

华安安信消费服务混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	48
7.7 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	48
7.8 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	48

7.9 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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 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	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安安信消费服务混合型证券投资基金	
基金简称	华安安信消费混合	
基金主代码	519002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 23 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	968,112,155.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安安信消费混合 A	华安安信消费混合 C
下属分级基金的交易代码	519002	013686
报告期末下属分级基金的份额总额	894,448,348.59 份	73,663,806.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会、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、权证投资策略 5、资产支持证券的投资 6、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云
	联系电话	021-38969999
	电子邮箱	service@huaan.com.cn
客户服务电话	4008850099	95588

传真	021-68863414	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	华安安信消费混合 A	华安安信消费混合 C
本期已实现收益	64,790,300.74	5,582,035.88
本期利润	445,827,103.77	28,557,537.47
加权平均基金份额 本期利润	0.4780	0.4214
本期加权平均净 值利润率	10.95%	9.75%
本期基金份额净 值增长率	11.95%	11.61%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	2,660,750,318.73	213,004,935.20
期末可供分配基金份额利润	2.9747	2.8916
期末基金资产净值	4,029,658,903.99	326,581,363.92
期末基金份额净值	4.505	4.433
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	430.71%	-9.86%

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，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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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）。

4、本基金自 2021 年 10 月 18 日起新增 C 类基金份额。

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

华安安信消费混合 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
过去一个月	-1.79%	0.63%	-6.24%	0.60%	4.45%	0.03%
过去三个月	1.76%	0.80%	-8.03%	0.83%	9.79%	-0.03%
过去六个月	11.95%	0.96%	-10.89%	1.06%	22.84%	-0.10%
过去一年	2.46%	0.82%	-19.64%	0.99%	22.10%	-0.17%
过去三年	10.34%	0.99%	-48.30%	1.22%	58.64%	-0.23%
自基金合同生效起至今	430.71%	1.57%	45.22%	1.42%	385.49%	0.15%

华安安信消费混合 C

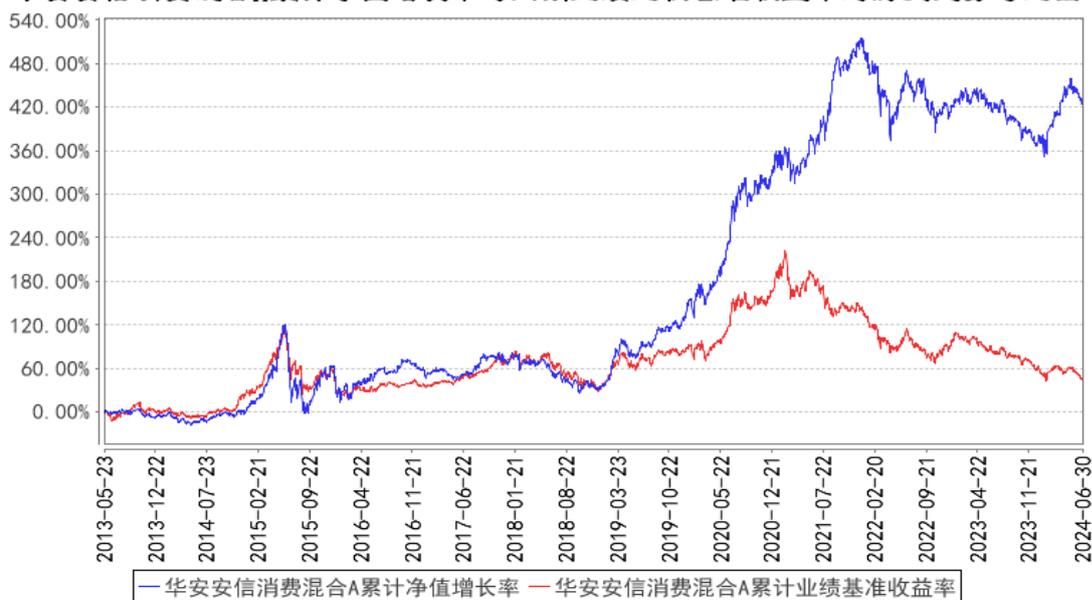
阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-1.84%	0.63%	-6.24%	0.60%	4.40%	0.03%
过去三个月	1.60%	0.79%	-8.03%	0.83%	9.63%	-0.04%
过去六个月	11.61%	0.96%	-10.89%	1.06%	22.50%	-0.10%
过去一年	1.84%	0.82%	-19.64%	0.99%	21.48%	-0.17%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-9.86%	0.96%	-40.09%	1.17%	30.23%	-0.21%

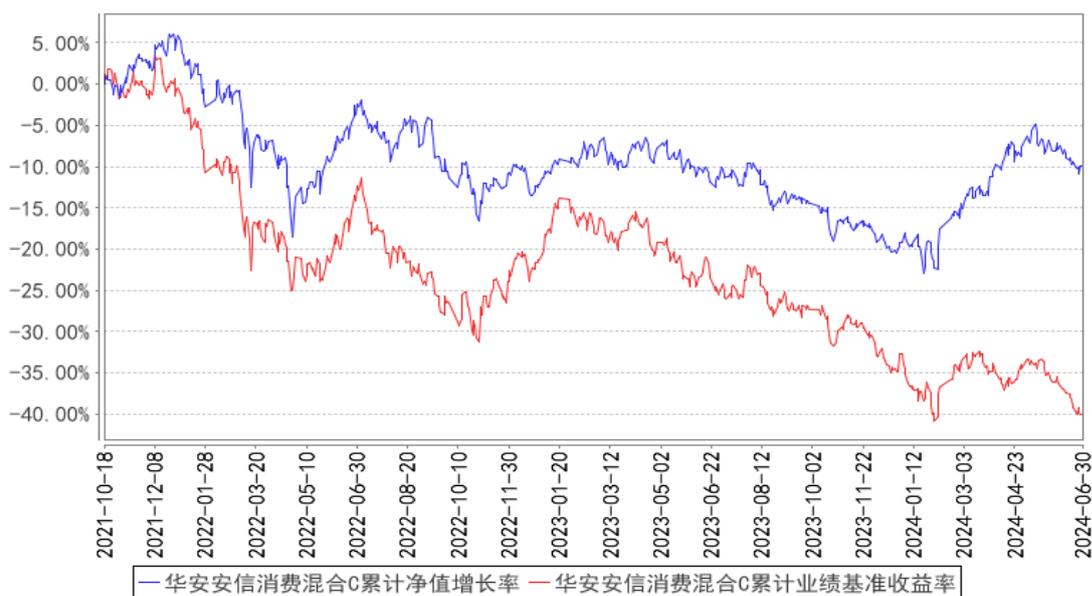
注：本基金 2021 年 10 月 18 日起新增 C 类基金份额。

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

华安安信消费混合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



华安安信消费混合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



注：华安安信消费服务混合型证券投资基金自 2021 年 10 月 18 日起新增 C 类基金份额。

§ 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 2024 年 6 月 30 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 263 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,651.01 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	2018 年 10 月 31 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，由集中交易部对外进行申报。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比例分配原则进行分配。（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。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组

合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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。

4.3.2 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 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

本报告期，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板综合指数下跌 15.63%。行业方面，银行、煤炭、公用事业等行业表现较好，计算机、商贸零售、社会服务等行业表现一般。

本报告期，本基金主要抓住了汽车、公用事业、交通运输等行业的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 4.505 元，C 类份额净值为 4.433 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 11.95%，同期业绩比较基准增长率为-10.89%，C 类份额净值增长率为 11.61%，同期业绩比较基准增长率为-10.89%。

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。

出口方面，当前整体情况稳中有进，出口表现较强的韧性，而且在结构上不断优化。从结构上来看，除了传统出口品类有较稳健的增长外，汽车、船舶等高技术高附加值的产品保持较快的增长。出口市场也不断优化，新兴市场贸易合作更加深入，比例提升。展望下一阶段，外部环境有不确定性，出口企业保持目前较好态势的情况下也在不断面临挑战。优质企业在外环境复杂性提升的情况下，更能凸显出自身的企业价值，在中长期的竞争中脱颖而出。

内需方面，在下一阶段，设备更新和消费品以旧换新预期会较好激发相关领域的潜在需求，对汽车、家电等消费品的需求有较好的提振作用。我们要寻找改善型消费方向的机会，要在文化娱乐消费、旅游消费、居住服务消费、体育消费、教育和培训消费等细分领域学习和研究，深入挖掘相应的投资机会。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安安信消费服务混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	674,678,531.17	331,608,838.27
结算备付金		3,240,535.37	5,132,670.29
存出保证金		331,411.42	670,501.45
交易性金融资产	6.4.7.2	3,692,937,824.00	3,772,178,942.21
其中：股票投资		3,692,937,824.00	3,772,178,942.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		8.52	6,090,352.98
应收股利		-	-
应收申购款		5,888,304.32	4,369,812.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,377,076,614.80	4,120,051,117.77
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10.40	2,885,836.11
应付赎回款		10,125,169.94	23,280,819.17
应付管理人报酬		4,432,823.99	4,305,241.70
应付托管费		738,804.00	717,540.27
应付销售服务费		158,780.63	150,697.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,380,757.93	9,420,792.91
负债合计		20,836,346.89	40,760,927.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	953,084,598.51	998,520,315.07
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,403,155,669.40	3,080,769,875.40
净资产合计		4,356,240,267.91	4,079,290,190.47
负债和净资产总计		4,377,076,614.80	4,120,051,117.77

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 968,112,155.04 份，其中华安安信消费混合 A 份额净值 4.505 元，基金份额总额 894,448,348.59 份；华安安信消费混合 C 份额净值 4.433 元，基金份额总额 73,663,806.45 份。

6.2 利润表

会计主体：华安安信消费服务混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		505,753,320.39	185,242,164.25
1. 利息收入		976,784.48	1,255,639.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	976,784.48	1,255,639.82
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）		99,932,338.59	-86,452,741.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	51,445,739.58	-133,483,311.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	716.54
资产支持证券 投资收益		-	-
贵金属投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	48,486,599.01	47,029,852.74
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）	6.4.7.14	404,012,304.62	268,236,882.01
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.15	831,892.70	2,202,384.36
减：二、营业总支出		31,368,679.15	56,537,575.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,027,342.48	46,582,285.02
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,337,890.41	7,763,714.18

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	871,737.06	2,041,674.78
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	0.76
8. 其他费用	6.4.7.17	131,709.20	149,900.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		474,384,641.24	128,704,589.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		474,384,641.24	128,704,589.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		474,384,641.24	128,704,589.10

6.3 净资产变动表

会计主体：华安安信消费服务混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	998,520,315.07	-	3,080,769,875.40	4,079,290,190.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	998,520,315.07	-	3,080,769,875.40	4,079,290,190.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-45,435,716.56	-	322,385,794.00	276,950,077.44
（一）、综合收益总额	-	-	474,384,641.24	474,384,641.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-45,435,716.56	-	151,998,847.24	-197,434,563.80

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	218,963,627.88	-	759,750,567.29	978,714,195.17
2. 基金赎回款	- 264,399,344.44	-	- 911,749,414.53	- 1,176,148,758.97
(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	953,084,598.51	-	3,403,155,669.40	4,356,240,267.91
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	1,649,385,993.37	-	5,617,255,296.67	7,266,641,290.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,649,385,993.37	-	5,617,255,296.67	7,266,641,290.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 403,362,962.52	-	- 1,305,548,357.13	- 1,708,911,319.65
(一)、综合收益总额	-	-	128,704,589.10	128,704,589.10
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	- 403,362,962.52	-	- 1,434,252,946.	- 1,837,615,908.7

(净资产减少以“-”号填列)			23	5
其中：1. 基金申购款	262,702,409.29	-	934,801,702.34	1,197,504,111.63
2. 基金赎回款	- 666,065,371.81	-	- 2,369,054,648.57	- 3,035,120,020.38
(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	1,246,023,030.85	-	4,311,706,939.54	5,557,729,970.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

朱学华

朱学华

陈松一

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安安信消费服务混合型证券投资基金(原名为华安安信消费服务股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)由安信证券投资基金(以下简称“基金安信”)转型而成。依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]590号核准的《安信证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议》,基金安信由封闭式基金转为开放式基金。原基金安信为契约式封闭式基金,存续期限至2013年5月22日止。根据上交所上证基字[2013]120号《关于终止安信证券投资基金上市的决定》,自2013年5月23日起,原基金安信终止上市,原基金安信更名为华安安信消费服务股票型证券投资基金(以下简称“安信消费服务股票基金”)。《安信证券投资基金基金合同》失效的同时《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为

契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金安信于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,085,987,601.95 元，已于安信消费服务股票基金的基金合同生效日全部转为安信消费服务股票基金的基金资产净值。根据《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安信证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定，安信消费服务股票基金于 2013 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.016880461，并于 2013 年 6 月 25 日进行了变更登记。

安信消费服务股票基金自 2013 年 5 月 29 日至 2013 年 6 月 19 日期间内开放集中申购，共募集集中申购资金人民币 911,286,695.29 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息人民币 459,327.86 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 358 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 6 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 911,286,695.29 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 459,327.86 份基金份额，并于 2013 年 6 月 25 日进行了确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安安信消费服务股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安安信消费服务混合型证券投资基金。

根据基金管理人华安基金管理有限公司 2021 年 10 月 18 日《关于旗下部分基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2021 年 10 月 18 日起对本基金现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额自动转换为 A 类基金份额，并相应修改法律文件。在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。投资者可自行选择申购的基金份额类别。本基金 A 类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，C 类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，由于基金费用的不同，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。C 类基金份额的初始基金份额净值与当日 A 类基金份额的基金份额净值一致。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安信消费服务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，包括国内依法发行上市的 A 股股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证、权证等)、债券(包括中小企业私募债券等)、货币市场工具、资产支持证券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的相关规定。本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%，其中，持有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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率。

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 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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》、《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[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]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。

(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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	674,678,531.17
等于：本金	674,613,023.07
加：应计利息	65,508.10
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	674,678,531.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		3,433,662,920.29	-	3,692,937,824.00	259,274,903.71
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		3,433,662,920.29	-	3,692,937,824.00	259,274,903.71

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	23,394.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,854,703.81
其中：交易所市场	3,854,703.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	252,659.75
合计	5,380,757.93

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安安信消费混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	949,807,258.61	933,848,308.74
本期申购	173,287,202.16	170,377,088.04
本期赎回（以“-”号填列）	-228,646,112.18	-224,804,604.72
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	894,448,348.59	879,420,792.06

华安安信消费混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,672,006.33	64,672,006.33
本期申购	48,586,539.84	48,586,539.84
本期赎回（以“-”号填列）	-39,594,739.72	-39,594,739.72
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	73,663,806.45	73,663,806.45

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安安信消费混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,758,394,025.16	130,164,292.21	2,888,558,317.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,758,394,025.16	130,164,292.21	2,888,558,317.37
本期利润	64,790,300.74	381,036,803.03	445,827,103.77
本期基金份额交易产生的变动数	-162,434,007.17	-21,713,302.04	-184,147,309.21
其中：基金申购款	494,067,957.95	102,250,982.60	596,318,940.55
基金赎回款	-656,501,965.12	-123,964,284.64	-780,466,249.76
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,660,750,318.73	489,487,793.20	3,150,238,111.93
-----	------------------	----------------	------------------

华安安信消费混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	183,350,514.04	8,861,043.99	192,211,558.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	183,350,514.04	8,861,043.99	192,211,558.03
本期利润	5,582,035.88	22,975,501.59	28,557,537.47
本期基金份额交易产生的变动数	24,072,385.28	8,076,076.69	32,148,461.97
其中：基金申购款	134,489,223.97	28,942,402.77	163,431,626.74
基金赎回款	-110,416,838.69	-20,866,326.08	-131,283,164.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,004,935.20	39,912,622.27	252,917,557.47

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	953,714.38
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	19,228.58
其他	3,841.52
合计	976,784.48

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	51,445,739.58
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	51,445,739.58

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,315,363,613.45
减：卖出股票成本总额	2,258,643,256.79
减：交易费用	5,274,617.08
买卖股票差价收入	51,445,739.58

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	48,486,599.01
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	48,486,599.01

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	404,012,304.62
股票投资	404,012,304.62
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	404,012,304.62

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	831,892.70
合计	831,892.70

注：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。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	52,987.41
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	300.63
账户维护费	18,000.00
其他	748.82
合计	131,709.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,027,342.48	46,582,285.02
其中：应支付销售机构的客户维 护费	8,321,851.15	12,352,577.12
应支付基金管理人的净管理费	17,705,491.33	34,229,707.90

注：自 2023 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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,337,890.41	7,763,714.18

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金托管人中国工商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工商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：

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

6.4.10.2.3 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安信消费混合 A	华安安信消费混合 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	3,453.23	3,453.23
华安基金管理有限公司	-	173,310.40	173,310.40
中国工商银行股份有限公司	-	968.13	968.13
合计	-	177,731.76	177,731.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安信消费混合 A	华安安信消费混合 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	9,277.34	9,277.34
华安基金管理有限公司	-	368,696.88	368,696.88
中国工商银行股份有限公司	-	3.00	3.00
合计	-	377,977.22	377,977.22

注：

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额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：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	674,678,531.17	953,714.38	648,273,523.36	1,201,435.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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）	总金额

				位：股/ 张)	
国泰君安证券股份有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安证券股份有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安证券股份有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	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	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	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	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	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001359	平	2024	1-6 个	新股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

	安电工	年3月19日	月(含)	限售						
001379	腾达科技	2024年1月11日	1-6个月(含)	新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年06月03日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024年3月26日	1-6个月(含)	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	1-6个月(含)	新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	1-6个月(含)	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	1-6个月(含)	新股限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	1-6个月(含)	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年05月22日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	1-6个月(含)	新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中	2024	1-6个月	新股	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-

	仑新材	年6月13日	月(含)	限售						
301587	中瑞股份	2024年3月27日	1-6个月(含)	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	1-6个月(含)	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024年05月30日	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	1-6个月(含)	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月(含)	新股限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
603082	北自科技	2024年1月23日	1-6个月(含)	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1-6个月(含)	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	1-6个月(含)	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-

603325	博隆技术	2024年1月3日	1-6个月(含)	新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	1-6个月(含)	新股限售	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024年3月13日	1-6个月(含)	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	1-6个月(含)	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	1-6个月(含)	新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	1-6个月(含)	新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	1-6个月(含)	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创投	2024年3月6日	1-6个月(含)	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

	份	日								
688709	成都 华 微	2024 年 1 月 31 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 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高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会、实现基金资产的长期稳健增值。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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行中国工商银行，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 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 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 2024 年 6 月 30 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并且不计息，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。

6.4.13.3.1 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、流通受限制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，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 6.4.12。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。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	674,678,531.17	-	-	-	674,678,531.17
结算备付金	3,240,535.37	-	-	-	3,240,535.37
存出保证金	331,411.42	-	-	-	331,411.42
交易性金融资产	-	-	-	3,692,937,824.00	3,692,937,824.00
应收申购款	154,735.78	-	-	5,733,568.54	5,888,304.32
应收清算款	-	-	-	8.52	8.52
资产总计	678,405,213.74	-	-	3,698,671,401.06	4,377,076,614.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,125,169.94	10,125,169.94
应付管理人报酬	-	-	-	4,432,823.99	4,432,823.99
应付托管费	-	-	-	738,804.00	738,804.00
应付清算款	-	-	-	10.40	10.40
应付销售服务费	-	-	-	158,780.63	158,780.63
其他负债	-	-	-	5,380,757.93	5,380,757.93
负债总计	-	-	-	20,836,346.89	20,836,346.89
利率敏感度缺口	678,405,213.74	-	-	3,677,835,054.17	4,356,240,267.91
上年度末 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	331,608,838.27	-	-	-	331,608,838.27
结算备付金	5,132,670.29	-	-	-	5,132,670.29

存出保证金	670,501.45	-	-	-	670,501.45
交易性金融资产	-	-	-	-3,772,178,942.21	3,772,178,942.21
应收申购款	24,753.85	-	-	4,345,058.72	4,369,812.57
应收清算款	-	-	-	6,090,352.98	6,090,352.98
资产总计	337,436,763.86	-	-	-3,782,614,353.91	4,120,051,117.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,280,819.17	23,280,819.17
应付管理人报酬	-	-	-	4,305,241.70	4,305,241.70
应付托管费	-	-	-	717,540.27	717,540.27
应付清算款	-	-	-	2,885,836.11	2,885,836.11
应付销售服务费	-	-	-	150,697.14	150,697.14
其他负债	-	-	-	9,420,792.91	9,420,792.91
负债总计	-	-	-	40,760,927.30	40,760,927.30
利率敏感度缺口	337,436,763.86	-	-	-3,741,853,426.61	4,079,290,190.47

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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，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。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。本基金持有的股票资产占基金资产的 60%-

95%；除股票以外的其他资产占基金资产的 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	3,692,937,824.00	84.77	3,772,178,942.21	92.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	3,692,937,824.00	84.77	3,772,178,942.21	92.47

6.4.13.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	115,080,942.81	117,217,426.67
业绩比较基准下降 5%	-115,080,942.81	-117,217,426.67	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,692,421,895.80	3,768,848,360.22
第二层次	45,611.11	-
第三层次	470,317.09	3,330,581.99
合计	3,692,937,824.00	3,772,178,942.21

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	3,692,937,824.00	84.37
	其中：股票	3,692,937,824.00	84.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	677,919,066.54	15.49
8	其他各项资产	6,219,724.26	0.14
9	合计	4,377,076,614.80	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	25,975.85	0.00
B	采矿业	214,114,371.25	4.92
C	制造业	1,935,015,599.97	44.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	839,089,793.77	19.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	45,595,965.50	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	510,402,234.97	11.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,733,721.25	1.46
J	金融业	55,129,368.00	1.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,506,728.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	6,620.80	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	0.00

0	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	18,297,366.96	0.42
S	综合	-	-
	合计	3,692,937,824.00	84.77

7.2.2 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。

7.3 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	600886	国投电力	10,909,910	198,996,758.40	4.57
2	600519	贵州茅台	116,126	170,402,131.14	3.91
3	601058	赛轮轮胎	11,983,087	167,763,218.00	3.85
4	600795	国电电力	25,833,200	154,740,868.00	3.55
5	600023	浙能电力	21,668,155	154,060,582.05	3.54
6	600968	海油发展	35,229,200	145,144,304.00	3.33
7	600066	宇通客车	5,187,900	133,847,820.00	3.07
8	601111	中国国航	16,855,000	124,389,900.00	2.86
9	601872	招商轮船	14,433,800	121,965,610.00	2.80
10	688169	石头科技	310,517	121,908,974.20	2.80
11	002078	太阳纸业	7,945,819	110,844,175.05	2.54
12	600026	中远海能	6,261,115	97,736,005.15	2.24
13	002422	科伦药业	2,895,300	87,814,449.00	2.02
14	002594	比亚迪	347,600	86,986,900.00	2.00
15	000883	湖北能源	13,186,900	79,253,269.00	1.82
16	601601	中国太保	1,978,800	55,129,368.00	1.27
17	600398	海澜之家	5,869,407	54,233,320.68	1.24
18	600529	山东药玻	2,023,885	51,285,245.90	1.18
19	002517	恺英网络	5,347,165	51,065,425.75	1.17
20	600276	恒瑞医药	1,324,096	50,924,732.16	1.17
21	600642	申能股份	5,667,600	50,044,908.00	1.15
22	300705	九典制药	1,793,120	47,948,028.80	1.10
23	002608	江苏国信	6,009,100	46,570,525.00	1.07
24	000333	美的集团	705,400	45,498,300.00	1.04
25	600236	桂冠电力	5,900,560	45,257,295.20	1.04
26	601567	三星医疗	1,242,900	43,501,500.00	1.00
27	600332	白云山	1,468,700	43,076,971.00	0.99
28	000338	潍柴动力	2,630,600	42,720,944.00	0.98
29	601919	中远海控	2,755,900	42,688,891.00	0.98

30	605499	东鹏饮料	196,100	42,308,575.00	0.97
31	601021	春秋航空	734,980	41,401,423.40	0.95
32	601126	四方股份	2,141,850	41,166,357.00	0.94
33	601918	新集能源	3,385,771	33,011,267.25	0.76
34	002588	史丹利	4,317,400	32,510,022.00	0.75
35	002752	昇兴股份	6,218,900	31,467,634.00	0.72
36	603707	健友股份	2,505,400	29,764,152.00	0.68
37	603885	吉祥航空	2,586,608	28,426,821.92	0.65
38	600521	华海药业	1,625,307	27,711,484.35	0.64
39	002444	巨星科技	1,085,446	26,810,516.20	0.62
40	300866	安克创新	376,220	26,790,626.20	0.61
41	600420	国药现代	2,430,500	25,957,740.00	0.60
42	000543	皖能电力	2,725,842	24,123,701.70	0.55
43	002463	沪电股份	633,410	23,119,465.00	0.53
44	600285	羚锐制药	927,000	22,442,670.00	0.52
45	300396	迪瑞医疗	1,056,186	21,451,137.66	0.49
46	000902	新洋丰	1,766,302	20,966,004.74	0.48
47	688981	中芯国际	449,249	20,710,378.90	0.48
48	603128	华贸物流	3,579,650	20,654,580.50	0.47
49	002262	恩华药业	855,100	20,300,074.00	0.47
50	600988	赤峰黄金	1,232,600	20,140,684.00	0.46
51	600761	安徽合力	921,500	19,941,260.00	0.46
52	603187	海容冷链	1,702,458	19,850,660.28	0.46
53	600575	淮河能源	5,098,700	19,833,943.00	0.46
54	605090	九丰能源	681,000	19,749,000.00	0.45
55	600750	江中药业	817,500	18,892,425.00	0.43
56	603368	柳药集团	1,063,725	18,615,187.50	0.43
57	600211	西藏药业	561,265	18,286,013.70	0.42
58	000403	派林生物	656,400	17,499,624.00	0.40
59	600887	伊利股份	646,968	16,717,653.12	0.38
60	000028	国药一致	489,500	15,776,585.00	0.36
61	300303	聚飞光电	3,216,462	15,632,005.32	0.36
62	600373	中文传媒	1,026,700	15,236,228.00	0.35
63	002020	京新药业	1,412,100	14,784,687.00	0.34
64	002911	佛燃能源	1,604,485	14,664,992.90	0.34
65	601333	广深铁路	4,106,500	13,305,060.00	0.31
66	002558	巨人网络	1,314,013	12,404,282.72	0.28
67	600027	华电国际	1,669,808	11,588,467.52	0.27
68	002027	分众传媒	1,898,800	11,506,728.00	0.26
69	601607	上海医药	586,300	11,204,193.00	0.26
70	002475	立讯精密	270,700	10,641,217.00	0.24
71	002884	凌霄泵业	549,700	10,554,240.00	0.24
72	600150	中国船舶	250,535	10,199,279.85	0.23

73	600509	天富能源	1,756,900	9,680,519.00	0.22
74	600183	生益科技	459,000	9,666,540.00	0.22
75	000521	长虹美菱	1,268,700	9,616,746.00	0.22
76	603689	皖天然气	1,147,600	9,433,272.00	0.22
77	300832	新产业	132,400	8,929,056.00	0.20
78	600028	中国石化	1,382,800	8,739,296.00	0.20
79	002170	芭田股份	1,308,800	7,865,888.00	0.18
80	300673	佩蒂股份	594,400	7,798,528.00	0.18
81	000977	浪潮信息	201,300	7,321,281.00	0.17
82	601001	晋控煤业	428,500	7,078,820.00	0.16
83	000600	建投能源	1,032,834	6,506,854.20	0.15
84	300314	戴维医疗	608,900	6,296,026.00	0.14
85	603298	杭叉集团	302,680	5,944,635.20	0.14
86	603393	新天然气	169,920	5,903,020.80	0.14
87	600578	京能电力	1,815,000	5,880,600.00	0.13
88	605377	华旺科技	380,800	5,045,600.00	0.12
89	002668	TCL 智家	541,400	4,905,084.00	0.11
90	002035	华帝股份	573,600	3,573,528.00	0.08
91	601928	凤凰传媒	279,301	3,061,138.96	0.07
92	603229	奥翔药业	292,500	2,939,625.00	0.07
93	300389	艾比森	236,200	2,900,536.00	0.07
94	600483	福能股份	226,000	2,635,160.00	0.06
95	688581	安杰思	36,219	1,772,195.67	0.04
96	600499	科达制造	183,200	1,544,376.00	0.04
97	300750	宁德时代	7,900	1,422,237.00	0.03
98	603296	华勤技术	8,295	458,132.85	0.01
99	002732	燕塘乳业	31,500	455,805.00	0.01
100	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
101	688061	灿瑞科技	5,918	162,626.64	0.00
102	688584	上海合晶	8,659	141,955.59	0.00
103	688029	南微医学	2,195	135,124.20	0.00
104	002606	大连电瓷	14,600	109,646.00	0.00
105	688623	双元科技	1,776	99,864.48	0.00
106	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.00
107	301296	新巨丰	10,411	75,063.31	0.00
108	301388	欣灵电气	2,920	72,153.20	0.00
109	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.00
110	688469	芯联集成	13,800	54,648.00	0.00
111	688657	浩辰软件	1,472	54,405.12	0.00
112	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
113	605296	神农集团	739	25,975.85	0.00
114	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
115	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00

116	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
117	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
118	301565	中仑新材	803	15,810.42	0.00
119	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
120	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
121	689009	九号公司	357	13,141.17	0.00
122	301439	泓淋电力	949	12,023.83	0.00
123	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
124	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
125	300973	立高食品	360	10,112.40	0.00
126	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
127	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
128	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
129	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
130	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
131	301520	万邦医药	160	6,620.80	0.00
132	603170	宝立食品	542	6,438.96	0.00
133	301373	凌玮科技	277	6,315.60	0.00
134	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
135	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
136	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
137	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
138	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
139	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
140	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
141	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
142	001326	联域股份	99	3,550.14	0.00
143	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
144	603075	热威股份	182	3,212.30	0.00
145	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
146	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
147	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
148	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
149	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601872	招商轮船	116,580,701.43	2.86
2	600066	宇通客车	109,687,333.00	2.69
3	002594	比亚迪	81,561,440.00	2.00
4	002517	恺英网络	60,885,862.27	1.49

5	002078	太阳纸业	59,082,046.80	1.45
6	601601	中国太保	57,857,811.00	1.42
7	600803	新奥股份	57,809,293.00	1.42
8	600023	浙能电力	48,952,458.00	1.20
9	600795	国电电力	48,226,214.00	1.18
10	002422	科伦药业	47,860,545.00	1.17
11	600332	白云山	46,484,710.00	1.14
12	601919	中远海控	44,520,276.00	1.09
13	600642	申能股份	41,424,299.00	1.02
14	600236	桂冠电力	38,235,843.48	0.94
15	601918	新集能源	37,960,932.51	0.93
16	600519	贵州茅台	36,738,649.00	0.90
17	002752	昇兴股份	36,409,917.48	0.89
18	688169	石头科技	36,081,291.65	0.88
19	000600	建投能源	34,319,627.26	0.84
20	603707	健友股份	32,350,856.52	0.79

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。

7.4.2 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	601601	中国太保	150,923,688.82	3.70
2	000338	潍柴动力	131,930,600.68	3.23
3	600011	华能国际	127,310,329.34	3.12
4	600276	恒瑞医药	99,832,228.68	2.45
5	000543	皖能电力	96,160,244.91	2.36
6	002984	森麒麟	92,801,582.34	2.27
7	600803	新奥股份	81,355,865.99	1.99
8	600900	长江电力	80,015,985.48	1.96
9	601688	华泰证券	79,576,036.16	1.95
10	601058	赛轮轮胎	77,224,357.00	1.89
11	600026	中远海能	71,363,178.50	1.75
12	600030	中信证券	61,594,220.38	1.51
13	600161	天坛生物	56,327,863.72	1.38
14	603259	药明康德	55,635,457.65	1.36
15	600968	海油发展	53,711,685.00	1.32
16	600566	济川药业	51,518,373.14	1.26
17	301035	润丰股份	50,110,910.00	1.23
18	600027	华电国际	43,459,852.00	1.07
19	600066	宇通客车	39,534,868.52	0.97
20	000429	粤高速 A	39,328,831.66	0.96

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。

7.4.3 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	1,775,389,833.96
卖出股票收入（成交）总额	2,315,363,613.45

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	331,411.42
2	应收清算款	8.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,888,304.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,219,724.26

7.12.4 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。

7.12.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
华安安信消费混合 A	371,701	2,406.37	128,629,161.28	14.38	765,819,187.31	85.62
华安安信消费混合 C	44,929	1,639.56	28,866,495.61	39.19	44,797,310.84	60.81
合计	416,630	2,323.67	157,495,656.89	16.27	810,616,498.15	83.73

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）。

8.2 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	华安安信消费混合 A	581,391.71	0.07
	华安安信消费混合 C	259,435.26	0.35
	合计	840,826.97	0.09

8.3 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	华安安信消费混合 A	-
	华安安信消费混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华安安信消费混合 A	0~10
	华安安信消费混合 C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安安信消费混合 A	华安安信消费混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 23 日）基金份额总额	2,000,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	949,807,258.61	64,672,006.33
本报告期基金总申购份额	173,287,202.16	48,586,539.84
减：本报告期基金总赎回份额	228,646,112.18	39,594,739.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	894,448,348.59	73,663,806.45

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

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：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 (%)	
海通证券	1	1,577,658.0	38.58	1,492,314.0	38.71	-

		89.78		4		
国信证券	2	838,259,133.71	20.50	790,438.24	20.51	-
申万宏源	2	782,669,472.34	19.14	732,501.97	19.00	-
招商证券	1	626,738,530.04	15.33	592,822.57	15.38	-
银河证券	1	147,418,347.16	3.61	137,972.55	3.58	-
中银国际	1	116,095,287.59	2.84	108,654.44	2.82	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

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，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范、具备健全的内控制度；

(2) 研究服务能力较强，有较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，能够针对本基金投资运作管理需要，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) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(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尽职调查

由相关部门牵头依据上述交易单元选择标准及相关内控制度要求，对候选券商开展尽职调查。

(2) 完成候选券商的准入评估

对候选券商的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力等进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成券商准入。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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：

无。

10.7.2 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的比例 (%)	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 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	华安基金管理有限公司关于旗下基	中国证监会基金电子披	2024 年 1 月 12 日

	金投资关联方承销证券的公告（永兴股份）	露网站和公司网站等指定媒介	
2	华安安信消费服务混合 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 19 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（北自科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 1 月 24 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（肯特股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 21 日
5	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（龙旗科技）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 2 月 24 日
6	华安安信消费服务混合更新的招募说明书(2024 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 1 日
7	华安安信消费混合 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 1 日
8	华安安信消费混合 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 1 日
9	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 12 日
10	华安安信消费服务混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
11	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 3 月 27 日
12	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
13	华安安信消费混合 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 4 月 22 日
14	华安安信消费混合 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 日
15	华安安信消费混合 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 28 日

16	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（键邦股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2024 年 6 月 29 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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安信消费服务混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安信消费服务混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安信消费服务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；

12.2 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>。

12.3 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 8 月 31 日