

华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金
2021 年第 4 季度报告
2021 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：二〇二二年一月二十一日

§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 2022 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安新泰利灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 003799 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 9 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 702,129,336.84 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。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。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×50% + 中债综合全价指数收益率×50% | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安新泰利灵活配置混合 A | 华安新泰利灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003799 | 003800 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 360,393,781.36 份 | 341,735,555.48 份 |

§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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 华安新泰利灵活配置混合 A | 华安新泰利灵活配置混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 14,596,070.77 | 11,568,290.27 |
| 2.本期利润 | 15,992,187.41 | 12,053,222.41 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0441 | 0.0400 |
| 4.期末基金资产净值 | 510,728,001.03 | 476,759,412.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4171 | 1.3951 |

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、华安新泰利灵活配置混合 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 | 3.20% | 0.24% | 1.31% | 0.36% | 1.89% | -0.12% |
| 过去六个月 | 4.31% | 0.33% | -0.50% | 0.47% | 4.81% | -0.14% |
| 过去一年 | 10.01% | 0.38% | 0.67% | 0.54% | 9.34% | -0.16% |
| 过去三年 | 25.68% | 0.38% | 35.15% | 0.63% | -9.47% | -0.25% |
| 过去五年 | 42.99% | 0.34% | 22.12% | 0.59% | 20.87% | -0.25% |
| 自基金合同 生效起至今 | 43.27% | 0.34% | 18.68% | 0.59% | 24.59% | -0.25% |

2、华安新泰利灵活配置混合 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 | 3.17% | 0.24% | 1.31% | 0.36% | 1.86% | -0.12% |
| 过去六个月 | 4.26% | 0.33% | -0.50% | 0.47% | 4.76% | -0.14% |
| 过去一年 | 9.91% | 0.38% | 0.67% | 0.54% | 9.24% | -0.16% |
| 过去三年 | 25.33% | 0.38% | 35.15% | 0.63% | -9.82% | -0.25% |
| 过去五年 | 40.61% | 0.34% | 22.12% | 0.59% | 18.49% | -0.25% |
| 自基金合同 生效起至今 | 40.91% | 0.34% | 18.68% | 0.59% | 22.23% | -0.25% |

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

华安新泰利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
(2016 年 12 月 9 日至 2021 年 12 月 31 日)

1. 华安新泰利灵活配置混合 A:



2. 华安新泰利灵活配置混合 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 | 2016-12-09 | - | 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。 |
| 舒灏 | 本基金的基金经理 | 2020-01-23 | - | 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，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 2 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 A 股经历了较大的分化，创业板指、中证 500 等偏科技成长和中小市值指数相对较强，上证 50、沪深 300 等大市值权重股指数相对较弱。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 月中旬到 7 月，市场企稳反弹，消费、新能源、电子等高景气度板块轮番上涨。7 月下旬到四季度初，随着政策预期波动，央行降准，经济降速预期逐步明确，而国内碳减排政策加码，导致上游资源品价格上涨，带动周期板块结构性行情；9 月下旬到年底，市场轮动加剧，前期调整较多的消费和地产金融板块得到一定修复。总体上 2021 年风格明显不同前几年，周期和制造业表现强于消费蓝筹，中小市值板块表现优于大盘股。

2021 年市场风格变换，我们认为主要原因在于：一是美债收益率波动较大，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；二是国内地产投资压力显现，但出口持续超预期，带动制造业投资相对稳定，导致前几年基本面占优的地产链相关行业出现逆转，而随着疫情逐步好转，部分低位的制造业和周期性行业盈利持续加速，估值优势凸显；三是进入四季度后，市场对稳增长的政策预期加强，导致地产链行业出现一定幅度反弹。

本基金 2021 年四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 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.4171 元，本报告期份额净值增长率为 3.20%，

同期业绩比较基准增长率为 1.31%。本基金 C 类份额净值为 1.3951 元，本报告期份额净值增长率为 3.17%，同期业绩比较基准增长率为 1.31%。

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 年全球疫情仍有反复，海外主要经济体央行都采取了较大力度刺激政策，在流动性宽裕的背景下，通胀等问题也开始显现。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。

2021 年下半年以来，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，国内出口预计将面临一定压力。未来稳增长政策有望逐步落地，地产投资预计短期仍有压力，2022 年下半年有望逐步企稳。综合来看，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。短期内，受益政策宽松的地产链预计将持续反弹，中期看，当期业绩确定，长期空间又较大的成长性行业有望获得超额收益。

2022 年一季度我们看好几个方向：一是景气度向上，具备长期发展空间，且估值相对合理的制造业公司，包括部分新能源、军工、高端装备等板块的龙头公司；二是受益维稳政策，前期跌幅较大的地产基建板块相关公司的估值修复；三是之前受损于疫情，未来随着疫情缓解，景气度回升的行业。

债券方面，预计货币市场利率在一季度将继续围绕政策利率波动，整体中枢维持低位，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。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 | 193,607,868.42 | 19.44 |
| | 其中：股票 | 193,607,868.42 | 19.44 |
| 2 | 固定收益投资 | 644,478,861.37 | 64.72 |
| | 其中：债券 | 644,478,861.37 | 64.72 |
| | 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 | 50,000,315.00 | 5.02 |
| | 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 | 99,127,523.98 | 9.95 |
| 7 | 其他各项资产 | 8,657,553.33 | 0.87 |
| 8 | 合计 | 995,872,122.10 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 160,333,066.65 | 16.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 11,519.99 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 5,031,253.14 | 0.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 25,722.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | 6,500,526.00 | 0.66 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,977.15 | 0.00 |
| J | 金融业 | 4,930,747.00 | 0.50 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 12,730,122.00 | 1.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,930,480.00 | 0.40 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 45,710.34 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,811.84 | 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 | 37,932.31 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 193,607,868.42 | 19.61 |

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 | 002353 | 杰瑞股份 | 281,600 | 11,264,000.00 | 1.14 |
| 2 | 000792 | 盐湖股份 | 306,500 | 10,847,035.00 | 1.10 |
| 3 | 002935 | 天奥电子 | 262,700 | 9,669,987.00 | 0.98 |
| 4 | 603668 | 天马科技 | 766,900 | 9,624,595.00 | 0.97 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 11,331 | 6,662,628.00 | 0.67 |
| 6 | 600258 | 首旅酒店 | 248,600 | 6,495,918.00 | 0.66 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 3,100 | 6,355,000.00 | 0.64 |
| 8 | 600893 | 航发动力 | 99,800 | 6,333,308.00 | 0.64 |
| 9 | 603666 | 亿嘉和 | 83,700 | 6,287,544.00 | 0.64 |
| 10 | 600048 | 保利发展 | 357,400 | 5,586,162.00 | 0.57 |

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 | 251,038,000.00 | 25.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 150,392,000.00 | 15.23 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 4 | 企业债券 | 30,141,000.00 | 3.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | 130,110,000.00 | 13.18 |
| 6 | 中期票据 | 183,044,000.00 | 18.54 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,615,861.37 | 0.16 |
| 8 | 同业存单 | 48,530,000.00 | 4.91 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 644,478,861.37 | 65.26 |

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 | 2128047 | 21 招商银行永续债 | 600,000 | 60,486,000.00 | 6.13 |
| 2 | 101900488 | 19 首钢 MTN003 | 500,000 | 52,005,000.00 | 5.27 |
| 3 | 042100382 | 21 电网 CP011 | 500,000 | 50,060,000.00 | 5.07 |
| 4 | 012103042 | 21 陕延油 SCP008 | 500,000 | 50,020,000.00 | 5.07 |
| 5 | 210304 | 21 进出 04 | 500,000 | 50,015,000.00 | 5.06 |

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，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。

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 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。

2021 年 1 月 19 日，农业银行因发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕1 号）给予罚款 420 万元的行政处罚。2021 年 12 月 8 日，农业银行因制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕38 号）给予罚款 150 万元的行政处罚。

2021 年 4 月 23 日，浦发银行因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务，被中国银行保险监督管理委员会上海监管局（沪银保监罚决字〔2021〕29 号）责令改正，并处罚款共计 760 万元的行政处罚。2021 年 7 月 13 日，浦发银行因监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力等违法违规事项，被中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕27 号）给予罚款 6920 万元的行政处罚。2021 年 11 月 15 日，浦发银行因银行卡境外交易信息报送错误，被国家外汇管

理局上海市分局（上海汇管罚字〔2021〕3121210802 号）责令改正，给予警告、处 6 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金投资 21 招商银行永续债、21 农业银行 CD018、21 浦发银行 02 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 182,471.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,475,082.16 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,657,553.33 |

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 | 123114 | 三角转债 | 527,467.62 | 0.05 |
| 2 | 113050 | 南银转债 | 403,471.20 | 0.04 |
| 3 | 128081 | 海亮转债 | 120,519.00 | 0.01 |
| 4 | 110060 | 天路转债 | 93,350.40 | 0.01 |
| 5 | 110062 | 烽火转债 | 92,440.00 | 0.01 |
| 6 | 127038 | 国微转债 | 54,798.39 | 0.01 |
| 7 | 123072 | 乐歌转债 | 49,763.42 | 0.01 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安新泰利灵活配置混 合A | 华安新泰利灵活配置混 合C |
|----------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 364,262,597.06 | 260,122,509.32 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 36,398,431.60 | 94,599,687.95 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 40,267,247.30 | 12,986,641.79 |
| 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 | 360,393,781.36 | 341,735,555.48 |

§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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、《华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安新泰利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办公场所，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办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二二年一月二十一日