

# 华安新回报灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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       | 华安新回报灵活配置   |
| 基金主代码      | 001311  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2015 年 5 月 19 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 39,825,163.65 份   |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | 本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。<br>在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。<br>在个股投资方面本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置的行业内通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。 |
| 业绩比较基准     | 中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+3%   |

|        |  |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。 |
| 基金管理人  | 华安基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 交通银行股份有限公司   |

### §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） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 203,271.08                            |
| 2. 本期利润         | 215,737.01                            |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0054                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 58,922,392.41                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.480                                 |

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。

#### 3.2 基金净值表现

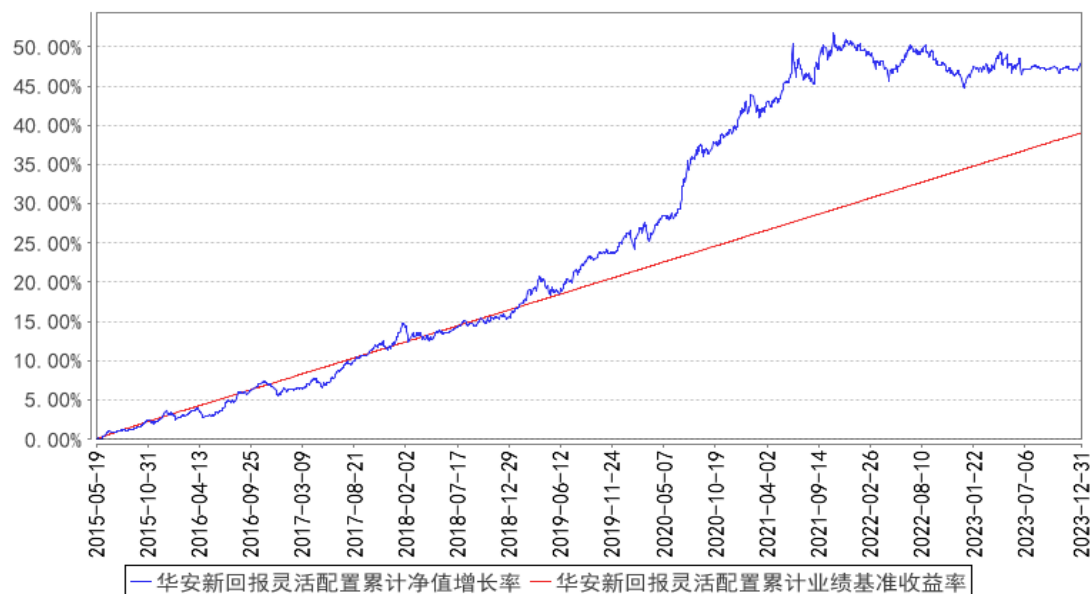
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 0.41%      | 0.08%         | 1.13%          | 0.02%                 | -0.72% | 0.06% |
| 过去六个月          | 0.68%      | 0.06%         | 2.27%          | 0.01%                 | -1.59% | 0.05% |
| 过去一年           | 1.58%      | 0.16%         | 4.50%          | 0.01%                 | -2.92% | 0.15% |
| 过去三年           | 5.19%      | 0.22%         | 13.50%         | 0.01%                 | -8.31% | 0.21% |
| 过去五年           | 28.03%     | 0.22%         | 22.51%         | 0.01%                 | 5.52%  | 0.21% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 48.00%     | 0.18%         | 39.01%         | 0.01%                 | 8.99%  | 0.17% |

##### 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

华安新回报灵活配置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



## §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 |        |  |
| 朱才敏 | 本基金的基金经理 | 2015年5月19日  | -    | 16年    | 硕士研究生，16年基金行业从业经历。2007年7月应届毕业生进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员等职务。2014年11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的基金经理。2014年11月至2022年2月，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2014年11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。2015年5月起同时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。2016年4月至2018年10月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月至2023年1月，同时担任华安安禧灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2018年1月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>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 12 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。2017 年 3 月至 2020 年 11 月，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月至 2022 年 2 月，同时担任华安鼎信 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 7 月至 2021 年 3 月，同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2019 年 8 月至 2021 年 3 月，同时担任华安年年丰一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2022 年 6 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。2022 年 6 月起，同时担任华安智联混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 3 月至 2023 年 3 月，同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安添和一年持有期债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起，同时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。2023 年 3 月起，同时担任华安稳健回报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

四季度，海外通胀继续回落，美联储暂停加息。国内经济温和修复，高质量发展扎实推进。制造业 PMI 继续筑底，服务业 PMI 底部趋稳；出口降幅继续收窄，投资小幅下滑，社零增速继续回升。通胀方面，CPI 同比增速再次转负，PPI 同比增速跌幅略有扩大。货币政策保持稳健，注重跨周期和逆周期调节，M2 增速小幅下降，信贷增速保持平稳，社融增速有所回升。货币市场流动性有所收紧，资金利率中枢有所走高，短端利率债收益率跟随资金利率走高；长端利率债受流动性、供给和预期等影响，先盘整、后下行；信用利差窄幅波动。经济基本面底部修复，市场风险偏好仍较低，权益市场延续震荡下行，中小市值个股表现相对较强。

本基金保持了对利率债和高等级信用债的基本配置，动态调整股票仓位和结构，动态调整组合久期和杠杆水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.480 元，本报告期份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准增长率为 1.13%。

#### 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    | 2,891,417.00  | 4.89         |
|    | 其中：股票   | 2,891,417.00  | 4.89         |
| 2  | 基金投资    | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 55,577,216.69 | 94.06        |
|    | 其中：债券   | 55,577,216.69 | 94.06        |
|    | 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      | 594,537.19    | 1.01   |
| 8 | 其他资产              | 23,339.29     | 0.04   |
| 9 | 合计                | 59,086,510.17 | 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         | 101,466.00   | 0.17         |
| B  | 采矿业              | 229,012.00   | 0.39         |
| C  | 制造业              | 1,736,574.00 | 2.95         |
| 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           | 44,865.00    | 0.08         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 57,480.00    | 0.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           |              |              |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  |              |              |
| J  | 金融业              | 620,013.00   | 1.05         |
| 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       | 58,208.00    | 0.10         |
| 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          | 43,799.00    | 0.07         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        |              |              |
| S  | 综合               |              |              |
|    | 合计               | 2,891,417.00 | 4.91         |

### 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  | 600019 | 宝钢股份 | 25,000 | 148,250.00 | 0.25         |



|    |        |      |        |           |      |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 2  | 600188 | 兖矿能源 | 5,000  | 99,050.00 | 0.17 |
| 3  | 002156 | 通富微电 | 4,000  | 92,480.00 | 0.16 |
| 4  | 600256 | 广汇能源 | 10,000 | 71,400.00 | 0.12 |
| 5  | 601939 | 建设银行 | 10,100 | 65,751.00 | 0.11 |
| 6  | 601288 | 农业银行 | 17,500 | 63,700.00 | 0.11 |
| 7  | 600989 | 宝丰能源 | 4,300  | 63,511.00 | 0.11 |
| 8  | 300124 | 汇川技术 | 1,000  | 63,140.00 | 0.11 |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 13,100 | 62,618.00 | 0.11 |
| 10 | 601229 | 上海银行 | 10,100 | 60,297.00 | 0.10 |

#### 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      | 11,320,707.46 | 19.21        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 38,988,433.05 | 66.17        |
|    | 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） | 5,268,076.18  | 8.94         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 55,577,216.69 | 94.32        |

#### 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  | 2128021 | 21 工商银行永续债 01 | 50,000 | 5,252,396.72 | 8.91         |
| 2  | 2028037 | 20 光大银行永续债    | 50,000 | 5,211,775.96 | 8.85         |
| 3  | 2028006 | 20 邮储银行永续债    | 50,000 | 5,200,047.54 | 8.83         |
| 4  | 2028038 | 20 中国银行二级 01  | 50,000 | 5,182,819.67 | 8.80         |
| 5  | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 50,000 | 5,130,290.71 | 8.71         |

#### 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

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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 2 月 16 日，建设银行因公司治理和内部控制制度与监管规定不符、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2023〕

10 号) 给予没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元的行政处罚, 其中, 总行 7341.5626 万元, 分支机构 12550 万元。2023 年 11 月 22 日, 建设银行因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作等违法违规事项, 被国家金融监督管理总局(金罚决字(2023)29 号)没收违法所得并处罚款合计 3791.879382 万元, 其中, 总行 2041.879382 万元, 分支机构 1750 万元。

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 11 月 17 日, 农业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, 被国家外汇管理局北京市分局(京汇罚[2023]32 号)给予警告, 没收违法所得 1,418,524.70 元人民币, 并处 553 万元人民币罚款。2023 年 11 月 16 日, 农业银行因流动资金贷款被用于固定资产投资等违法违规事项, 被国家金融监督管理总局(金罚决字(2023)21 号)没收违法所得并处罚款合计 2710.9738 万元。

2023 年 4 月 21 日, 上海银行因无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务等违法违规事项, 被国家外汇管理局上海市分局(上海汇管罚字(2023)3111221101 号)给予警告, 处罚款 9834.50 万元人民币, 没收违法所得 19.90 万元人民币, 罚没款合计 9854.40 万元人民币。2023 年 11 月 15 日, 上海银行因不良贷款余额数据报送存在偏差等违法违规事项, 被国家金融监督管理总局上海监管局(沪金罚决字(2023)51 号)责令改正, 并处罚款共计 690 万元。2023 年 11 月 15 日, 上海银行因封闭式产品投资非标准化资产终止日晚于产品到期日等违法违规事项, 被国家金融监督管理总局上海监管局(沪金罚决字(2023)52 号)责令改正, 并处罚款共计 690 万元。2023 年 11 月 27 日, 上海银行因未尽审核办理股权转让购付汇业务, 被国家外汇管理局上海市分局(上海汇管罚字(2023)3111220301 号)处罚款 70 万元人民币, 没收违法所得 2,572,326.64 元人民币, 罚没款合计 3,272,326.64 元人民币。2023 年 12 月 28 日, 上海银行因未按规定提供报表等违法违规事项, 被国家金融监督管理总局上海监管局(沪金罚决字(2023)81 号)罚款合计 145 万元, 其中总行 15 万元, 分支机构 130 万元。

2023 年 7 月 7 日, 邮储银行因违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金等违法违规事项, 被中国人民银行(银罚决字(2023)39 号)给予警告, 罚款 3186 万元的行政处罚。

2023 年 2 月 16 日, 中国银行因小微企业贷款风险分类不准确、小微企业贷款资金被挪用于房地产领域等违法违规事项, 被中国银行保险监督管理委员会(银保监罚决字(2023)5 号)给予

对总行罚款 1600 万元，对分支机构罚款 1680 万元，合计罚款 3280 万元的行政处罚。2023 年 11 月 29 日，中国银行因违反账户管理规定等违法违规事项，被中国人民银行（银罚决字（2023）93 号）给予警告，没收违法所得 37.340315 万元，罚款 3664.2 万元。

2023 年 11 月 16 日，中信银行因违反高管准入管理相关规定等违法违规事项，被国家金融监督管理总局（金罚决字（2023）15 号）罚款 15242.59 万元、没收违法所得 462.59 万元。

2023 年 6 月 25 日，青岛银行因向小微企业收取银行承兑汇票敞口承诺费等违法违规事项，被青岛银保监局（青银保监罚决字（2023）54 号）罚款人民币五十二万元。

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。

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   | 6,852.84  |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 16,486.45 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 23,339.29 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债 | 1,830,320.14 | 3.11         |
| 2  | 128035 | 大族转债 | 473,938.53   | 0.80         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 3  | 110088 | 淮 22 转债  | 442,783.08 | 0.75 |
| 4  | 110073 | 国投转债     | 273,755.75 | 0.46 |
| 5  | 123099 | 普利转债     | 264,829.04 | 0.45 |
| 6  | 113667 | 春 23 转债  | 132,630.68 | 0.23 |
| 7  | 113631 | 皖天转债     | 125,141.01 | 0.21 |
| 8  | 113639 | 华正转债     | 124,409.84 | 0.21 |
| 9  | 110075 | 南航转债     | 120,006.77 | 0.20 |
| 10 | 127027 | 能化转债     | 116,812.33 | 0.20 |
| 11 | 123168 | 惠云转债     | 116,551.29 | 0.20 |
| 12 | 113044 | 大秦转债     | 116,331.01 | 0.20 |
| 13 | 132026 | G 三峡 EB2 | 114,306.90 | 0.19 |
| 14 | 118027 | 宏图转债     | 114,004.71 | 0.19 |
| 15 | 113644 | 艾迪转债     | 109,716.03 | 0.19 |
| 16 | 127056 | 中特转债     | 109,499.89 | 0.19 |
| 17 | 128136 | 立讯转债     | 109,134.64 | 0.19 |
| 18 | 123169 | 正海转债     | 87,415.64  | 0.15 |
| 19 | 113066 | 平煤转债     | 64,808.78  | 0.11 |
| 20 | 123158 | 宙邦转债     | 64,748.15  | 0.11 |

#### 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

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 40,243,622.78 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 66,155.44     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 484,614.57    |
| 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               | 39,825,163.65 |

### §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        | 10,182,620.50 | 0.00 | 0.00       | 10,182,620.50 | 25.57    |
| 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、《华安新回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安新回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安新回报灵活配置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