

华安安禧灵活配置混合型证券投资基金
2021 年第 3 季度报告
2021 年 9 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安禧灵活配置混合
基金主代码	002398
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 23 日
报告期末基金份额总额	155,775,579.67 份
投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金为混合型基金，在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例；当市场环境发生变化时，本基金将依托仓位

	<p>弹性优势并借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，对大类资产配置比例进行及时调整。</p> <p>此外，本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。</p>	
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×60% + 中国债券总指数收益率×40%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。</p>	
基金管理人	<p>华安基金管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>中国建设银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>华安安禧灵活配置混合 A</p>	<p>华安安禧灵活配置混合 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>002398</p>	<p>002399</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>148,839,740.07 份</p>	<p>6,935,839.60 份</p>

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)	
	华安安禧灵活配置混合 A	华安安禧灵活配置混合 C
1.本期已实现收益	11,410,369.48	440,921.47
2.本期利润	-13,108,738.00	-587,432.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0589	-0.0613
4.期末基金资产净值	183,723,798.67	8,304,878.52

5.期末基金份额净值	1.2344	1.1974
------------	--------	--------

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、华安安禧灵活配置混合 A：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.30%	0.41%	-3.61%	0.72%	-0.69%	-0.31%
过去六个月	0.52%	0.39%	-1.48%	0.66%	2.00%	-0.27%
过去一年	6.71%	0.43%	4.67%	0.73%	2.04%	-0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	17.79%	0.29%	31.27%	0.78%	-13.48%	-0.49%

2、华安安禧灵活配置混合 C：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.44%	0.42%	-3.61%	0.72%	-0.83%	-0.30%
过去六个月	0.22%	0.39%	-1.48%	0.66%	1.70%	-0.27%
过去一年	6.07%	0.43%	4.67%	0.73%	1.40%	-0.30%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	15.80%	0.29%	31.27%	0.78%	-15.47%	-0.49%

3.2.2 自基金转型以来 基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安禧灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018 年 10 月 23 日至 2021 年 9 月 30 日)

1. 华安安禧灵活配置混合 A:



2. 华安安禧灵活配置混合 C:



§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	2016-04-13	-	14 年	金融工程硕士，具有基金从业资格证书，14 年基金行业从业经历。2007 年 7 月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务。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 月起，同时担任华安汇财通货币市场基金、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 月起，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 月起，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 月起，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 月起，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 月起，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、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。
陆秋渊	本基金的基金经理	2018-09-03	2021-08-16	14 年	复旦大学经济学硕士研究生，14 年基金行业从业经验。2007 年 7 月应届毕业生进入华安基金，历任全球投资部研究员、投资经理。2017 年 6 月起，担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 9 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 2021 年 8 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。2018 年 10 月起，同时担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安沪港深优选混合型证券投资基金的基金经理。
谢昌旭	本基金的基金经理	2020-07-06	2021-08-16	9 年	硕士研究生，9 年基金及相关行业从业经验。曾任融通基金管理有限公司研究员、平安养老保险股份有限公司权益投资经理。2018 年 9 月加入华安基金，2018 年 10 月起，担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。2019 年 3 月起，同时担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，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。2019 年 11 月至 2021 年 8 月，同时担任华安安华灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 4 月起，同时担任华安医疗创新混合型证券投资基金的基金经理。2020

					年 7 月至 2021 年 8 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。
舒灏	本基金的基金经理	2021-08-16	-	13 年	硕士研究生，13 年证券、基金行业从业经验。曾任海通证券股份有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2018 年 7 月至 2019 年 6 月，同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 6 月起，同时担任华安稳健回报混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 12 月起，同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 1 月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起，同时担任华安安利混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月起，同时担任华安添禧一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起，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。

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《证券业从业人员资格管理办法》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，除个别指标因申购赎回或市场波动原因导致不符合基金合同并将在规定的时间内进行调整外，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系

统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2020 年上涨后，2021 年前三季度 A 股经历了较大的震荡，年初在基金发行加快、年报预告超预期等因素刺激下，食品饮料、医药等核心资产带动指数快速拉升。春节后行情发生逆转，随着美债利率上升，全球权益市场波动加大，核心资产大幅回调，而中小市值公司则低位企稳，周期、环保等板块领涨。3 月中旬以后市场企稳反弹，消费、新能源、电子等高景气度板块轮番上涨。三季度以来高位的新能源等板块大幅波动，而底部的周期、消费等板块有所反弹。

今年市场大幅波动，市场风格切换频繁，我们认为主要原因在于：一是美债收益率波动较大，及大宗商品价格剧烈波动，通胀压力显现，市场担心全球流动性收紧，对估值在高位的板块形成压力；二是随着疫情逐步好转，部分低位的周期行业和制造业企业盈利加速，估值优势凸显；三是进入三季度，市场对下半年及明年的中美经济政策、经济走向存在较大分歧。

本基金 2021 年三季度整体维持了中性仓位，仓位均衡集中在军工、新能源、消费、制造业等板块。债券方面，本基金保持了对利率债和高等级信用债的基本配置，动态调整组合久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 9 月 30 日，华安安禧灵活配置 A 份额净值为 1.2344 元，C 份额净值为 1.1974 元；华安安禧灵活配置 A 份额净值增长率为-4.30%，C 份额净值增长率为-4.44%，同期业绩比较基准增长率为-3.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受疫情影响，2020 年全球经济都经受了较大打击，2021 年上半年，随着疫苗逐步普及，全球疫情逐步得到缓解，加上西方国家货币普遍超发，需求改善，而供给受疫情影响，在经济复苏背景下，全球大宗商品加速上涨，未来随着美国刺激政策逐步退出，大宗商品价格预计上涨幅度有限，通胀虽有压力但仍整体可控。

二季度以来，中国部分经济数据指标出现见顶回落，随着海外刺激政策逐步退出，国内出口

预计明年将面临一定压力，地产基建整体平稳，综合来看，三季度开始，国内经济增速开始温和向下。在此背景下，预计国内政策环境仍将维持相对宽松的格局。

在经济承压，政策相对宽松的背景下，我们判断未来一段时间股票指数整体上涨空间有限，但结构性机会仍将层出不穷。不同于去年疫情环境下全球经济停摆的状态，今年诸多行业都有明显复苏，股市也呈现出更多板块性机会。

今年四季度到明年，我们看好：一是景气度向上，具备长期发展空间，且估值相对较低的制造业公司，包括部分机械基础件、油气装备等板块的龙头公司；二是短期高景气度，且未来政策支持，长期前景向好的新兴行业，包括军工、新能源等；三是部分低估值板块的估值修复机会，随着全球经济回暖，国内碳中和政策落实，以及一带一路政策的推进，部分行业估值有望得到修复，如环保、建筑等。未来我们仍将积极寻找符合中国经济发展方向，且业绩确定的成长性行业，筛选优质公司股票进行布局。

债券方面，货币市场利率在四季度将继续围绕政策利率波动，整体中枢或有所上行，利率债收益率预计震荡上行，高等级信用债跟随利率债波动，仍需警惕中低等级信用债风险。本基金将动态调整组合杠杆水平和久期，维持高信用等级策略。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

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	37,726,434.08	17.37
	其中：股票	37,726,434.08	17.37
2	固定收益投资	147,616,719.80	67.98
	其中：债券	147,616,719.80	67.98

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	28,507,775.12	13.13
7	其他各项资产	3,280,392.58	1.51
8	合计	217,131,321.58	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	12,350.52	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,867,367.51	12.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,830,966.74	1.99
E	建筑业	8,300.53	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	675,043.42	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,118,936.00	0.58
J	金融业	4,042,605.00	2.11
K	房地产业	1,051,680.00	0.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,674,688.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	1,437,557.96	0.75
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	6,938.40	0.00
S	综合	-	-
	合计	37,726,434.08	19.65

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	6,700	3,522,391.00	1.83
2	600519	贵州茅台	1,700	3,111,000.00	1.62
3	002142	宁波银行	73,100	2,569,465.00	1.34
4	002487	大金重工	102,300	2,459,292.00	1.28
5	600098	广州发展	255,900	2,210,976.00	1.15
6	603259	药明康德	10,960	1,674,688.00	0.87
7	002039	黔源电力	67,000	1,608,670.00	0.84
8	600036	招商银行	29,200	1,473,140.00	0.77
9	603136	天目湖	82,700	1,401,765.00	0.73
10	300696	爱乐达	27,800	1,312,160.00	0.68

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,202,000.00	10.52
	其中：政策性金融债	20,202,000.00	10.52
4	企业债券	71,780,500.00	37.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	55,588,000.00	28.95
7	可转债（可交换债）	46,219.80	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	147,616,719.80	76.87

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	101901366	19 中化工 MTN005	200,000	20,288,000.00	10.57
2	150412	15 农发 12	200,000	20,202,000.00	10.52
3	102100069	21 首旅 MTN001	200,000	20,176,000.00	10.51
4	175628	21 锡公 01	200,000	20,154,000.00	10.50
5	175633	21 远东 S1	200,000	20,012,000.00	10.42

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

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 10 月 16 日，宁波银行因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2020〕48 号）给予罚款人民币 30 万元的行政处罚，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分。2021 年 6 月 10 日，宁波银行因代理销售保险不规范，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕36 号）给予罚款人民币 25 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违反规定办理经常项目外汇业务、违反规定办理资本项目资金收付，被国家外汇管理局宁波市分局（甬外管罚〔2021〕7 号）责令改正，给予罚款 100 万元、没收违法所得 1048476.65 元的行政处罚。2021 年 7 月 13 日，宁波银行因违规为存款人多头开立银行结算账户、占压财政存款等违法违规事项，被中国人民银行宁波市中心支行（甬银处罚字〔2021〕2 号）给予警告，并处罚款 286.2 万元的行政处罚。2021 年 7 月 30 日，宁波银行因贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严等违法违规事项，被宁波银保监局（甬银保监罚决字〔2021〕57 号）给予罚款人民币 275 万元的行政处罚，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

2020 年 11 月 27 日，招商银行因金融机构违反规定办理结汇、售汇的行为，被国家外汇管理局深圳市分局（深外管检〔2020〕92 号）责令改正、并处罚款人民币 55 万元、没收违法所得 128.82 万元人民币的行政处罚。2021 年 5 月 17 日，招商银行因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕16 号）给予罚款 7170 万元的行政处罚。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,110.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	3,241,912.18
5	应收申购款	2,369.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,280,392.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安安禧灵活配置混合 A	华安安禧灵活配置混合 C
本报告期期初基金份额总额	241,427,642.74	11,075,474.53
报告期期间基金总申购份额	276,037.38	721,702.23
减：报告期期间基金总赎回份额	92,863,940.05	4,861,337.16
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	148,839,740.07	6,935,839.60

§7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1 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	20210701-202109	66,062	0.00	25,000,0	41,062,527.	26.36%

		30	, 527.8 2		00.00	82	
	2	20210701-202109 30	61, 273 , 948.3 3	0.00	20, 000, 0 00.00	41, 273, 948. 33	26.50%
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。							

7.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安安禧灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安禧灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《华安安禧灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

8.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二一年十月二十七日