
本期申购	201,586,565.48	201,586,565.48

本期赎回(以“-”号填列)	-774,955,529.23	-774,955,529.23
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	523,857,921.03	523,857,921.03

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安精致生活混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	800,159,635.36	-328,209,047.24	471,950,588.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	800,159,635.36	-328,209,047.24	471,950,588.12
本期利润	-129,302,211.60	-34,948,151.51	-164,250,363.11
本期基金份额交易产生的变动数	-157,986,035.24	60,751,213.83	-97,234,821.41
其中：基金申购款	101,628,987.29	-32,842,500.63	68,786,486.66
基金赎回款	-259,615,022.53	93,593,714.46	-166,021,308.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	512,871,388.52	-302,405,984.92	210,465,403.60

华安精致生活混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	374,634,728.20	-158,815,124.79	215,819,603.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	374,634,728.20	-158,815,124.79	215,819,603.41
本期利润	-45,204,477.18	3,590,756.54	-41,613,720.64
本期基金份额交易产生的变动数	-189,223,806.50	67,121,656.25	-122,102,150.25
其中：基金申购款	67,668,269.35	-21,956,173.34	45,712,096.01
基金赎回款	-256,892,075.85	89,077,829.59	-167,814,246.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,206,444.52	-88,102,712.00	52,103,732.52

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	1,196,367.75	2,051,476.80
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	175,743.10	148,020.34
其他	8,392.87	14,226.41
合计	1,380,503.72	2,213,723.55

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-178,660,200.62	-90,878,257.16
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	-178,660,200.62	-90,878,257.16

7.4.7.10.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出股票成交总 额	7,228,410,838.65	6,360,485,355.27
减：卖出股票成本 总额	7,385,828,945.34	6,430,516,458.29
减：交易费用	21,242,093.93	20,847,154.14
买卖股票差价收 入	-178,660,200.62	-90,878,257.16

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

债券投资收益——利息收入	1,146.13	2,525.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,918,915.50	2,067,444.89
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,920,061.63	2,069,970.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,416,724.41	10,000,289.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,496,300.00	7,930,000.00
减：应计利息总额	1,132.38	2,601.34
减：交易费用	376.53	243.70
买卖债券差价收入	2,918,915.50	2,067,444.89

7.4.7.12 贵金属投资收益

7.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利	58,748,608.65	72,208,925.35

收益		
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	58,748,608.65	72,208,925.35

7.4.7.15 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-31,357,394.97	-355,817,967.45
股票投资	-31,357,394.97	-355,817,967.45
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	-31,357,394.97	-355,817,967.45

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	183,990.66	1,178,924.19
基金转换费收入	55,928.23	709,794.79
合计	239,918.89	1,888,718.98

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	55,111.28	58,992.63
账户维护费	36,000.00	36,000.00
证券组合费	31,884.32	44,515.17
其他	1,200.00	1,200.00
合计	344,195.60	370,707.80

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	6,546,539,182.04	48.68	9,071,584,359.84	67.61

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份有限公司	1,249,000.00	7.50	12,149,289.93	67.76

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31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	5,741,861.02	48.00	1,794,643.73	34.35
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	8,150,153.79	67.37	5,183,978.69	85.77

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	45,897,278.44	59,038,372.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	15,372,307.69	18,773,611.56
应支付基金管理人的净管理费	30,524,970.75	40,264,760.64

注：自2022年1月1日至2023年7月9日，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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《华安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年7月10日起，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1.20%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,649,546.43	9,839,728.71

注：自2022年1月1日至2023年7月9日，支付基金托管人中国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：

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

根据《华安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年7月10日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	310,121.14	310,121.14
华安基金管理有限公司	-	2,358,089.77	2,358,089.77
中国银行股份有限公司	-	542,595.09	542,595.09
合计	-	3,210,806.00	3,210,806.00
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	440,072.67	440,072.67
华安基金管理有限公司	-	3,016,642.25	3,016,642.25
中国银行股份有限公司	-	535,190.52	535,190.52
合计	-	3,991,905.44	3,991,905.44

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	219,960,851.78	1,196,367.75	571,210,243.14	2,051,476.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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12月31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	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	4,061	154,155.56
国泰君安证券股份有限公司	113671	武进转债	老股东配售	31,260	3,126,000.00
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688347	华虹公司	网下申购	82,606	4,295,512.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	9,813	274,764.00
国泰君安证券	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28

股份有限公司					
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	12,630	142,087.50
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	603170	宝立食品	网下申购	542	5,447.10
国泰君安证券股份有限公司	688459	哈铁科技	网下申购	17,259	235,549.11
国泰君安证券股份有限公司	603182	嘉华股份	网下申购	546	5,760.30
国泰君安证券股份有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813	135,783.09
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759	562,375.50
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368	75,207.44
国泰君安证券股份有限公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920	75,569.60
国泰君安证券股份有限公司	688031	星环科技	网下申购	12,047	573,156.50
国泰君安证券股份有限公司	001238	浙江正特	网下申购	374	6,002.70

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	1-6个月(含)	新股限售	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	1-6个月(含)	新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023年11月1日	1-6个月(含)	新股限售	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	1-6个月(含)	新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1-6个月(含)	新股限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1-6个月(含)	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023年8月30日	1-6个月(含)	新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工	2023年6月	1-6个月	新股	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

	精密	月 29 日	(含)	限售						
301329	信音电子	2023 年7 月5 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301371	敷尔佳	2023 年7 月24 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023 年8 月3 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301395	仁信新材	2023 年6 月21 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301413	安培龙	2023 年12 月11 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023 年8 月10 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023 年8 月16 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023 年7 月6 日	1-6个 月 (含)	新股 限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股	2023 年12	1-6个 月 (含)	新股 限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

	份	月 6 日		售						
301468	博盈特焊	2023 年 7 月 12 日	1-6 个月 (含)	新股限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	1-6 个月 (含)	新股限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1-6 个月 (含)	新股限售	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	1-6 个月 (含)	新股限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	1-6 个月 (含)	新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	1-6 个月 (含)	新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	1-6 个月 (含)	新股限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	1-6 个月 (含)	新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-

301511	德福科技	2023年8月8日	1-6个月(含)	新股限售	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301516	中远通	2023年12月1日	1-6个月(含)	新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	1-6个月(含)	新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股限售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	1-6个月(含)	新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	1-6个月(含)	新股限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	1-6个月(含)	新股限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	1-6个月(含)	新股限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	1-6个月(含)	新股限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠	2023	1-6个月	新	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	柏新材	年 10 月 24 日	月 (含)	股 限 售						
301558	三态股份	2023 年9 月 21 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023 年9 月 26 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301568	思泰克	2023 年11 月 21 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023 年12 月 21 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023 年11 月 28 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
603075	热威股份	2023 年9 月1 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023 年10 月 25 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙	2023	1-6个	新	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

	江 荣 泰	年 7 月 21 日	月 (含)	股 限 售						
603193	润 本 股 份	2023 年 10 月 9 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索 宝 蛋 白	2023 年 12 月 6 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603276	恒 兴 新 材	2023 年 9 月 18 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华 勤 技 术	2023 年 8 月 1 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安 邦 护 卫	2023 年 12 月 13 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华 虹 公 司	2023 年 7 月 27 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-
688548	广 钢 气 体	2023 年 8 月 8 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688563	航 材 股 份	2023 年 7 月 12 日	1-6个 月 (含)	新 股 限 售	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688582	芯	2023	1-6个	新	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-

	动联科	年6月21日	月(含)	股限售						
688602	康鹏科技	2023年7月13日	1-6个月(含)	新股限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1-6个月(含)	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	1-6个月(含)	新股限售	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	1-6个月(含)	新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	1-6个月(含)	新股限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	1-6个月(含)	新股限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	1-6个月(含)	新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软	2023年9月	1-6个月(含)	新股限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-

	件	25 日		售						
688702	盛科通信	2023 年9 月6 日	1-6个 月 (含)	新股限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688719	爱科赛博	2023 年9 月20 日	1-6个 月 (含)	新股限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023 年11 月29 日	1-6个 月 (含)	新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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： 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博23转债	2023 年12 月22 日	1个月 内 (含)	配债未上市	100.00	100.01	7,320	732,000.00	732,048.13	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，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。

7.4.13.1 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之内。

7.4.13.2 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人中国银行，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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.03%（2022 年 12 月 31 日：本基金无债券投资）。

7.4.13.3 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，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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》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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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发行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%。(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 7.4.12。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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	219,960,851.78	-	-	-	219,960,851.78
结算备付金	6,989,909.20	-	-	-	6,989,909.20
存出保证金	301,803.59	-	-	-	301,803.59
交易性金融资产	732,048.13	-	-	-2,349,599,575.73	2,350,331,623.86
应收申购款	-	-	-	190,281.35	190,281.35
应收清算款	-	-	-	3,302,385.63	3,302,385.63
资产总计	227,984,612.70	-	-	-2,353,092,242.71	2,581,076,855.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,091,003.10	4,091,003.10
应付管理人报酬	-	-	-	2,653,906.56	2,653,906.56
应付托管费	-	-	-	442,317.78	442,317.78
应付清算款	-	-	-	810,495.70	810,495.70
应付销售服务费	-	-	-	297,083.40	297,083.40
应交税费	-	-	-	1.57	1.57
其他负债	-	-	-	5,445,170.48	5,445,170.48
负债总计	-	-	-	13,739,978.59	13,739,978.59
利率敏感度缺口	227,984,612.70	-	-	-2,339,352,264.12	2,567,336,876.82
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	571,210,243.14	-	-	-	571,210,243.14
结算备付金	3,602,048.47	-	-	-	3,602,048.47
存出保证金	400,579.15	-	-	-	400,579.15
交易性金融资产	-	-	-	-3,524,858,407.74	3,524,858,407.74
应收申购款	-	-	-	3,408,986.44	3,408,986.44
资产总计	575,212,870.76	-	-	-3,528,267,394.18	4,103,480,264.94
负债					
应付清算款	-	-	-	133.99	133.99
应付赎回款	-	-	-	55,150,214.94	55,150,214.94
应付管理人报酬	-	-	-	5,266,492.36	5,266,492.36
应付托管费	-	-	-	877,748.73	877,748.73
应付销售服务费	-	-	-	690,343.20	690,343.20
应交税费	-	-	-	1.45	1.45
其他负债	-	-	-	6,274,532.98	6,274,532.98
负债总计	-	-	-	68,259,467.65	68,259,467.65
利率敏感度缺口	575,212,870.76	-	-	-3,460,007,926.53	4,035,220,797.29

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03% (2022 年 12 月 31 日：无)，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)。

7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	205,583,746.12	-	205,583,746.12
资产合计	-	205,583,746.12	-	205,583,746.12
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	205,583,746.12	-	205,583,746.12
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	611,402,331.77	-	611,402,331.77
资产合计	-	611,402,331.77	-	611,402,331.77
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	611,402,331.77	-	611,402,331.77
-----------------------	---	----------------	---	----------------

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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12月31 日）	上年度末（2022年12月 31日）
	港币相对人民币升 值 5%	10,280,000.00	30,570,000.00
	港币相对人民币贬 值 5%	-10,280,000.00	-30,570,000.00

7.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 60%-95%；投资精致生活主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；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、存出保证金和应收申购款等。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	2,349,599,575.73	91.52	3,524,858,407.74	87.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	732,048.13	0.03	-	-
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	2,350,331,623.86	91.55	3,524,858,407.74	87.35

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		119,562,298.71
业绩比较基准下降 5%		-119,562,298.71	-215,480,000.00

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,346,319,639.28	3,523,325,607.90
第二层次	732,048.13	-
第三层次	3,279,936.45	1,532,799.84
合计	2,350,331,623.86	3,524,858,407.74

7.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,532,799.84	1,532,799.84
当期购买	-	4,721,589.05	4,721,589.05
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,980,279.77	7,980,279.77
当期利得或损失总额	-	5,005,827.33	5,005,827.33
其中：计入损益的利得或	-	5,005,827.33	5,005,827.33

损失			
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	3,279,936.45	3,279,936.45
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-531,137.25	-531,137.25
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,270,573.17	2,270,573.17
当期购买	-	2,036,682.87	2,036,682.87
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,717,267.19	7,717,267.19
当期利得或损失总额	-	4,942,810.99	4,942,810.99
其中：计入损益的利得或损失	-	4,942,810.99	4,942,810.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,532,799.84	1,532,799.84
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	144,980.42	144,980.42

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资(2022 年 12 月 31 日：同)。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资(2022 年度：同)。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	3,279,936.45	平均价格 亚式期权	预期波动率	14.62%- 217.52%	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
			流通受限股票	1,532,799.84	平均价格 亚式期权 模型

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,349,599,575.73	91.03
	其中：股票	2,349,599,575.73	91.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	732,048.13	0.03
	其中：债券	732,048.13	0.03
	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	226,950,760.98	8.79
8	其他各项资产	3,794,470.57	0.15
9	合计	2,581,076,855.41	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 205,583,746.12 元，占基金资

产净值比例为 8.01%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	22,740.20	0.00
B	采矿业	288,492,761.68	11.24
C	制造业	1,146,829,219.66	44.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	337,368,535.66	13.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,279,095.84	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	109,998,564.09	4.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,813,792.08	0.42
J	金融业	159,735,776.70	6.22
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,772,205.40	0.26
M	科学研究和技术服务业	22,579,814.46	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	123,323.84	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	2,144,015,829.61	83.51

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	52,028,174.51	2.03
原材料	1,082,325.73	0.04
工业	36,801,530.77	1.43
非日常生活消费品	29,361,074.89	1.14
日常消费品	-	-
医疗保健	49,476,675.84	1.93
金融	-	-
信息技术	9,034,759.66	0.35
通信服务	-	-
公用事业	27,799,204.72	1.08

房地产	-	-
合计	205,583,746.12	8.01

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601058	赛轮轮胎	10,767,393	126,516,867.75	4.93
2	01138	中远海能	7,790,000	52,028,174.51	2.03
2	600026	中远海能	3,166,700	38,760,408.00	1.51
3	600968	海油发展	30,463,400	86,820,690.00	3.38
4	601601	中国太保	3,328,900	79,161,242.00	3.08
5	600886	国投电力	5,737,700	75,622,886.00	2.95
6	000338	潍柴动力	4,005,900	54,680,535.00	2.13
6	02338	潍柴动力	900,000	10,635,397.92	0.41
7	600027	华电国际	7,336,500	37,709,610.00	1.47
7	01071	华电国际电力股份	8,012,000	25,194,402.20	0.98
8	300389	艾比森	3,234,550	56,087,097.00	2.18
9	002444	巨星科技	2,356,900	53,077,388.00	2.07
10	601001	晋控煤业	4,301,800	53,041,194.00	2.07
11	600011	华能国际	6,578,320	50,653,064.00	1.97
12	002478	常宝股份	8,632,600	47,047,670.00	1.83
13	601688	华泰证券	2,997,650	41,817,217.50	1.63
14	600150	中国船舶	1,396,300	41,107,072.00	1.60
15	688981	中芯国际	553,390	29,340,737.80	1.14
15	00981	中芯国际	502,000	9,034,759.66	0.35
16	600546	山煤国际	2,115,100	37,035,401.00	1.44
17	603878	武进不锈	4,778,562	36,078,143.10	1.41
18	300303	聚飞光电	6,008,100	35,628,033.00	1.39
19	601898	中煤能源	3,609,600	34,977,024.00	1.36
20	002608	江苏国信	5,064,100	33,271,137.00	1.30
21	002984	森麒麟	1,122,129	32,373,421.65	1.26
22	000883	湖北能源	7,613,574	32,205,418.02	1.25
23	601717	郑煤机	2,212,640	27,989,896.00	1.09
23	00564	郑煤机	269,000	2,086,698.42	0.08
24	600023	浙能电力	6,482,900	29,886,169.00	1.16
25	600529	山东药玻	1,115,700	28,561,920.00	1.11
26	300396	迪瑞医疗	959,600	28,260,220.00	1.10
27	600519	贵州茅台	16,300	28,133,800.00	1.10
28	601111	中国国航	3,724,000	27,334,160.00	1.06
29	600761	安徽合力	1,487,100	27,080,091.00	1.05
30	02015	理想汽车-W	201,800	26,900,941.33	1.05
31	600030	中信证券	1,299,000	26,460,630.00	1.03

32	603298	杭叉集团	1,047,191	26,054,112.08	1.01
33	600276	恒瑞医药	575,700	26,038,911.00	1.01
34	601137	博威合金	1,606,539	24,949,550.67	0.97
35	600795	国电电力	5,464,800	22,733,568.00	0.89
36	603259	药明康德	308,071	22,415,245.96	0.87
37	600985	淮北矿业	1,311,556	21,811,176.28	0.85
38	601699	潞安环能	973,900	21,338,149.00	0.83
39	601126	四方股份	1,492,700	21,136,632.00	0.82
40	301035	润丰股份	294,676	20,627,320.00	0.80
41	300985	致远新能	511,800	19,299,978.00	0.75
42	600497	驰宏锌锗	3,793,048	19,154,892.40	0.75
43	600499	科达制造	1,793,779	18,924,368.45	0.74
44	600509	天富能源	2,882,000	18,761,820.00	0.73
45	601028	玉龙股份	1,745,400	18,693,234.00	0.73
46	01548	金斯瑞生物科技	1,034,000	18,609,445.19	0.72
47	688169	石头科技	65,759	18,606,509.05	0.72
48	600803	新奥股份	986,500	16,592,930.00	0.65
49	002732	燕塘乳业	777,500	14,928,000.00	0.58
50	002648	卫星化学	1,010,800	14,909,300.00	0.58
51	601958	金铝股份	1,511,900	14,287,455.00	0.56
52	600211	西藏药业	290,916	14,196,700.80	0.55
53	000403	派林生物	507,700	13,829,748.00	0.54
54	00013	和黄医药	528,000	13,732,495.39	0.53
55	300679	电连技术	327,300	13,582,950.00	0.53
56	601225	陕西煤业	648,900	13,555,521.00	0.53
57	000426	兴业银锡	1,485,500	13,488,340.00	0.53
58	002466	天齐锂业	241,000	13,445,390.00	0.52
59	603167	渤海轮渡	1,512,700	13,432,776.00	0.52
60	600066	宇通客车	1,003,800	13,300,350.00	0.52
61	002422	科伦药业	457,000	13,275,850.00	0.52
62	300866	安克创新	149,260	13,224,436.00	0.52
63	000902	新洋丰	1,143,900	13,029,021.00	0.51
64	003019	宸展光电	574,346	12,980,219.60	0.51
65	00317	中船防务	1,346,000	12,710,025.49	0.50
66	601825	沪农商行	2,142,280	12,296,687.20	0.48
67	601333	广深铁路	2,741,000	7,099,190.00	0.28
67	00525	广深铁路股份	3,222,000	4,438,158.08	0.17
68	603885	吉祥航空	943,346	11,320,152.00	0.44
69	002273	水晶光电	796,543	10,785,192.22	0.42
70	300360	炬华科技	780,648	10,663,651.68	0.42
71	688368	晶丰明源	95,632	10,322,518.08	0.40
72	000983	山西焦煤	1,014,000	10,018,320.00	0.39
73	002983	芯瑞达	316,040	9,752,994.40	0.38

74	601500	通用股份	2,342,300	9,697,122.00	0.38
75	603029	天鹅股份	474,900	9,687,960.00	0.38
76	002833	弘亚数控	539,500	9,570,730.00	0.37
77	300841	康华生物	116,300	9,017,902.00	0.35
78	000683	远兴能源	1,460,200	8,571,374.00	0.33
79	600900	长江电力	355,100	8,288,034.00	0.32
80	603173	福斯达	349,345	7,867,249.40	0.31
81	000598	兴蓉环境	1,364,100	7,761,729.00	0.30
82	02269	药明生物	286,000	7,671,696.03	0.30
83	688581	安杰思	58,577	7,310,995.37	0.28
84	00598	中国外运	2,339,000	6,931,250.86	0.27
85	002027	分众传媒	1,065,700	6,735,224.00	0.26
86	601006	大秦铁路	882,100	6,359,941.00	0.25
87	002078	太阳纸业	470,100	5,721,117.00	0.22
88	603871	嘉友国际	357,140	5,664,240.40	0.22
89	03692	翰森制药	388,000	5,541,426.55	0.22
90	001311	多利科技	108,420	5,367,874.20	0.21
91	002884	凌霄泵业	292,300	5,074,328.00	0.20
92	002170	芭田股份	768,800	4,266,840.00	0.17
93	603600	永艺股份	371,250	4,098,600.00	0.16
94	300750	宁德时代	25,004	4,082,153.04	0.16
95	002606	大连电瓷	501,100	3,958,690.00	0.15
96	02005	石四药集团	876,000	3,921,612.68	0.15
97	600461	洪城环境	408,376	3,732,556.64	0.15
98	301345	涛涛车业	58,852	3,584,086.80	0.14
99	002138	顺络电子	128,200	3,462,682.00	0.13
100	605377	华旺科技	179,800	3,432,382.00	0.13
101	003002	壶化股份	219,200	3,329,648.00	0.13
102	603368	柳药集团	154,200	2,917,464.00	0.11
103	002588	史丹利	439,300	2,802,734.00	0.11
104	002595	豪迈科技	90,700	2,700,139.00	0.11
105	01816	中广核电力	1,409,000	2,604,802.52	0.10
106	600398	海澜之家	339,500	2,519,090.00	0.10
107	301263	泰恩康	153,900	2,513,187.00	0.10
108	300881	盛德鑫泰	98,210	2,512,211.80	0.10
109	00780	同程旅行	188,000	2,460,133.56	0.10
110	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.09
111	688122	西部超导	44,686	2,378,635.78	0.09
112	603187	海容冷链	146,900	2,227,004.00	0.09
113	603337	杰克股份	86,200	1,861,920.00	0.07
114	605333	沪光股份	79,300	1,578,070.00	0.06
115	01818	招金矿业	123,000	1,082,325.73	0.04
116	688563	航材股份	15,010	917,546.29	0.04

117	300705	九典制药	27,600	917,148.00	0.04
118	300926	博俊科技	20,700	607,131.00	0.02
119	688720	艾森股份	9,772	587,141.42	0.02
120	603296	华勤技术	5,925	472,079.23	0.02
121	688652	京仪装备	4,157	247,131.25	0.01
122	301559	中集环科	13,144	247,080.54	0.01
123	688570	天玛智控	8,837	240,454.77	0.01
124	688061	灿瑞科技	5,918	236,720.00	0.01
125	301525	儒竞科技	2,660	223,674.08	0.01
126	301303	真兰仪表	10,574	208,202.06	0.01
127	301468	博盈特焊	5,979	182,138.25	0.01
128	688562	航天软件	7,254	174,096.00	0.01
129	000543	皖能电力	23,900	149,614.00	0.01
130	688512	慧智微	7,209	140,503.41	0.01
131	300832	新产业	1,700	132,940.00	0.01
132	688623	双元科技	1,776	126,060.48	0.00
133	301115	建科股份	6,850	122,615.00	0.00
134	688443	智翔金泰	3,033	121,168.35	0.00
135	688602	康鹏科技	10,653	119,451.97	0.00
136	301318	维海德	3,078	108,991.98	0.00
137	301296	新巨丰	10,411	107,233.30	0.00
138	301329	信音电子	4,577	103,682.64	0.00
139	301376	致欧科技	4,192	100,272.64	0.00
140	301202	朗威股份	3,060	98,216.82	0.00
141	301395	仁信新材	5,196	97,674.36	0.00
142	301418	协昌科技	1,886	97,069.97	0.00
143	301386	未来电器	3,776	96,023.68	0.00
144	301469	恒达新材	2,743	92,493.47	0.00
145	301519	舜禹股份	4,414	90,914.90	0.00
146	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.00
147	301428	世纪恒通	2,289	88,469.85	0.00
148	301355	南王科技	5,624	85,203.60	0.00
149	301323	新莱福	2,277	84,226.23	0.00
150	688657	浩辰软件	1,008	82,656.17	0.00
151	301548	崇德科技	1,351	82,246.99	0.00
152	301232	飞沃科技	1,643	79,669.07	0.00
153	688472	阿特斯	6,261	79,076.43	0.00
154	688648	中邮科技	3,025	78,163.55	0.00
155	688479	友车科技	3,318	77,375.76	0.00
156	301170	锡南科技	2,496	75,953.28	0.00
157	300223	北京君正	1,156	74,735.40	0.00
158	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.00
159	301388	欣灵电气	2,920	71,218.80	0.00

160	688469	芯联集成	13,800	69,276.00	0.00
161	603193	润本股份	3,022	54,479.40	0.00
162	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
163	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.00
164	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.00
165	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.00
166	603276	恒兴新材	1,336	34,970.56	0.00
167	688507	索辰科技	222	30,358.50	0.00
168	301325	曼恩斯特	364	28,224.56	0.00
169	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
170	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
171	688576	西山科技	240	23,071.20	0.00
172	605296	神农集团	740	22,740.20	0.00
173	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
174	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
175	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
176	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
177	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
178	301377	鼎泰高科	770	18,210.50	0.00
179	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
180	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
181	301152	天力锂能	433	15,839.14	0.00
182	688334	西高院	888	15,389.04	0.00
183	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
184	301439	泓淋电力	949	13,874.38	0.00
185	603162	海通发展	774	13,715.28	0.00
186	301305	朗坤环境	753	13,591.65	0.00
187	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
188	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
189	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
190	688620	安凯微	1,016	12,009.12	0.00
191	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.00
192	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
193	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
194	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
195	301399	英特科技	293	11,213.11	0.00
196	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
197	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
198	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
199	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
200	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
201	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
202	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00

203	001326	联域股份	186	9,611.67	0.00
204	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
205	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
206	603170	宝立食品	542	9,165.22	0.00
207	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
208	301203	国泰环保	225	8,748.00	0.00
209	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
210	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
211	301373	凌玮科技	277	8,213.05	0.00
212	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
213	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
214	603182	嘉华股份	546	8,064.42	0.00
215	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
216	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
217	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
218	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
219	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
220	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
221	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
222	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
223	300996	普联软件	1	22.90	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	02015	理想汽车-W	226,173,346.86	5.60
2	601601	中国太保	116,313,970.59	2.88
3	600900	长江电力	114,694,298.89	2.84
4	00700	腾讯控股	110,002,219.22	2.73
5	601318	中国平安	104,109,877.21	2.58
6	600028	中国石化	102,786,638.30	2.55
7	601058	赛轮轮胎	96,573,536.00	2.39
8	601688	华泰证券	95,985,640.63	2.38
9	600546	山煤国际	95,118,789.35	2.36
10	601991	大唐发电	85,498,537.99	2.12
11	601390	中国中铁	84,043,508.00	2.08
12	300389	艾比森	82,048,110.00	2.03
13	600011	华能国际	80,843,287.16	2.00
14	00857	中国石油股份	80,682,791.03	2.00

15	603993	洛阳钼业	76,196,860.75	1.89
16	600276	恒瑞医药	71,863,062.48	1.78
17	600985	淮北矿业	70,363,282.61	1.74
18	000426	兴业银锡	67,421,593.49	1.67
19	00981	中芯国际	67,066,078.41	1.66
20	002444	巨星科技	64,976,205.73	1.61

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。

8.4.2 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	00700	腾讯控股	312,741,337.41	7.75
2	02015	理想汽车-W	247,672,002.18	6.14
3	600583	海油工程	132,343,236.29	3.28
4	002129	TCL 中环	129,668,566.84	3.21
5	600021	上海电力	117,442,121.45	2.91
6	600519	贵州茅台	111,473,849.00	2.76
7	600900	长江电力	107,332,971.80	2.66
8	600028	中国石化	106,309,347.20	2.63
9	601390	中国中铁	104,684,806.66	2.59
10	600690	海尔智家	104,345,550.23	2.59
11	600027	华电国际	102,213,161.14	2.53
12	601318	中国平安	98,361,001.20	2.44
13	601958	金铂股份	92,240,705.99	2.29
14	600875	东方电气	90,697,225.10	2.25
15	02628	中国人寿	90,570,312.98	2.24
16	601816	京沪高铁	89,634,113.00	2.22
17	300750	宁德时代	85,198,349.84	2.11
18	00857	中国石油股份	84,408,077.60	2.09
19	600029	南方航空	82,912,147.00	2.05
20	600509	天富能源	82,869,097.13	2.05
21	000983	山西焦煤	82,397,266.14	2.04

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。

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	6,241,927,508.30
卖出股票收入（成交）总额	7,228,410,838.65

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	732,048.13	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	732,048.13	0.03

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	7,320	732,048.13	0.03

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	301,803.59
2	应收清算款	3,302,385.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	190,281.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,794,470.57

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华安精致生活混合 A	40,717	43,738.73	435,180,444.83	24.44	1,345,729,374.84	75.56
华安精致生活混合 C	32,944	15,901.47	239,582,071.86	45.73	284,275,849.17	54.27
合计	73,661	31,288.85	674,762,516.69	29.28	1,630,005,224.01	70.72

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	华安精致生活混合 A	700,564.88	0.04
	华安精致生活混合 C	449,507.26	0.09
	合计	1,150,072.14	0.05

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华安精致生活混合 A	10~50
	华安精致生活混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华安精致生活混合 A	10~50
	华安精致生活混合 C	-
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安精致生活混合 A	华安精致生活混合 C
----	------------	------------

基金合同生效日 (2021年3月9日)基金份额总额	6,409,375,385.65	586,767,999.07
本报告期初基金份额总额	2,250,223,720.98	1,097,226,884.78
本报告期基金总申购份额	289,705,840.14	201,586,565.48
减:本报告期基金总赎回份额	759,019,741.45	774,955,529.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,780,909,819.67	523,857,921.03

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
国泰君安	3	6,546,539,182.04	48.68	5,741,861.02	48.00	-
国海证券	1	2,253,913,157.93	16.76	2,112,611.66	17.66	-
申万宏源	1	1,202,420,025.82	8.94	994,127.33	8.31	-
中泰证券	1	1,034,478,066.32	7.69	966,322.04	8.08	-
长江证券	1	833,098,505.11	6.20	673,416.60	5.63	-
西南证券	1	773,083,420.28	5.75	719,970.78	6.02	-
华创证券	1	361,333,424.24	2.69	339,273.92	2.84	-
国投证券	1	193,946,702.32	1.44	180,625.68	1.51	-
华泰证券	1	134,962,505.99	1.00	125,936.46	1.05	-
国信证券	1	93,282,293.31	0.69	88,235.94	0.74	-
华西证券	1	19,915,257.00	0.15	18,837.92	0.16	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-

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) 财务状况良好，经营行为稳健规范，交易能力较强，近三年无重大违法违规行为，在

业内有良好的声誉；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；能积极为投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(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：

2023 年 8 月完成租用托管在中国银行的华泰证券上交所 20645 交易单元；

2023 年 9 月完成租用托管在中国银行的东吴证券深交所 016852 交易单元。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券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 (%)		(%)		的比例 (%)
国泰君安	1,249,000.00	7.50	-	-	-	-
国海证券	7,823,670.31	47.00	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	5,355,981.84	32.18	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2,216,372.26	13.32	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	华安精致生活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及基金管理人网站	2023 年 1 月 20 日
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及基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
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及基金管理人网站	2023 年 2 月 17 日
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及基金管理人网站	2023 年 3 月 15 日

5	华安精致生活混合 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 30 日
6	华安精致生活混合 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 21 日
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及基金管理人网站	2023 年 5 月 5 日
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及基金管理人网站	2023 年 5 月 13 日
9	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（盘古智能）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 7 日
10	华安精致生活混合托管协议(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
11	华安精致生活混合基金合同(更新)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
12	华安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 8 日
13	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（武进转债）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
14	华安精致生活混合 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
15	华安精致生活混合更新的招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
16	华安精致生活混合 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 12 日
17	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（维科精密）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 14 日
18	华安精致生活混合 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
19	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（华	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2023 年 7 月 28 日

	虹公司)	站	
20	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(德福科技)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年8月9日
21	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年8月22日
22	华安精致生活混合 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年8月30日
23	关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年8月31日
24	关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年9月1日
25	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(恒兴新材)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年9月19日
26	华安精致生活混合 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年10月24日
27	华安基金管理有限公司关于公司固有资金投资公募基金相关事宜的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年11月10日
28	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(京仪装备)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年11月23日
29	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(锦江航运)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年11月29日
30	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(永达股份)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年12月5日
31	华安精致生活 A 基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年12月18日
32	华安精致生活更新的招募说明书(2023年第2号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年12月18日
33	华安精致生活 C 基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023年12月18日
34	关于基金电子交易平台延长工行直	中国证监会基金电子披	2023年12月26日

	联结算方式费率优惠活动的公告	露网站及基金管理人网站	
35	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安精致生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安精致生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安精致生活混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安精致生活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；

13.2 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>。

13.3 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 3 月 27 日