
華夏回報證券投資基金

2024 年年度報告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：華夏基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

華夏回報證券投資基金（“本基金”）

2024 年年度報告

向香港投資者提供的資料

本基金是根據香港《證券及期貨條例》（「**證券及期貨條例**」）第 104 條在香港獲得證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）認可。證監會認可不代表對本基金的推薦或認許，亦不代表其對本基金的商業利弊或其表現作出保證。此並不意指本基金適合所有投資者，亦並非認許本基金適合任何特定投資者或投資者類別。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

補充披露部分只編備以供在香港派發。補充披露部分載有本基金投資組合的額外詳情，其必須連同本基金的 2024 年年度報告一併閱覽。在年度報告中所提及的基金，除華夏回報證券投資基金和華夏興華混合型證券投資基金外，其他基金在香港未獲證監會認可及並非供香港居民投資。

華夏基金（香港）有限公司

香港代表

2025 年 3 月 31 日

§1 重要提示及目錄

1.1 重要提示

基金管理人的董事會、董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶的法律責任。本年度報告已經三分之二以上獨立董事簽字同意，並由董事長簽發。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據本基金合同規定，於 2025 年 3 月 27 日復核了本報告中的財務指標、淨值表現、利潤分配情況、財務會計報告、投資組合報告等內容，保證復核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

基金管理人承諾以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金資產，但不保證基金一定盈利。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在作出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本報告中的財務資料經審計，安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）為本基金出具了無保留意見的審計報告，請投資者注意閱讀。

本報告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目錄

§1 重要提示及目錄	2
§2 基金簡介	4
§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況	5
3.1 主要會計數據和財務指標	5
3.2 基金淨值表現	6
3.3 過去三年基金的利潤分配情況	7
§4 管理人報告	7
§5 託管人報告	13
§6 審計報告	14
§7 年度財務報表	16
7.1 資產負債表	16
7.2 利潤表	17
7.3 淨資產變動表	18
7.4 報表附注	19
§8 投資組合報告	45
8.1 期末基金資產組合情況	45
8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合	46
8.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細	46
8.4 報告期內股票投資組合的重大變動	51
8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合	53
8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細	53
8.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細	53
8.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細	53
8.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細	53
8.10 本基金投資股指期貨的投資政策	54
8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明	54
8.12 投資組合報告附注	54
§9 基金份額持有人信息	55
9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構	55
9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況	55
9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間的情況	55
§10 開放式基金份額變動	55
§11 重大事件披露	55
§12 影響投資者決策的其他重要信息	59
§13 備查文件目錄	59
§14 補充披露	59

§2 基金簡介

2.1 基金基本情況

基金名稱	華夏回報證券投資基金	
基金簡稱	華夏回報混合	
基金主代碼	002001	
交易代碼	002001(前端)	002002(後端)
基金運作方式	契約型開放式	
基金合同生效日	2003 年 9 月 5 日	
基金管理人	華夏基金管理有限公司	
基金託管人	中國銀行股份有限公司	
報告期末基金份額總額	7,864,599,807.39 份	
基金合同存續期	不定期	

注：投資者通過中國內地的銷售機構申購基金份額時僅可申購 A 類基金份額（002001（前端）、002002（後端）），投資者通過香港的銷售機構申購基金份額時僅可申購 H 類基金份額（960002）。

2.2 基金產品說明

投資目標	儘量避免基金資產損失，追求每年較高的絕對回報。
投資策略	主要投資策略包括資產配置策略、股票投資策略、債券投資策略等。在股票投資策略上，本基金股票投資部分主要採取價值型投資策略。
業績比較基準	本基金業績比較基準為絕對回報標準，為同期一年期定期存款利率。
風險收益特徵	本基金在證券投資基金中屬於中等風險的品種，其長期平均的預期收益和風險高於債券基金，低於股票基金。

2.3 基金管理人和基金託管人

項目		基金管理人	基金託管人
名稱		華夏基金管理有限公司	中國銀行股份有限公司
信息披露 負責人	姓名	李彬	許俊
	聯絡電話	400-818-6666	010-66596688
	電子郵箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客戶服務電話		400-818-6666	95566
傳真		010-63136700	010-66594942
註冊地址		北京市順義區安慶大街甲3號院	北京市西城區復興門內大街1號
辦公地址		北京市朝陽區北辰西路6號院北 辰中心C座5層	北京市西城區復興門內大街1號
郵政編碼		100101	100818
法定代表人		張佑君	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金選定的信息披露報紙名稱	《證券時報》
登載基金年度報告正文的管理人互聯	www.ChinaAMC.com

網網址	
基金年度報告備置地地點	基金管理人和/或基金託管人的住所/辦公地址

2.5 其他相關資料

項目	名稱	辦公地址
會計師事務所	安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）	北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層
註冊登記機構	華夏基金管理有限公司	北京市朝陽區北辰西路 6 號院北辰中心 C 座 5 層

§3 主要財務指標、基金淨值表現及利潤分配情況

3.1 主要會計數據和財務指標

金額單位：人民幣元

3.1.1 期間數據和指標	2024 年	2023 年	2022 年
本期已實現收益	-614,527,252.09	-197,599,581.78	-189,310,228.11
本期利潤	506,856,584.03	-1,401,324,842.88	-1,303,067,933.76
加權平均基金份額 本期利潤	0.0617	-0.1581	-0.1399
本期加權平均淨值 利潤率	5.39%	-12.42%	-10.35%
本期基金份額淨值 增長率	5.56%	-12.20%	-9.56%
3.1.2 期末數據和指標	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利潤	-936,375,747.16	-380,977,659.52	-201,530,140.85
期末可供分配基金 份額利潤	-0.1191	-0.0449	-0.0221
期末基金資產淨值	9,556,276,968.73	9,773,888,390.88	11,937,144,389.67
期末基金份額淨值	1.215	1.151	1.311
3.1.3 累計期末指標	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份額累計淨值 增長率	1,329.89%	1,254.57%	1,442.87%

注：①所述基金業績指標不包括持有人認購或交易基金的各項費用，計入費用後實際收益水平要低於所列數字。

②本期已實現收益指基金本期利息收入、投資收益、其他收入（不含公允價值變動收益）扣除相關費用和信用減值損失後的餘額，本期利潤為本期已實現收益加上本期公允價值變動收益。

③期末可供分配利潤為期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現部分的孰低數。

3.2 基金淨值表現

3.2.1 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

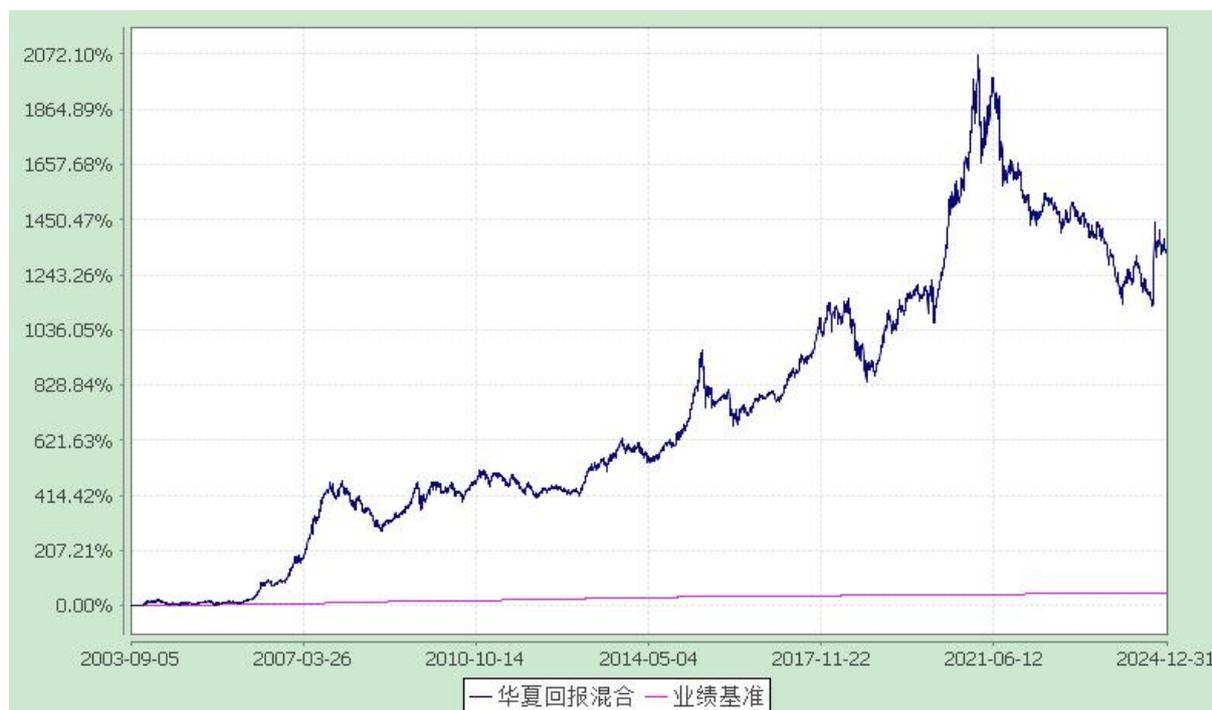
階段	份額淨值增長率①	份額淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①－③	②－④
過去三個月	-3.42%	1.34%	0.38%	0.00%	-3.80%	1.34%
過去六個月	9.86%	1.32%	0.75%	0.00%	9.11%	1.32%
過去一年	5.56%	1.12%	1.50%	0.00%	4.06%	1.12%
過去三年	-16.18%	0.82%	4.50%	0.00%	-20.68%	0.82%
過去五年	11.65%	0.99%	7.50%	0.00%	4.15%	0.99%
自基金合同生效起至今	1,329.89%	1.00%	48.18%	0.00%	1,281.71%	1.00%

3.2.2 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較

華夏回報證券投資基金

份額累計淨值增長率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

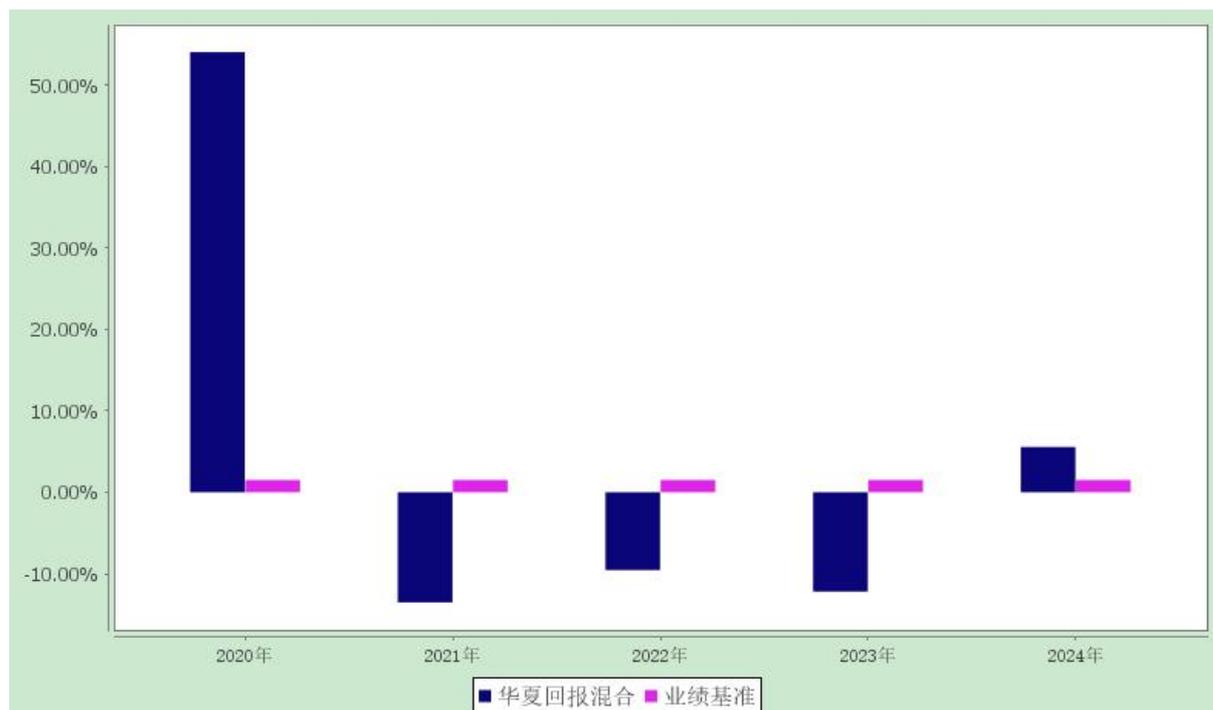
(2003 年 9 月 5 日至 2024 年 12 月 31 日)



3.2.3 過去五年基金每年淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

華夏回報證券投資基金

過去五年基金淨值增長率與業績比較基準收益率的對比圖



3.3 過去三年基金的利潤分配情況

單位：人民幣元

年度	每10份基金份額分紅數	現金形式發放總額	再投資形式發放總額	年度利潤分配合計	備註
2022年	0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-
合計	0.150	46,528,460.13	94,761,003.64	141,289,463.77	-

§4 管理人報告

4.1 基金管理人及基金經理情況

4.1.1 基金管理人及其管理基金的經驗

華夏基金管理有限公司成立於1998年4月9日，是經中國證監會批准成立的首批全國性基金管理公司之一。公司總部設在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、廣州、青島、武漢及瀋陽設有分公司，在香港、深圳、上海、北京設有子公司。公司是首批全國社保基金管理人、首批企業年金基金管理人、境內首批QDII基金管理人、境內首隻ETF基金管理人、境內首隻滬港通ETF基金管理人、首批內地與香港基金互認基金管理人、首批基本養老保險基金投資管理人資格、首家加入聯合國責任投資原則組織的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募養老目標基金管理人、首批個人養老金基金管理人、境內首批中日互通ETF基金管理人、首批商品期貨ETF基金管理人、首批公募MOM基金管理人、首批納入互聯互通ETF基金管理人、首批北交所主題基金管理人以及特定客戶資產管理人、保險資金投資管理人、公募REITs管理人，境內首家承諾“碳中和”

具體目標和路徑的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。華夏基金是業務領域最廣泛的基金管理公司之一。

華夏基金是境內權益 ETF 管理規模最大的基金管理公司之一，在指數基金管理方面積累了豐富的經驗，形成了覆蓋寬基、港股、行業主題、策略、跨境、商品等較為完整的指數產品線。

華夏基金以深入的投資研究為基礎，盡力捕捉市場機會，為投資者謀求良好的回報。根據銀河證券基金研究中心《中國基金業績評價報告》，截至 2024 年 12 月 31 日，華夏基金旗下多隻產品近 1 年同類排名領先（基金排名不作為產品未來表現的保證），其中：

主動權益產品：在消費行業偏股型基金(A 類)中華夏消費臻選混合發起式(A 類)排名第 1/81；在新能源主題行業偏股型基金(A 類)中華夏清潔能源龍頭混合發起式(A 類)排名第 1/27；在北交所主題偏股型基金(A 類)中華夏北交所創新中小企業精選兩年定開混合發起式排名第 1/11；在標準股票型基金(A 類)中華夏優勢精選股票排名第 2/336、華夏潛龍精選股票排名第 15/336、華夏創新前沿股票排名第 64/336；在汽車主題行業偏股型基金(A 類)中華夏新能源車龍頭混合發起式(A 類)排名第 3/16；在港股通標準股票型基金(A 類)中華夏港股通精選股票（LOF）(A 類)排名第 3/14；在 QDII 混合基金(A 類)中華夏全球科技先鋒混合（QDII）排名第 5/51；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 類)中華夏經典混合排名第 5/148、華夏常陽三年定開混合排名第 19/148、華夏策略混合排名第 29/148；在 TMT 與信息技術行業偏股型基金(A 類)中華夏半導體龍頭混合發起式(A 類)排名第 11/47；在醫藥醫療健康行業偏股型基金(A 類)中華夏樂享健康混合(A 類)排名第 13/78；在 QDII 股票型基金(A 類)中華夏全球股票（QDII）排名第 14/72；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 類)中華夏見龍精選混合排名第 13/1719、華夏阿爾法精選混合(A 類)排名第 40/1719、華夏融盛可持續一年持有混合(A 類)排名第 101/1719、華夏遠見成長一年持有混合(A 類)排名第 169/1719、華夏 ESG 可持續投資一年持有混合(A 類)排名第 177/1719、華夏先進製造龍頭混合(A 類)排名第 184/1719、華夏行業景氣混合排名第 214/1719、華夏景氣成長一年持有混合發起式(A 類)排名第 257/1719、華夏科技前沿 6 個月定開混合(A 類)排名第 278/1719；在靈活配置型基金(基準股票比例 30%-60%)(A 類)中華夏磐晟混合（LOF）排名第 28/425、華夏高端製造混合(A 類)排名第 64/425、華夏新機遇混合(A 類)排名第 76/425；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 類) 華夏新興經濟一年持有混合(A 類)排名第 34/221、華夏大盤精選混合(A 類)排名第 49/221。

固收與固收+產品：在信用債指數債券型基金(A 類)中華夏亞債中國指數(A 類)排名第 1/18；在普通債券型基金(可投轉債)(A 類)中華夏雙債債券(A 類)排名第 2/246；在定開純債債券型基金(A 類)中華夏鼎華一年定開債券排名第 9/647、華夏鼎譽三個月定開債券(A 類)排名第 51/647；在定開普通債券型基金(二級)(A 類)中華夏卓信一年定開債券發起式排名第 11/24；在可轉換債券型基金(A 類)

中華夏可轉債增強債券(A類)排名第 12/38; 在普通偏債型基金(股票上限不高於 30%)(A類)中華夏磐泰混合 (LOF) (A類)排名第 14/333; 在中短期純債債券型基金(A類)中華夏中短債債券(A類)排名第 15/165; 在定開普通債券型基金(可投轉債)(A類)中華夏鼎祿三個月定開債券(A類)排名第 22/157、華夏鼎福三個月定開債券(A類)排名第 31/157; 在長期純債債券型基金(A類)中華夏鼎茂債券(A類)排名第 20/851、華夏鼎通債券(A類)排名第 37/851; 在普通債券型基金(二級)(A類)中華夏穩享增利 6 個月債券(A類)排名第 79/443。

指數產品：在標準策略指數股票型基金(A類)中華夏上證 50AH 優選指數 (LOF) (A類)排名第 6/25; 在策略指數股票 ETF 基金中華夏中證智選 300 價值穩健策略 ETF 排名第 8/48; 在規模指數股票 ETF 基金中華夏 MSCI 中國 A50 互聯互通 ETF 排名第 14/161、華夏中證滬港深 500ETF 排名第 20/161、華夏上證 50ETF 排名第 29/161; 在行業指數股票 ETF 基金中華夏中證銀行 ETF 排名第 5/72、華夏中證全指證券公司 ETF 排名第 15/72; 在增強規模指數股票型基金(A類)中華夏滬深 300 指數增強(A類)排名第 5/191、華夏上證科創板 50 成份指數增強發起式(A類)排名第 17/191; 在主題指數股票 ETF 基金中華夏金融 ETF 發起式排名第 2/357、華夏國證半導體晶片 ETF 排名第 19/357、華夏中證金融科技主題 ETF 排名第 21/357、華夏中證 5G 通信主題 ETF 排名第 60/357、華夏中證人工智能主題 ETF 排名第 72/357、華夏中證雲計算與大數據主題 ETF 排名第 83/357。

在客戶服務方面，2024 年，華夏基金繼續以客戶需求為導向，努力提高客戶使用的便利性和服務體驗：（1）華夏基金直銷管道繼續優化頁面顯示，升級搜索及查詢功能，給客戶更方便、直觀的使用感受；（2）華夏基金管家客戶端從客戶需求出發持續優化操作頁面，進一步提升操作體驗；（3）與常熟農商銀行、長春農商銀行、貴文基金等代銷機構合作，拓展更加豐富的客戶理財管道；（4）開展“送你長期主義的花朵”、“換個角度，世界可能不一樣”、“聊聊新賽道”等活動，為客戶提供了多樣化的投資者教育和關懷服務。

4.1.2 基金經理（或基金經理小組）及基金經理助理的簡介

姓名	職務	任本基金的基金經理（助理） 期限		證券從業年限	說明
		任職日期	離任日期		
王君正	本基金的基金經理	2023-05-04	-	16 年	碩士。曾任泰達宏利基金管理有限公司研究部研究員，工銀瑞信基金管理有限公司研究員、研究部副總經理、基金經理等。2022 年 10 月加入華夏基金管理有限公司。
周飛	本基金的基	2024-06-25	-	14 年	碩士。2010 年 7 月加入

	金經理助理				華夏基金管理有限公 司。歷任交易管理部交 易員、現金管理部基金 經理助理。
--	-------	--	--	--	--

注：①上述“任職日期”和“離任日期”為根據公司決定確定的聘任日期和解聘日期。首任基金經理的，其“任職日期”為基金合同生效日。

②證券從業的含義遵從行業協會《證券基金經營機構董事、監事、高級管理人員及從業人員監督管理辦法》的相關規定。

4.1.3 基金經理薪酬機制

本基金管理人旗下基金經理兼任私募資產管理計劃投資經理的，公司對其進行年度綜合考核，考核結果作為確定其薪酬激勵的重要參考因素之一。因此，基金經理個人薪酬激勵與其管理的私募資產管理計劃浮動管理費或產品業績表現不直接掛鉤。

4.2 管理人對報告期內本基金運作遵規守信情況的說明

報告期內，本基金管理人嚴格遵守《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》、《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》、《基金管理公司開展投資、研究活動防控內幕交易指導意見》等法律法規和基金合同，本著誠實信用、勤勉盡責、安全高效的原則管理和運用基金資產，在嚴格控制投資風險的基礎上，為基金份額持有人謀求最大利益，沒有損害基金份額持有人利益的行為。

4.3 管理人對報告期內公平交易情況的專項說明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根據《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》等法規制定了《華夏基金管理有限公公平交易制度》。公司通過科學、制衡的投資決策體系，加強交易分配環節的內部控制，並通過工作制度、流程和技術手段保證公平交易原則的實現。同時，通過監察稽核、事後分析和信息披露來保證公平交易過程和結果的監督。

4.3.2 公平交易制度的執行情況

本基金管理人一貫公平對待旗下管理的所有基金和組合，制定並嚴格遵守相應的制度和流程，通過系統和人工等方式在各環節嚴格控制交易公平執行。報告期內，本基金管理人嚴格執行了《證券投資基金管理公司公平交易制度指導意見》和《華夏基金管理有限公公平交易制度》的規定。

4.3.2.1 增加執行的基金經理公平交易制度執行情況及公平交易管理情況

本基金管理人一貫嚴格執行公平交易原則，對兼任基金經理的交易情況進行持續監測。本年度所有相關組合的交易行為均符合法規、制度和流程要求，未發現違反公平交易原則的情況。本年度

同一基金經理管理的不同組合在鄰近交易日的同向和反向交易，交易時機和交易價差均可合理解釋，未發現異常。

本基金管理人根據《基金經理兼任私募資產管理計劃投資經理工作指引（試行）》要求，針對同經理管理多個組合間的收益率差異進行歸因分析，本年度各組合間收益率差異均屬正常情況，主要原因為業績基準不同、投資策略不同，收益率差異可以合理解釋。

4.3.3 異常交易行為的專項說明

報告期內未發現本基金存在異常交易行為。

報告期內，本基金管理人旗下所有投資組合參與的交易所公開競價交易中，同日反向交易成交較少的單邊交易量超過該證券當日成交量的 5% 的交易共有 197 次，其中 1 次為不同基金經理管理的組合間因投資策略不同而發生的反向交易，有關基金經理已根據公司管理要求提供決策依據；其餘均為指數量化投資組合因投資策略需要和其他組合發生的反向交易。

4.4 管理人對報告期內基金的投資策略和業績表現的說明

4.4.1 報告期內基金投資策略和運作分析

2024 年全年 A 股市場先抑後揚，全年 wind 全 A 指數上漲 10.0%，以科技創新為代表的科創 50 指數上漲 16.1%，以紅利為代表的中證紅利指數上漲 12.3%。市場成交額達 254.42 萬億元，同比增長 20.2%，9 月後在政策驅動下交易活躍度顯著提升。

2024 年行業分化明顯，銀行（+34.39%）、非銀金融（+30.17%）、通信（+34.07%）漲幅居前，醫藥生物（-14.33%）承壓；AI、低空經濟、機器人等主題貫穿全年。

2024 年 9 月後中國經濟在政策發力下逐步修復，全年呈“前高、中低、後揚”走勢。GDP 超 130 萬億元，增速 5.0%，穩居全球第二大經濟體地位。

2024 年中國經濟亮點紛呈。在科技領域，人工智慧與量子技術突破，商業航太與低空經濟出現重大進展，人形機器人開始產業化；在實體經濟領域，新能源汽車年產量突破 1300 萬輛，出口量超 600 萬輛，製造業技術改造投資增長 8%，國家級綠色工廠達 6430 家，產值佔比提升至 20%，精特新企業超 14 萬家，製造業單項冠軍企業 1557 家，形成梯次創新體系；新能源汽車、鋰電池、光伏產品出口增長顯著，機電產品出口佔比近 60%，積體電路出口增長 18.7%。

報告期內，本基金堅持自下而上的選股方式，主要投資了消費、地產金融、醫藥醫療、地科技、高端製造各細分板塊中競爭格局良好、壁壘較高，具有長期優勢的優質公司。但回過頭看，其中大部分板塊與宏觀經濟的相關性比較強，組合表現與宏觀經濟走勢預期有較高相關性。

4.4.2 報告期內基金的業績表現

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金份額淨值為 1.215 元，本報告期份額淨值增長率為 5.56%，同

期業績比較基準增長率為 1.50%。

4.5 管理人對宏觀經濟、證券市場及行業走勢的簡要展望

在高質量發展的指引下，2025 年開年伊始，中國經濟喜訊不斷，2024 年 GDP 圓滿實現 5.0% 的年初增長目標，Deepseek、人形機器人等領域科技創新取得重大突破，中國的科技創新能力和綜合國力被全球重新認識。我們對中國經濟轉型升級成功抱有堅定的信心。具體而言，對於科技創新和綠色發展驅動的中國經濟增長，將帶來人工智慧、機器人、生物醫藥、新能源等新興領域的投資機會；中國經濟的穩健增長及老齡化社會的逐步來臨，將帶來醫療和養老服務、物業服務等服務領域，以及更廣泛消費領域的投資機會；在以房地產產業鏈等為代表的傳統板塊經過過去 3 年多的深度調整後，我們認為行業調整已經進入尾聲階段，競爭格局的出清和改善有望迎來曙光，對於剩者為王的優質企業，我們認為長期也有較好的投資機會。

本基金的投資仍將堅持落實到有中長期競爭優勢的好公司上，力圖以長期價值穿越短期經濟不確定性和短期市場漲跌迷霧。

珍惜基金份額持有人的每一分投資和每一份信任，本基金將繼續奉行華夏基金管理有限公司“為信任奉獻回報”的經營理念，規範運作，審慎投資，勤勉盡責地為基金份額持有人謀求長期、穩定的回報。

4.6 管理人內部有關本基金的監察稽核工作情況

報告期內，本基金管理人持續加強合規管理、風險控制和監察稽核工作。

在合規管理方面，公司通過合規審核、合規檢查、合規諮詢、合規宣傳與合規培訓等對合規風險進行管理，確保公司合規體系高效運行，合規風險有效控制。報告期內，公司不斷加強合規制度建設，結合法律法規和業務實際，在廉潔從業風險防控、信息披露、洗錢風險管理等方面新增和修訂多項管理制度，制度化水平顯著提高。持續開展合規培訓，在全員覆蓋的基礎上，著重加強投資研究和基金銷售等重點業務領域的合規督導培訓，強化員工主動合規意識和公募基金信息披露責任意識。持續優化合規管理的機制化和系統化，完善合規管理綜合服務平台，提高合規管理效能。持續做好信息披露業務，通過流程優化、系統優化及強化培訓持續保障信息披露的完整性、準確性、及時性。持續規範基金銷售業務，通過嚴格審查宣傳推介材料，認真開展投資者適當性管理工作等，確保基金銷售業務依法合規。公司高度重視洗錢風險管理，深入實踐風險為本方法，認真貫徹落實各項反洗錢監管要求，持續加強“風險評估+合規檢查”雙支柱管理框架，深入推進洗錢風險管理數智化轉型，持續提升洗錢風險管理水平。

在風險控制方面，公司秉承數位化管理理念，持續完善內部風險管理系統建設，穩步夯實投資風險管理基礎。緊密跟蹤各項法律法規要求、加強風險研究，在嚴格管控基金日常投資運作風險的

同時，持續完善風險管理制度建設，提升基金流動性風險、市場風險、合規風險、操作風險等關鍵風險的管控水平，努力保障各項風險管理措施落實到位。

在監察稽核方面，公司按照法規要求，做好日常合規監控，定期及不定期開展內部檢查，排查業務風險隱患，促進公司整體業務合規運作、穩健經營。

報告期內，本基金管理人所管理的基金整體運作合法合規。本基金管理人將繼續以風險控制為核心，堅持基金份額持有人利益優先的原則，提高監察稽核工作的科學性和有效性，切實保障基金合規穩健運作。

4.7 管理人對報告期內基金估值程序等事項的說明

根據中國證監會相關規定及基金合同約定，本基金管理人為準確、及時進行基金估值和份額淨值計價，制定了基金估值和份額淨值計價的業務管理制度，建立了估值委員會，使用可靠的估值業務系統，設有完善的風險監測、控制和報告機制。本基金託管人審閱本基金管理人採用的估值原則及技術，並復核、審查基金資產淨值和基金份額申購、贖回價格。會計師事務所在估值調整導致基金資產淨值的變化在 0.25% 以上時對所採用的相關估值技術、假設及輸入值的適當性發表專業意見。定價服務機構按照商業合同約定提供定價服務。

4.8 管理人對報告期內基金利潤分配情況的說明

本基金本報告期末進行利潤分配，符合相關法規及基金合同的規定。

4.9 報告期內管理人對本基金持有人數或基金資產淨值預警情形的說明

報告期內，本基金未出現連續二十個工作日基金份額持有人數量不滿二百人或者基金資產淨值低於五千萬元的情形。

§5 託管人報告

5.1 報告期內本基金託管人遵規守信情況聲明

本報告期內，中國銀行股份有限公司（以下稱“本託管人”）在華夏回報證券投資基金（以下稱“本基金”）的託管過程中，嚴格遵守《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的有關規定，不存在損害基金份額持有人利益的行為，完全盡職盡責地履行了應盡的義務。

5.2 託管人對報告期內本基金投資運作遵規守信、淨值計算、利潤分配等情況的說明

本報告期內，本託管人根據《證券投資基金法》及其他有關法律法規、基金合同和託管協議的規定，對本基金管理人的投資運作進行了必要的監督，對基金資產淨值的計算、基金份額申購贖回價格的計算以及基金費用開支等方面進行了認真地復核，未發現本基金管理人存在損害基金份額持

有人利益的行為。

5.3 託管人對本年度報告中財務信息等內容的真實、準確和完整發表意見

本報告中的財務指標、淨值表現、收益分配情況、財務會計報告（注：財務會計報告中的“金融工具風險及管理”、“關聯方承銷證券”、“關聯方證券出借”部分未在託管人復核範圍內）、投資組合報告等數據真實、準確和完整。

§6 審計報告

安永華明（2025）審字第 70035283_A02 號

華夏回報證券投資基金全體基金份額持有人：

6.1 審計意見

我們審計了華夏回報證券投資基金的財務報表，包括 2024 年 12 月 31 日的資產負債表，2024 年度的利潤表、淨資產變動表以及相關財務報表附注。

我們認為，後附的華夏回報證券投資基金的財務報表在所有重大方面按照企業會計準則的規定編製，公允反映了華夏回報證券投資基金 2024 年 12 月 31 日的財務狀況以及 2024 年度的經營成果和淨資產變動情況。

6.2 形成審計意見的基礎

我們按照中國註冊會計師審計準則的規定執行了審計工作。審計報告的“註冊會計師對財務報表審計的責任”部分進一步闡述了我們在這些準則下的責任。按照中國註冊會計師職業道德守則，我們獨立於華夏回報證券投資基金，並履行了職業道德方面的其他責任。我們相信，我們獲取的審計證據是充分、適當的，為發表審計意見提供了基礎。

6.3 其他信息

華夏回報證券投資基金管理層對其他信息負責。其他信息包括年度報告中涵蓋的信息，但不包括財務報表和我們的審計報告。

我們對財務報表發表的審計意見不涵蓋其他信息，我們也不對其他信息發表任何形式的鑒證結論。

結合我們對財務報表的審計，我們的責任是閱讀其他信息，在此過程中，考慮其他信息是否與財務報表或我們在審計過程中了解到的情況存在重大不一致或者似乎存在重大錯報。

基於我們已執行的工作，如果我們確定其他信息存在重大錯報，我們應當報告該事實。在這方面，我們無任何事項需要報告。

6.4 管理層和治理層對財務報表的責任

管理層負責按照企業會計準則的規定編製財務報表，使其實現公允反映，並設計、執行和維護必要的內部控制，以使財務報表不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報。

在編製財務報表時，管理層負責評估華夏回報證券投資基金的持續經營能力，披露與持續經營相關的事項（如適用），並運用持續經營假設，除非計劃進行清算、終止運營或別無其他現實的選擇。

治理層負責監督華夏回報證券投資基金的財務報告過程。

6.5 註冊會計師對財務報表審計的責任

我們的目標是對財務報表整體是否不存在由於舞弊或錯誤導致的重大錯報獲取合理保證，並作出包含審計意見的審計報告。合理保證是高水平的保證，但並不能保證按照審計準則執行的審計在某一重大錯報存在時總能發現。錯報可能由於舞弊或錯誤導致，如果合理預期錯報單獨或匯總起來可能影響財務報表使用者依據財務報表作出的經濟決策，則通常認為錯報是重大的。

在按照審計準則執行審計工作的過程中，我們運用職業判斷，並保持職業懷疑。同時，我們也執行以下工作：

（1）識別和評估由於舞弊或錯誤導致的財務報表重大錯報風險，設計和實施審計程序以應對這些風險，並獲取充分、適當的審計證據，作為發表審計意見的基礎。由於舞弊可能涉及串通、偽造、故意遺漏、虛假陳述或凌駕於內部控制之上，未能發現由於舞弊導致的重大錯報的風險高於未能發現由於錯誤導致的重大錯報的風險。

（2）了解與審計相關的內部控制，以設計恰當的審計程序，但目的並非對內部控制的有效性發表意見。

（3）評價管理層選用會計政策的恰當性和作出會計估計及相關披露的合理性。

（4）對管理層使用持續經營假設的恰當性得出結論。同時，根據獲取的審計證據，就可能導致對華夏回報證券投資基金持續經營能力產生重大疑慮的事項或情況是否存在重大不確定性得出結論。如果我們得出結論認為存在重大不確定性，審計準則要求我們在審計報告中提請報表使用者注意財務報表中的相關披露；如果披露不充分，我們應當發表非無保留意見。我們的結論基於截至審計報告日可獲得的信息。然而，未來的事項或情況可能導致華夏回報證券投資基金不能持續經營。

（5）評價財務報表的總體列報（包括披露）、結構和內容，並評價財務報表是否公允反映相關交易和事項。

我們與治理層就計劃的審計範圍、時間安排和重大審計發現等事項進行溝通，包括溝通我們在審計中識別出的值得關注的內部控制缺陷。

安永華明會計師事務所（特殊普通合夥）

中國註冊會計師

張小東 王海彥

北京市東城區東長安街 1 號東方廣場安永大樓 17 層

2025 年 3 月 27 日

§7 年度財務報表

7.1 資產負債表

會計主體：華夏回報證券投資基金

報告截止日：2024 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

資產	附注號	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
資產：			
貨幣資金	7.4.7.1	238,884,013.01	822,298,990.60
結算備付金		4,709,033.00	2,025,719.16
存出保證金		586,337.77	286,587.91
交易性金融資產	7.4.7.2	9,141,813,428.51	8,986,145,913.31
其中：股票投資		6,335,640,279.80	6,934,199,278.46
基金投資		-	-
債券投資		2,806,173,148.71	2,051,946,634.85
資產支持證券投資		-	-
貴金屬投資		-	-
其他投資		-	-
衍生金融資產	7.4.7.3	-	-
買入返售金融資產	7.4.7.4	207,993,078.58	-
應收清算款		3,198,803.13	3,463,607.66
應收股利		-	-
應收申購款		1,032,289.71	1,762,766.50
遞延所得稅資產		-	-
其他資產	7.4.7.5	-	-
資產總計		9,598,216,983.71	9,815,983,585.14
負債和淨資產	附注號	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
負債：			
短期借款		-	-
交易性金融負債		-	-
衍生金融負債	7.4.7.3	-	-
賣出回購金融資產款		-	-

應付清算款		7,559,933.85	2,793,103.58
應付贖回款		9,180,551.76	14,570,792.23
應付管理人報酬		9,856,917.73	9,963,510.86
應付託管費		1,642,819.58	1,660,585.14
應付銷售服務費		-	-
應付投資顧問費		-	-
應交稅費		80,199.83	80,822.54
應付利潤		-	-
遞延所得稅負債		-	-
其他負債	7.4.7.6	13,619,592.23	13,026,379.91
負債合計		41,940,014.98	42,095,194.26
淨資產：			
實收基金	7.4.7.7	7,864,599,807.39	8,491,684,471.48
未分配利潤	7.4.7.8	1,691,677,161.34	1,282,203,919.40
淨資產合計		9,556,276,968.73	9,773,888,390.88
負債和淨資產總計		9,598,216,983.71	9,815,983,585.14

注：報告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份額淨值 1.215 元，基金份額總額 7,864,599,807.39 份。

7.2 利潤表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	附注號	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、營業總收入		638,947,864.67	-1,220,846,593.53
1.利息收入		2,760,358.25	4,083,681.03
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,621,034.85	2,376,668.47
債券利息收入		-	-
資產支持證券利息收入		-	-
買入返售金融資產收入		139,323.40	1,707,012.56
其他利息收入		-	-
2.投資收益（損失以“-”填列）		-486,808,871.84	-23,196,277.66
其中：股票投資收益	7.4.7.10	-724,251,991.86	-236,200,551.72
基金投資收益	7.4.7.11	-	-
債券投資收益	7.4.7.12	43,986,980.23	56,506,245.18
資產支持證券投資收益	7.4.7.13	-	-
貴金屬投資收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	193,456,139.79	156,498,028.88
其他投資收益		-	-

3.公允價值變動收益（損失以“-”號填列）	7.4.7.17	1,121,383,836.12	-1,203,725,261.10
4.匯兌收益（損失以“-”號填列）		-	-
5.其他收入（損失以“-”號填列）	7.4.7.18	1,612,542.14	1,991,264.20
減：二、營業總支出		132,091,280.64	180,478,249.35
1.管理人報酬		112,998,714.03	154,328,430.64
2.託管費		18,833,119.01	25,721,405.09
3.銷售服務費		-	-
4.投資顧問費		-	-
5.利息支出		-	114,140.41
其中：賣出回購金融資產支出		-	114,140.41
6.信用減值損失	7.4.7.20	-	-
7.稅金及附加		1,790.96	4,428.86
8.其他費用	7.4.7.21	257,656.64	309,844.35
三、利潤總額（虧損總額以“-”號填列）		506,856,584.03	-1,401,324,842.88
減：所得稅費用		-	-
四、淨利潤（淨虧損以“-”號填列）		506,856,584.03	-1,401,324,842.88
五、其他綜合收益的稅後淨額		-	-
六、綜合收益總額		506,856,584.03	-1,401,324,842.88

7.3 淨資產變動表

會計主體：華夏回報證券投資基金

本報告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88
二、本期期初淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88
三、本期增減變動額 （減少以“-”號填列）	-627,084,664.09	409,473,241.94	-217,611,422.15
（一）、綜合收益總額	-	506,856,584.03	506,856,584.03
（二）、本期基金份額 交易產生的淨資產變 動數（淨資產減少以 “-”號填列）	-627,084,664.09	-97,383,342.09	-724,468,006.18
其中：1.基金申購款	452,714,216.02	72,460,928.87	525,175,144.89
2.基金贖回款	-1,079,798,880.11	-169,844,270.96	-1,249,643,151.07
（三）、本期向基金份 額持有人分配利潤產	-	-	-

生的淨資產變動（淨資產減少以“-”號填列）			
四、本期期末淨資產	7,864,599,807.39	1,691,677,161.34	9,556,276,968.73
項目	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	實收基金	未分配利潤	淨資產合計
一、上期期末淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67
二、本期期初淨資產	9,103,914,367.54	2,833,230,022.13	11,937,144,389.67
三、本期增減變動額（減少以“-”號填列）	-612,229,896.06	-1,551,026,102.73	-2,163,255,998.79
（一）、綜合收益總額	-	-1,401,324,842.88	-1,401,324,842.88
（二）、本期基金份額交易產生的淨資產變動數（淨資產減少以“-”號填列）	-612,229,896.06	-149,701,259.85	-761,931,155.91
其中：1.基金申購款	627,148,039.13	179,203,335.89	806,351,375.02
2.基金贖回款	-1,239,377,935.19	-328,904,595.74	-1,568,282,530.93
（三）、本期向基金份額持有人分配利潤產生的淨資產變動（淨資產減少以“-”號填列）	-	-	-
四、本期期末淨資產	8,491,684,471.48	1,282,203,919.40	9,773,888,390.88

報表附注為財務報表的組成部分。

本報告 7.1 至 7.4，財務報表由下列負責人簽署：

基金管理人負責人：張佑君，主管會計工作負責人：朱威，會計機構負責人：朱威

7.4 報表附注

7.4.1 基金基本情況

華夏回報證券投資基金（以下簡稱“本基金”）經中國證券監督管理委員會（以下簡稱“中國證監會”）證監基金字[2003]86 號《關於同意華夏回報證券投資基金設立的批覆》核准，由基金發起人華夏基金管理有限公司依照《證券投資基金管理暫行辦法》（於 2004 年 9 月 16 日廢止，由《中華人民共和國證券投資基金法》取代）、《開放式證券投資基金試點辦法》（已廢止）等有關規定和《華夏回報證券投資基金基金契約》（於 2004 年 10 月 15 日改為《華夏回報證券投資基金基金合同》）發起，並於 2003 年 9 月 5 日募集成立。本基金為契約型開放式，存續期限不定，首次設立募集不包括認購資金利息共募集 3,796,885,823.40 元，業經普華永道中天會計師事務所有限公司普華永道驗字（2003）

第 112 號驗資報告予以驗證。有關基金設立等文件已按規定向中國證監會備案。本基金的基金管理人為華夏基金管理有限公司，基金託管人為中國銀行股份有限公司。根據基金管理人 2015 年 7 月 2 日刊登的《華夏基金管理有限公司關於修訂華夏回報證券投資基金基金合同的公告》，本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 類基金份額類別。

根據《中華人民共和國證券投資基金法》、《華夏回報證券投資基金基金合同》等有關規定，本基金的投資範圍限於具有良好流動性的金融工具，包括國內依法公開發行上市的股票（含存托憑證）、債券、權證、資產支持證券及中國證監會允許基金投資的其他金融工具。其中債券包括國債、金融債、企業（公司）債（包括可轉債）等。

7.4.2 會計報表的編製基礎

本基金的財務報表按照財政部頒布和修訂的《企業會計準則—基本準則》、各項具體會計準則（以下合稱“企業會計準則”）、中國證券投資基金業協會（以下簡稱“中國基金業協會”）頒布的《證券投資基金會計核算業務指引》、中國證監會發布的《證券投資基金信息披露 XBRL 範本第 3 號〈年度報告和中期報告〉》和中國證監會、中國基金業協會允許的如財務報表附注 7.4.4 所列示的基金行業實務操作的有關規定編製。

本財務報表以持續經營為基礎編製。

7.4.3 遵循企業會計準則及其他有關規定的聲明

本財務報表符合企業會計準則的要求，真實、完整地反映了本基金本報告期末的財務狀況以及本報告期間的經營成果和淨資產變動情況等有關信息。

7.4.4 重要會計政策和會計估計

7.4.4.1 會計年度

本基金會計年度為西曆 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 記賬基本貨幣

本基金的記賬基本貨幣為人民幣。

7.4.4.3 金融資產和金融負債的分類

金融工具，是指形成一方的金融資產並形成其他方的金融負債或權益工具的合同。當本基金成為金融工具合同的一方時，確認相關的金融資產或金融負債。

1、金融資產分類

本基金的金融資產於初始確認時分類為：以攤餘成本計量的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產。金融資產的分類取決於本基金管理金融資產的業務模式和金融資產的合同現金流量特徵。本基金現無金融資產

分類為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產。

(1) 債務工具

本基金持有的債務工具是指從發行方角度分析符合金融負債定義的工具，分別採用以下兩種方式進行計量：

以攤餘成本計量：

本基金管理以攤餘成本計量的金融資產的業務模式為以收取合同現金流量為目標，且以攤餘成本計量的金融資產的合同現金流量特徵與基本借貸安排相一致，即在特定日期產生的現金流量，僅為對本金和以未償付本金金額為基礎的利息的支付。基金持有的以攤餘成本計量的金融資產主要為銀行存款、買入返售金融資產和其他各類應收款項等。

以公允價值計量且其變動計入當期損益：

本基金將持有的未劃分為以攤餘成本計量的債務工具劃分為以公允價值計量且其變動計入當期損益。基金持有的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產主要為債券投資、資產支持證券投資和基金投資，在資產負債表中以交易性金融資產列示。

(2) 權益工具

權益工具是指從發行方角度分析符合權益定義的工具。本基金將對其沒有控制、共同控制和重大影響的權益工具(主要為股票投資)按照公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為交易性金融資產。

2、金融負債的分類

本基金的金融負債於初始確認時分類為：以攤餘成本計量的金融負債和以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金目前暫無金融負債分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。本基金持有的以攤餘成本計量的金融負債包括賣出回購金融資產款和其他各類應付款項等。

3、衍生金融工具

本基金將持有的衍生金融工具以公允價值計量且其變動計入當期損益，在資產負債表中列示為衍生金融資產/負債。

7.4.4.4 金融資產和金融負債的初始確認、後續計量和終止確認

本基金於成為金融工具合同的一方時確認一項金融資產或金融負債。

劃分為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產和金融負債，以及不作為有效套期工具的衍生工具，按照取得時的公允價值作為初始確認金額，相關的交易費用在發生時計入當期損益；對於支付的價款中包含的債券或資產支持證券起息日或上次除息日至購買日止的利息，確認為應計

利息，包含在交易性金融資產的帳面價值中。

劃分為以攤餘成本計量的金融資產和金融負債，按照取得時的公允價值作為初始確認金額，相關交易費用計入其初始確認金額。

對於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產，採用公允價值進行後續計量，其公允價值變動形成的利得或損失計入當期損益。

對於以攤餘成本計量的金融資產，採用實際利率法確認利息收入，其終止確認、修改或減值產生的利得或損失，均計入當期損益。

本基金對以攤餘成本計量的金融資產，以預期信用損失為基礎，進行減值處理並確認損失準備。本基金考慮有關過去事項、當前狀況以及對未來經濟狀況的預測等合理且有依據的信息，以發生違約的風險為權重，計算合同應收的現金流量與預期能收到的現金流量之間差額的現值的概率加權金額，確認預期信用損失。

對於不含重大融資成分的應收款項，本基金運用簡化計量方法，按照相當於整個存續期內的預期信用損失金額計量損失準備。除上述採用簡化計量方法以外的金融資產，本基金在每個估值日評估其信用風險自初始確認後是否已經顯著增加，如果信用風險自初始確認後未顯著增加，處於第一階段，本基金按照相當於未來 12 個月內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照帳面餘額和實際利率計算利息收入；如果信用風險自初始確認後已顯著增加但尚未發生信用減值的，處於第二階段，本基金按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照帳面餘額和實際利率計算利息收入；如果初始確認後發生信用減值的，處於第三階段，本基金按照相當於整個存續期內預期信用損失的金額計量損失準備，並按照攤餘成本和實際利率計算利息收入。

本基金在每個估值日評估相關金融工具的信用風險自初始確認後是否已顯著增加。本基金以單項金融工具或者具有相似信用風險特徵的金融工具組合為基礎，通過比較金融工具在估值日發生違約的風險與在初始確認日發生違約的風險，以確定金融工具預計存續期內發生違約風險的變化情況。當對金融資產預期未來現金流量具有不利影響的一項或多項事件發生時，該金融資產成為已發生信用減值的金融資產。當本基金不再合理預期能夠全部或部分收回金融資產合同現金流量時，本基金直接減記該金融資產的帳面餘額。

金融資產滿足下列條件之一的，予以終止確認：(1) 收取該金融資產現金流量的合同權利終止；(2) 該金融資產已轉移，且本基金將金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬轉移給轉入方；或者(3) 該金融資產已轉移，雖然本基金既沒有轉移也沒有保留金融資產所有權上幾乎所有的風險和報酬，但是放棄了對該金融資產控制。

金融資產終止確認時，其帳面價值與收到的對價的差額，計入當期損益。

當金融負債的現時義務全部或部分已經解除時，終止確認該金融負債或義務已解除的部分。終止確認部分的帳面價值與支付的對價之間的差額，計入當期損益。

7.4.4.5 金融資產和金融負債的估值原則

本基金持有的金融工具按如下原則確定公允價值並進行估值：

1、存在活躍市場的金融工具按其估值日的市場交易價格確定公允價值；估值日無交易且最近交易日後未發生影響公允價值計量的重大事件的，按最近交易日的市場交易價格確定公允價值。有充足證據表明估值日或最近交易日的市場交易價格不能真實反映公允價值的，應對市場交易價格進行調整，確定公允價值。與上述投資品種相同，但具有不同特徵的，應以相同資產或負債的公允價值為基礎，並在估值技術中考慮不同特徵因素的影響。特徵是指對資產出售或使用的限制等，如果該限制是針對資產持有者的，那麼在估值技術中不應將該限制作為特徵考慮。此外，基金管理人不應考慮因大量持有相關資產或負債所產生的溢價或折價。

2、當金融工具不存在活躍市場，採用在當前情況下適用並且有足夠可利用數據和其他信息支持的估值技術確定公允價值。採用估值技術時，優先使用可觀察輸入值，只有在無法取得相關資產或負債可觀察輸入值或取得不切實可行的情況下，才可以使用不可觀察輸入值。

3、如經濟環境發生重大變化或證券發行人發生影響金融工具價格的重大事件，應對估值進行調整並確定公允價值。

7.4.4.6 金融資產和金融負債的抵銷

本基金持有的資產和承擔的負債基本為金融資產和金融負債。當本基金依法有權抵銷債權債務且交易雙方準備按淨額結算時，金融資產與金融負債按抵銷後的淨額在資產負債表中列示。

7.4.4.7 實收基金

實收基金為對外發行基金份額所募集的總金額在扣除損益平准金分攤部分後的餘額。對於曾經實施份額拆分或折算的基金，由於基金份額拆分或折算引起的實收基金份額變動於基金份額拆分日或基金份額折算日根據拆分前或折算前的基金份額數及確定的拆分或折算比例計算認列。由於申購和贖回引起的實收基金變動分別於基金申購確認日及基金贖回確認日認列。對於已開放轉換業務的基金，上述申購和贖回分別包括基金轉換所引起的轉入基金的實收基金增加和轉出基金的實收基金減少。

7.4.4.8 損益平准金

損益平准金包括已實現平准金和未實現平准金。已實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未分配的已實現損益佔淨資產比例計算的金額。未實現平准金指在申購或贖回基金份額時，申購或贖回款項中包含的按累計未實現損益佔淨資產比例計算的金額。損益

平准金於基金申購確認日或基金贖回確認日認列，並於期末全額轉入未分配利潤/（累計虧損）。

7.4.4.9 收入/(損失)的確認和計量

境內基金投資在持有期間應取得的現金紅利於除息日確認為投資收益；境外基金投資在持有期間應取得的基金分紅收益扣除基金交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除由上市公司代扣代繳的個人所得稅後的淨額確認為投資收益；境外股票投資在持有期間應取得的現金股利扣除股票交易所在地適用的預繳所得稅後的淨額確認為投資收益。境內債券投資和資產支持證券投資在持有期間應取得的按票面利率(對於貼現債為按發行價計算的利率)或合同利率計算的利息扣除在適用情況下由債券和資產支持證券發行企業代扣代繳的個人所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益。境外債券投資在持有期間應取得的按票面利率計算的利息扣除在交易所在地適用的預繳所得稅及由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產在持有期間的公允價值變動確認為公允價值變動損益；處置時其公允價值與初始確認金額之間的差額扣除相關交易費用及在適用情況下由基金管理人繳納的增值稅後的淨額確認為投資收益，其中包括從公允價值變動損益結轉的公允價值累計變動額。

應收款項在持有期間確認的利息收入按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.10 費用的確認和計量

針對基金合同約定費率和計算方法的費用，本基金在費用涵蓋期間按合同約定進行確認。

其他以攤餘成本計量的金融負債在持有期間確認的利息支出按實際利率法計算，實際利率法與直線法差異較小的按直線法近似計算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份額享有同等分配權。本基金收益以現金形式分配，但基金份額持有人可選擇現金紅利或將現金紅利按分紅權益再投資日的基金份額淨值自動轉為基金份額進行再投資。期末可供分配利潤指期末資產負債表中未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

經宣告的擬分配基金收益於分紅除權日從淨資產轉出。

7.4.4.12 其他重要的會計政策和會計估計

根據本基金的估值原則和中國證監會允許的基金行業估值實務操作，本基金確定以下類別股票投資和債券投資的公允價值時採用的估值方法及其關鍵假設如下：

1、對於證券交易所上市的股票，若出現重大事項停牌或交易不活躍(包括漲跌停時的交易不活

躍)等情況,本基金根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》,根據具體情況採用《關於發布中基協(AMAC)基金行業股票估值指數的通知》提供的指數收益法、市盈率法、現金流量折現法等估值技術進行估值。

2、對於在鎖定期內的非公開發行股票、首次公開發行股票時公司股東公開發售股份、通過大宗交易取得的帶限售期的股票等流通受限股票,根據中國基金業協會中基協發[2017]6 號《關於發布<證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)>的通知》之附件《證券投資基金投資流通受限股票估值指引(試行)》進行估值。

3、對於在證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券除外)及在銀行間同業市場交易的固定收益品種,根據中國證監會公告[2017]13 號《中國證監會關於證券投資基金估值業務的指導意見》及中國基金業協會中基協字[2022]566 號《關於發布<關於固定收益品種的估值處理標準>的通知》之附件《關於固定收益品種的估值處理標準》採用估值技術確定公允價值。本基金持有的證券交易所上市或掛牌轉讓的固定收益品種(可轉換債券除外),按照中證指數有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。本基金持有的銀行間同業市場交易的固定收益品種,按照中債金融估值中心有限公司所獨立提供的估值結果確定公允價值。

7.4.5 會計政策和會計估計變更以及差錯更正的說明

7.4.5.1 會計政策變更的說明

本基金本報告期無會計政策變更。

7.4.5.2 會計估計變更的說明

本基金本報告期無會計估計變更。

7.4.5.3 差錯更正的說明

本基金本報告期無重大會計差錯的內容和更正金額。

7.4.6 稅項

根據財稅[2004]78 號《關於證券投資基金稅收政策的通知》、財稅[2005]103 號《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》、財稅[2008]1 號《關於企業所得稅若干優惠政策的通知》、財稅[2012]85 號《關於實施上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2014]81 號《關於滬港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2015]101 號《關於上市公司股息紅利差別化個人所得稅政策有關問題的通知》、財稅[2015]125 號《財政部、國家稅務總局、證監會關於內地與香港基金互認有關稅收政策的通知》、財稅[2016]36 號《關於全面推開營業稅改征增值稅試點的通知》、財稅[2016]46 號《財政部、國家稅務總局關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》、財稅[2016]70 號《財政部、國家稅務總局關於金融機構同業往來等增值稅

政策的補充通知》、財稅[2016]127 號《財政部國家稅務總局證監會關於深港股票市場交易互聯互通機制試點有關稅收政策的通知》、財稅[2016]140 號《關於明確金融房地產開發 教育輔助服務等增值稅政策的通知》、財稅[2017]2 號《關於資管產品增值稅政策有關問題的補充通知》、財稅[2017]56 號《關於資管產品增值稅有關問題的通知》、財稅[2017]90 號《關於租入固定資產進項稅額抵扣等增值稅政策的通知》、財稅[2023]39 號《關於減半徵收證券交易印花稅的公告》及其他相關財稅法規和實務操作，主要稅項列示如下：

- (1) 以發行基金方式募集資金不屬於增值稅徵收範圍，不徵收增值稅。
- (2) 資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人。資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為，暫適用簡易計稅方法，按照 3%的徵收率繳納增值稅。
- (3) 基金買賣股票、債券的差價收入免徵增值稅，暫不徵收企業所得稅。
- (4) 存款利息收入不徵收增值稅。
- (5) 國債、地方政府債利息收入，金融同業往來利息收入免徵增值稅。
- (6) 對基金取得的債券的利息收入及其他收入，暫不徵收企業所得稅。
- (7) 基金作為流通股股東在股權分置改革過程中收到由非流通股股東支付的股份、現金等對價暫免征收印花稅、企業所得稅和個人所得稅。
- (8) 對基金在境內取得的股票的股息、紅利收入，由上市公司在向基金派發股息、紅利收入時代扣代繳 20%的個人所得稅，暫不徵收企業所得稅。基金在境內從上市公司分配取得的股息紅利所得，持股期限在 1 個月以內（含 1 個月）的，全額計入應納稅所得額，持股期限在 1 個月以上至 1 年（含 1 年）的，減按 50%計入應納稅所得額，持股期限超過 1 年的，暫免征收個人所得稅。對基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市 H 股取得的股息紅利，H 股公司應向中國證券登記結算有限責任公司（以下簡稱“中國結算”）提出申請，由中國結算向 H 股公司提供內地個人投資者名冊，H 股公司按照 20%的稅率代扣個人所得稅。基金通過滬港通/深港通投資香港聯交所上市的非 H 股取得的股息紅利，由中國結算按照 20%的稅率代扣個人所得稅。對香港市場投資者取得的股息、紅利收入按照 10%的稅率代扣所得稅。
- (9) 基金在境內賣出股票按 0.1%的稅率繳納股票交易印花稅，買入股票不徵收股票交易印花稅。基金通過滬港通/深港通買賣、繼承、贈與聯交所上市股票，按照香港特別行政區現行稅法規定繳納印花稅。自 2023 年 8 月 28 日起，證券交易印花稅實施減半徵收。
- (10) 基金在境外證券交易所進行交易或取得的源自境外證券市場的收益，其涉及的稅收政策，按照相關國家或地區稅收法律和法規執行。

(11) 本基金分別按實際繳納的增值稅額的 7%、3%、2%繳納城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加。

7.4.7 重要財務報表項目的說明

7.4.7.1 貨幣資金

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	238,884,013.01	822,298,990.60
等於：本金	238,832,291.27	822,224,392.72
加：應計利息	51,721.74	74,597.88
定期存款	-	-
等於：本金	-	-
加：應計利息	-	-
其中：存款期限 1 個月以內	-	-
存款期限 1-3 個月	-	-
存款期限 3 個月以上	-	-
其他存款	-	-
等於：本金	-	-
加：應計利息	-	-
合計	238,884,013.01	822,298,990.60

7.4.7.2 交易性金融資產

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 12 月 31 日				
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動	
股票	6,256,410,830.81	-	6,335,640,279.80	79,229,448.99	
貴金屬投資- 金交所黃金 合約	-	-	-	-	
債券	交易 市場	320,047,466.27	544,549.97	321,039,839.57	447,823.33
	銀行 間市場	2,445,272,926.66	36,644,909.14	2,485,133,309.14	3,215,473.34
	合計	2,765,320,392.93	37,189,459.11	2,806,173,148.71	3,663,296.67
資產支持證 券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合計	9,021,731,223.74	37,189,459.11	9,141,813,428.51	82,892,745.66	
項目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	應計利息	公允價值	公允價值變動	
股票	7,975,133,154.82	-	6,934,199,278.46	-1,040,933,876.36	
貴金屬投資- 金交所黃金 合約	-	-	-	-	
債券	交易所市場	7,709,000.00	3,397.37	8,824,712.97	1,112,315.60
	銀行間市場	2,012,520,429.70	29,271,021.88	2,043,121,921.88	1,330,470.30
	合計	2,020,229,429.70	29,274,419.25	2,051,946,634.85	2,442,785.90
資產支持證 券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合計	9,995,362,584.52	29,274,419.25	8,986,145,913.31	-1,038,491,090.46	

注：股票投資的成本、公允價值及公允價值變動均包含中國存托憑證的成本、公允價值及公允價值變動。

7.4.7.3 衍生金融資產/負債

7.4.7.3.1 衍生金融資產/負債期末餘額

無。

7.4.7.4 買入返售金融資產

7.4.7.4.1 各項買入返售金融資產期末餘額

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
交易所市場	-	-
銀行間市場	207,993,078.58	-
合計	207,993,078.58	-
項目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	帳面餘額	其中：買斷式逆回購
交易所市場	-	-
銀行間市場	-	-

合計	-	-
----	---	---

7.4.7.4.2 期末買斷式逆回購交易中取得的債券

無。

7.4.7.5 其他資產

無。

7.4.7.6 其他負債

單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
應付券商交易單元保證金	500,000.00	500,000.00
應付贖回費	34,661.50	36,016.57
應付證券出借違約金	-	-
應付交易費用	12,900,130.73	12,270,363.34
其中：交易所市場	12,895,943.74	12,248,961.52
銀行間市場	4,186.99	21,401.82
應付利息	-	-
預提費用	184,800.00	220,000.00
合計	13,619,592.23	13,026,379.91

7.4.7.7 實收基金

金額單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份額（份）	帳面金額
上年度末	8,491,684,471.48	8,491,684,471.48
本期申購	452,714,216.02	452,714,216.02
本期贖回（以“-”號填列）	-1,079,798,880.11	-1,079,798,880.11
本期末	7,864,599,807.39	7,864,599,807.39

7.4.7.8 未分配利潤

單位：人民幣元

項目	已實現部分	未實現部分	未分配利潤合計
上年度末	-380,977,659.52	1,663,181,578.92	1,282,203,919.40
本期期初	-380,977,659.52	1,663,181,578.92	1,282,203,919.40
本期利潤	-614,527,252.09	1,121,383,836.12	506,856,584.03
本期基金份額交易產生的變動數	59,129,164.45	-156,512,506.54	-97,383,342.09
其中：基金申購款	-41,860,848.82	114,321,777.69	72,460,928.87
基金贖回款	100,990,013.27	-270,834,284.23	-169,844,270.96
本期已分配利潤	-	-	-
本期末	-936,375,747.16	2,628,052,908.50	1,691,677,161.34

7.4.7.9 存款利息收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,566,495.51	2,255,094.12
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
結算備付金利息收入	47,695.80	105,807.66
其他	6,843.54	15,766.69
合計	2,621,034.85	2,376,668.47

7.4.7.10 股票投資收益

7.4.7.10.1 股票投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投資收益——買賣股票差價收入	-724,251,991.86	-236,200,551.72
股票投資收益——贖回差價收入	-	-
股票投資收益——申購差價收入	-	-
股票投資收益——證券出借差價收入	-	-
合計	-724,251,991.86	-236,200,551.72

7.4.7.10.2 股票投資收益——買賣股票差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
賣出股票成交總額	5,887,641,244.80	7,414,173,251.57
減：賣出股票成本總額	6,601,579,094.70	7,629,738,832.82
減：交易費用	10,314,141.96	20,634,970.47
買賣股票差價收入	-724,251,991.86	-236,200,551.72

7.4.7.11 基金投資收益

無。

7.4.7.12 債券投資收益

7.4.7.12.1 債券投資收益項目構成

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
債券投資收益——利息收入	41,883,838.79	62,748,528.71
債券投資收益——買賣債券（債轉股及債券到期兌付）差價收入	2,103,141.44	-6,242,283.53
債券投資收益——贖回差價收入	-	-
債券投資收益——申購差價收入	-	-
合計	43,986,980.23	56,506,245.18

7.4.7.12.2 債券投資收益——買賣債券差價收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成交總額	5,556,140,673.05	9,209,155,668.04
減：賣出債券（債轉股及債券到期兌付）成本總額	5,511,463,263.62	9,136,218,316.07
減：應計利息總額	42,536,163.92	79,115,045.64
減：交易費用	38,104.07	64,589.86
買賣債券差價收入	2,103,141.44	-6,242,283.53

7.4.7.13 資產支持證券投資收益

無。

7.4.7.14 貴金屬投資收益

無。

7.4.7.15 衍生工具收益

無。

7.4.7.16 股利收益

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投資產生的股利收益	193,456,139.79	156,498,028.88
其中：證券出借權益補償收入	-	-
基金投資產生的股利收益	-	-
合計	193,456,139.79	156,498,028.88

7.4.7.17 公允價值變動收益

單位：人民幣元

項目名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融資產	1,121,383,836.12	-1,203,725,261.10
——股票投資	1,120,163,325.35	-1,213,443,754.60
——債券投資	1,220,510.77	9,718,493.50
——資產支持證券投資	-	-
——基金投資	-	-
——貴金屬投資	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——權證投資	-	-
3.其他	-	-
減：應稅金融商品公允價值變動產生的預估增值稅	-	-
合計	1,121,383,836.12	-1,203,725,261.10

7.4.7.18 其他收入

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
基金贖回費收入	1,612,542.14	1,991,264.20
合計	1,612,542.14	1,991,264.20

7.4.7.19 持有基金產生的費用

無。

7.4.7.20 信用減值損失

無。

7.4.7.21 其他費用

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
審計費用	64,800.00	100,000.00
信息披露費	120,000.00	120,000.00
證券出借違約金	-	-
銀行費用	34,597.58	52,644.35
銀行間帳戶維護費	36,000.00	36,000.00

存托服務費	1,059.06	-
其他	1,200.00	1,200.00
合計	257,656.64	309,844.35

7.4.8 或有事項、資產負債表日後事項的說明

7.4.8.1 或有事項

截至資產負債表日，本基金無或有事項。

7.4.8.2 資產負債表日後事項

截至財務報表批准日，本基金無資產負債表日後事項。

7.4.9 關聯方關係

關聯方名稱	與本基金的關係
華夏基金管理有限公司	基金管理人
中國銀行股份有限公司（“中國銀行”）	基金託管人
中信證券股份有限公司（“中信證券”）	基金管理人的股東
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股東
天津海鵬科技諮詢有限公司	基金管理人的股東
華夏資本管理有限公司（“華夏資本”）	基金管理人的子公司
華夏股權投資基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management (Hong Kong) Limited（中文名：華夏基金(香港)有限公司）	基金管理人的子公司
上海華夏財富投資管理有限公司（“華夏財富”）	基金管理人的子公司

注：下述關聯交易均在正常業務範圍內按一般商業條款訂立。

7.4.10 本報告期及上年度可比期間的關聯方交易

7.4.10.1 通過關聯方交易單元進行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金額	佔當期股票成交總額的比例	成交金額	佔當期股票成交總額的比例
中信證券	2,069,055,000.06	19.22%	6,727,239,034.60	43.93%

7.4.10.1.2 權證交易

無。

7.4.10.1.3 債券交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金額	佔當期債券成交總額的比例	成交金額	佔當期債券成交總額的比例
中信證券	1,867,334.95	0.57%	609,069,768.04	48.37%

7.4.10.1.4 債券回購交易

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例	成交金額	佔當期債券回購成交總額的比例
中信證券	-	-	908,258,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 基金交易

無。

7.4.10.1.6 應支付關聯方的佣金

金額單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	1,744,341.31	26.11%	160,660.99	1.25%
關聯方名稱	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日			
	當期佣金	佔當期佣金總量的比例	期末應付佣金餘額	佔期末應付佣金總額的比例
中信證券	6,271,127.46	48.63%	191,244.55	1.56%

注：上述佣金按市場佣金率計算，以扣除由中國證券登記結算有限責任公司收取證管費、經手費和由券商承擔的證券結算風險基金後的淨額列示。該類佣金協議的服務範圍還包括佣金收取方為本基金提供的證券投資研究成果和市場信息服務。根據證監會公告[2024]3號《公開募集證券投資基金證券交易費用管理規定》，自2024年7月1日起，針對被動股票型基金，不再通過交易佣金支付研究服務、流動性服務等其他費用。針對其他類型基金，不再通過交易佣金支付研究服務之外的其他費用。

7.4.10.2 關聯方報酬

7.4.10.2.1 基金管理費

單位：人民幣元

項目	本期	上年度可比期間
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
當期發生的基金應支付的管理費	112,998,714.03	154,328,430.64
其中：應支付銷售機構的客戶維護費	27,540,733.18	37,804,810.69
應支付基金管理人的淨管理費	85,457,980.85	116,523,619.95

注：①支付基金管理人的基金管理人報酬按前一日基金資產淨值 1.20%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金管理人報酬計算公式為：日基金管理人報酬=前一日基金資產淨值×年費率/當年天數。

③客戶維護費是指基金管理人與基金銷售機構約定的用以向基金銷售機構支付客戶服務及銷售活動中產生的相關費用，該費用按照代銷機構所代銷基金的份額保有量作為基數進行計算，從基金管理人收取的基金管理費中列支，不屬於從基金資產中列支的費用項目。

7.4.10.2.2 基金託管費

單位：人民幣元

項目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日
當期發生的基金應支付的託管費	18,833,119.01	25,721,405.09

注：①支付基金託管人的基金託管費按前一日基金資產淨值 0.20%的年費率計提，逐日累計至每月月底，按月支付。

②基金託管費計算公式為：日基金託管費=前一日基金資產淨值×年費率/當年天數。

7.4.10.2.3 銷售服務費

無。

7.4.10.3 與關聯方進行銀行間同業市場的債券(含回購)交易

無。

7.4.10.4 報告期內轉融通證券出借業務發生重大關聯交易事項的說明

7.4.10.4.1 與關聯方通過約定申報方式進行的適用固定期限費率的證券出借業務的情況

無。

7.4.10.4.2 與關聯方通過約定申報方式進行的適用市場化期限費率的證券出借業務的情況

無。

7.4.10.5 各關聯方投資本基金的情況

7.4.10.5.1 報告期內基金管理人運用固有資金投資本基金的情況

無。

7.4.10.5.2 報告期末除基金管理人之外的其他關聯方投資本基金的情況

無。

7.4.10.6 由關聯方保管的銀行存款餘額及當期產生的利息收入

單位：人民幣元

關聯方名稱	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末餘額	當期利息收入	期末餘額	當期利息收入
中國銀行活期存款	238,884,013.01	2,566,495.51	822,298,990.60	2,255,094.12

注：本基金的活期銀行存款由基金託管人中國銀行保管，按銀行同業利率或約定利率計息。

7.4.10.7 本基金在承銷期內參與關聯方承銷證券的情況

金額單位：人民幣元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日					
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位： 股/張）	總金額
中信證券	688708	佳馳科技	新股發行	7,794	211,061.52
中信證券	601033	永興股份	新股發行	12,577	203,747.40
中信證券	688584	上海合晶	新股發行	8,659	196,212.94
中信證券	001391	國貨航	新股發行	46,851	107,757.30
中信證券	301613	新鋁時代	新股發行	2,756	76,341.20
中信證券	001359	平安電工	新股發行	1,833	31,875.87
中信證券	603091	眾鑫股份	新股發行	940	24,910.00
上年度可比期間 2023年1月1日至2023年12月31日					
關聯方名稱	證券代碼	證券名稱	發行方式	基金在承銷期內買入	
				數量（單位： 股/張）	總金額
中信證券	688347	華虹公司	新股發行	70,805	3,681,860.00
中信證券	688563	航材股份	新股發行	15,010	1,185,639.90
中信證券	688343	雲天勵飛	新股發行	24,961	1,096,287.12
中信證券	603296	華勤技術	新股發行	5,925	478,740.00
中信證券	688146	中船特氣	新股發行	10,101	365,151.15
中信證券	001286	陝西能源	新股發行	37,667	361,603.20
中信證券	301559	中集環科	新股發行	13,144	318,347.68
中信證券	301371	敷爾佳	新股發行	5,637	313,868.16
中信證券	688581	安傑思	新股發行	1,629	204,928.20
中信證券	688539	高華科技	新股發行	5,334	203,865.48
中信證券	688522	納睿雷達	新股發行	4,299	200,677.32
中信證券	301439	泓淋電力	新股發行	9,486	189,625.14
中信證券	688523	航太環宇	新股發行	4,717	103,113.62
中信證券	301293	三博腦科	新股發行	3,324	98,390.40

中信證券	301323	新萊福	新股發行	2,277	88,939.62
中信證券	688631	萊斯信息	新股發行	3,357	84,864.96
中信證券	301170	錫南科技	新股發行	2,496	84,864.00
中信證券	301157	華塑科技	新股發行	1,498	84,637.00
中信證券	601133	柏誠股份	新股發行	6,632	77,329.12
中信證券	301261	恒工精密	新股發行	1,973	72,803.70
中信證券	301517	陝西華達	新股發行	1,841	49,467.67
中信證券	603281	江瀚新材	新股發行	863	30,714.17
中信證券	001367	海森藥業	新股發行	549	24,419.52
中信證券	001324	長青科技	新股發行	1,131	21,353.28
中信證券	603162	海通發展	新股發行	523	19,481.75

7.4.10.8 其他關聯交易事項的說明

7.4.10.8.1 其他關聯交易事項的說明

無。

7.4.11 利潤分配情況

本基金本報告期無利潤分配事項。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限證券

7.4.12.1 因認購新發/增發證券而於期末持有的流通受限證券

金額單位：人民幣元

7.4.12.1.1 受限證券類別：股票										
證券代碼	證券名稱	成功認購日	受限期	流通受限類型	認購價格	期末估值單價	數量單位：(股)	期末成本總額	期末估值總額	備註
301626	蘇州天脈	2024-10-17	6 個月	新發流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 個月	新發流通受限	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳馳科技	2024-11-27	6 個月	新發流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 個月	新發流通受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
001391	國貨航	2024-12-23	6 個月	新發流通受限	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	無線傳媒	2024-09-19	6 個月	新發流通	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-

				受限						
603072	天和磁材	2024-12-24	1 個月內(含)	新發流通受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6 個月	新發流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301556	托普雲農	2024-10-10	6 個月	新發流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹連科技	2024-11-12	6 個月	新發流通受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	綠聯科技	2024-07-17	6 個月	新發流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301571	國科天成	2024-08-14	6 個月	新發流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6 個月	新發流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博實結	2024-07-25	6 個月	新發流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新鋁時代	2024-10-18	6 個月	新發流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6 個月	新發流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益諾思	2024-08-27	6 個月	新發流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6 個月	新發流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	喬鋒智能	2024-07-03	6 個月	新發流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6 個月	新發流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 個月	新發流通	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-

				受限						
301552	科力裝備	2024-07-15	6 個月	新發 流通 受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
001279	強邦新材	2024-09-27	6 個月	新發 流通 受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603395	紅四方	2024-11-19	6 個月	新發 流通 受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制藥	2024-08-19	6 個月	新發 流通 受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍華新材	2024-08-07	6 個月	新發 流通 受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	眾鑫股份	2024-09-10	6 個月	新發 流通 受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃達	2024-06-26	6 個月	新發 流通 受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603285	鍵邦股份	2024-06-28	6 個月	新發 流通 受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 個月	新發 流通 受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：①根據中國證監會《上市公司證券發行註冊管理辦法》，基金參與上市公司向特定對象發行股票所獲得的股票，自發行結束之日起 6 個月內不得轉讓。

②基金還可作為特定投資者，認購首次公開發行股票時公司股東公開發售股份，所認購的股份自發行結束之日起 12 個月內不得轉讓。

③根據《上海證券交易所科創板上市公司股東以向特定機構投資者詢價轉讓和配售方式減持股份實施細則》，基金通過詢價轉讓受讓的股份，在受讓後 6 個月內不得轉讓。

④基金可使用以基金名義開設的股票帳戶，選擇網上或者網下一種方式進行新股申購。其中基金參與網下申購獲得的設定限售期的新股或作為戰略投資者參與配售獲得的新股，在新股上市後的約定期限內不能自由轉讓；基金參與網上申購獲配的新股，從新股獲配日至新股上市日之間不能自由轉讓。

7.4.12.2 期末持有的暫時停牌等流通受限股票

無。

7.4.12.3 期末債券正回購交易中作為抵押的債券

7.4.12.3.1 銀行間市場債券正回購

無。

7.4.12.3.2 交易所市場債券正回購

無。

7.4.12.4 期末參與轉融通證券出借業務的證券

無。

7.4.13 金融工具風險及管理

7.4.13.1 風險管理政策和組織架構

本基金的風險管理政策是使基金投資風險可測、可控、可承擔。本基金管理人建立了由風險管理委員會、督察長、法律部、合規部、稽核部、風險管理部和相關業務部門構成的多層次風險管理架構體系。風險管理團隊在識別、衡量投資風險後，通過正式報告的方式，將分析結果及時傳達給基金經理、投資總監、投資決策委員會和風險管理委員會，協助制定風險控制決策，實現風險管理目標。

本基金管理人主要通過定性分析和定量分析的方法，估測各種金融工具風險可能產生的損失。本基金管理人從定性分析的角度出發，判斷風險損失的嚴重性；從定量分析的角度出發，根據本基金的投資目標，結合基金資產所運用的金融工具特徵，通過特定的風險量化指標、模型和日常的量化報告，參考壓力測試結果，確定風險損失的限度和相應置信程度，及時對各種風險進行監督、檢查和評估，並制定相應決策，將風險控制在預期可承受的範圍內。

7.4.13.2 信用風險

信用風險是指由於基金所投資債券的發行人出現違約、拒絕支付到期本息，債券發行人信用評級降低導致債券價格下降，或基金在交易過程中發生交收違約，而造成基金資產損失的可能性。

本基金管理人通過信用分析團隊建立了內部評級體系和交易對手庫，對發行人及債券投資進行內部評級，對交易對手的資信狀況進行充分評估、設定授信額度，以控制可能出現的信用風險。

7.4.13.3 流動性風險

流動性風險是在市場或持有資產流動性不足的情況下，基金管理人可能無法迅速、低成本地調整基金投資組合，從而對基金收益造成不利影響。

本基金管理人通過限制投資集中度來管理投資品種變現的流動性風險。除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限證券”中列示的部分基金資產流通暫時受限制的情況外，本基金所投資的證券均能及

時變現。

7.4.13.3.1 報告期內本基金組合資產的流動性風險分析

在日常運作中，本基金的流動性安排能夠與基金合同約定的申購贖回安排以及投資者的申購贖回規律相匹配。

在資產方面，本基金主要投資於基金合同約定的具有良好流動性的金融工具。基金管理人持續監測本基金持有資產的市場交易量、交易集中度等涉及資產流動性水平的風險指標，並定期開展壓力測試，詳細評估在不同的壓力情景下資產變現情況的變化。

在負債方面，基金管理人持續監測本基金開放期內投資者歷史申贖、投資者類型和結構變化等數據，審慎評估不同市場環境可能帶來的投資者潛在贖回需求，當市場環境或投資者結構發生變化時，及時調整組合資產結構及比例，預留充足現金頭寸，保持基金資產可變現規模和期限與負債贖回規模和期限的匹配。

如遭遇極端市場情形或投資者非預期巨額贖回情形，基金管理人將採用本基金合同約定的贖回申請處理方式及其他各類流動性風險管理工具，控制極端情況下的潛在流動性風險。

7.4.13.4 市場風險

市場風險是指由於市場變化或波動所引起的資產損失的可能性，本基金管理人通過監測組合敏感性指標來衡量市場風險。

7.4.13.4.1 利率風險

利率風險是指利率變動引起組合中資產特別是債券投資的市場價格變動，從而影響基金投資收益的風險。

本基金管理人定期對組合中債券投資部分面臨的利率風險進行監控，並通過調整投資組合的久期等方法對上述利率風險進行管理。

7.4.13.4.1.1 利率風險敞口

單位：人民幣元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
貨幣資金	238,884,013.01	-	-	238,884,013.01
結算備付金	4,709,033.00	-	-	4,709,033.00
結算保證金	586,337.77	-	-	586,337.77
債券投資	2,582,156,490.90	224,016,657.81	-	2,806,173,148.71
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	207,993,078.58	-	-	207,993,078.58
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產	-	-	-	-

款				
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以內	1-5 年	5 年以上	合計
貨幣資金	822,298,990.60	-	-	822,298,990.60
結算備付金	2,025,719.16	-	-	2,025,719.16
結算保證金	286,587.91	-	-	286,587.91
債券投資	1,867,845,487.31	184,101,147.54	-	2,051,946,634.85
資產支持證券	-	-	-	-
買入返售金融資產	-	-	-	-
應收直銷申購款	-	-	-	-
賣出回購金融資產 款	-	-	-	-

注：本表所示為本基金生息資產及負債的公允價值，並按照合約規定的利率重新定價日或到期日孰早者予以分類。

7.4.13.4.1.2 利率風險的敏感性分析

假設	除市場利率以外的其他市場變數保持不變		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的 影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	利率下降 25 個基點	2,564,357.76	2,231,699.14
利率上升 25 個基點	-2,552,567.67	-2,225,199.71	

7.4.13.4.2 外匯風險

外匯風險是指金融工具的公允價值或未來現金流量因外匯匯率變動而發生波動的風險。本基金持有的金融工具以人民幣計價，因此無重大外匯風險。

7.4.13.4.3 其他價格風險

其他價格風險為除市場利率和外匯匯率以外的市場因素（單個證券發行主體自身經營情況或證券市場整體波動）發生變動時導致基金資產發生損失的風險。

本基金通過投資組合的分散化降低市場價格風險。此外，本基金管理人對本基金所持有的證券價格實施監控，定期運用多種定量方法進行風險度量和分析，以對風險進行跟蹤和控制。

7.4.13.4.3.1 其他價格風險敞口

金額單位：人民幣元

項目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允價值	佔基金 資產淨 值比例 (%)	公允價值	佔基金 資產淨 值比例 (%)

交易性金融資產—股票投資	6,335,640,279.80	66.30	6,934,199,278.46	70.95
交易性金融資產—基金投資	-	-	-	-
交易性金融資產—債券投資	29,296.00	0.00	8,824,712.97	0.09
交易性金融資產—貴金屬投資	-	-	-	-
衍生金融資產—權證投資	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合計	6,335,669,575.80	66.30	6,943,023,991.43	71.04

注：①本表中交易性金融資產-債券投資科目僅包含可轉換公司債券和可交換公司債券等。

②由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

7.4.13.4.3.2 其他價格風險的敏感性分析

假設	除滬深 300 指數以外的其他市場變數保持不變		
分析	相關風險變數的變動	對資產負債表日基金資產淨值的 影響金額（單位：人民幣元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	-5%	-334,424,101.70	-351,850,466.14
	+5%	334,424,101.70	351,850,466.14

7.4.14 公允價值

7.4.14.1 金融工具公允價值計量的方法

公允價值計量結果所屬的層次，由對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低層次決定：

第一層次：相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價；

第二層次：除第一層次輸入值外相關資產或負債直接或間接可觀察的輸入值；

第三層次：相關資產或負債的不可觀察輸入值。

7.4.14.2 持續的以公允價值計量的金融工具

7.4.14.2.1 各層次金融工具的公允價值

單位：人民幣元

公允價值計量結果所屬的層次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一層次	6,335,181,350.25	6,938,946,946.18
第二層次	2,806,171,589.21	2,044,020,663.90
第三層次	460,489.05	3,178,303.23
合計	9,141,813,428.51	8,986,145,913.31

7.4.14.2.2 公允價值所屬層次間的重大變動

對於公開市場交易的證券等投資，若出現交易不活躍（包括重大事項停牌、境內證券漲跌停等導致的交易不活躍）和非公開發行等情況，本基金不會於交易不活躍期間及限售期間將相關投資的

公允價值列入第一層次，並根據估值調整中採用的對公允價值計量整體而言具有重要意義的輸入值所屬的最低層次，確定相關投資的公允價值應屬第二層次或第三層次。本基金政策以導致各層次之間轉換的事項發生日作為確定金融工具公允價值層次之間轉換的時點。

7.4.14.2.3 第三層次公允價值餘額及變動情況

7.4.14.2.3.1 第三層次公允價值餘額及變動情況

單位：人民幣元

項目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融資產		合計
	債券投資	股票投資	
期初餘額	-	3,178,303.23	3,178,303.23
當期購買	-	-	-
當期出售/結算	-	-	-
轉入第三層次	-	1,069,720.75	1,069,720.75
轉出第三層次	-	3,472,811.23	3,472,811.23
當期利得或損失總額	-	-314,723.70	-314,723.70
其中：計入損益的利得或損失	-	-314,723.70	-314,723.70
計入其他綜合收益的利得或損失（若有）	-	-	-
期末餘額	-	460,489.05	460,489.05
期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動——公允價值變動損益	-	258,548.02	258,548.02
項目	上年度可比期間 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融資產		合計
	債券投資	股票投資	
期初餘額	-	119,243,909.95	119,243,909.95
當期購買	-	-	-
當期出售/結算	-	-	-
轉入第三層次	-	5,472,070.55	5,472,070.55
轉出第三層次	-	141,728,065.42	141,728,065.42
當期利得或損失總額	-	20,190,388.15	20,190,388.15
其中：計入損益的利得或損失	-	20,190,388.15	20,190,388.15
計入其他綜合收益的利得或損失	-	-	-

(若有)			
期末餘額	-	3,178,303.23	3,178,303.23
期末仍持有的第三層次金融資產計入本期損益的未實現利得或損失的變動——公允價值變動損益	-	-434,127.22	-434,127.22

7.4.14.2.3.2 使用重要不可觀察輸入值的第三層次公允價值計量的情況

單位：人民幣元

項目	本期末公允價值	採用的估值技術	不可觀察輸入值		
			名稱	範圍/加權平均值	與公允價值之間的關係
限售股票	460,489.05	平均價格亞式期權模型	預期年化波動率	0.3423-5.7444	負相關
項目	上年度末公允價值	採用的估值技術	不可觀察輸入值		
			名稱	範圍/加權平均值	與公允價值之間的關係
限售股票	3,178,303.23	平均價格亞式期權模型	預期年化波動率	0.1462-2.1988	負相關

7.4.14.3 非持續的以公允價值計量的金融工具的說明

截至 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持續的以公允價值計量的金融資產。

7.4.14.4 不以公允價值計量的金融工具的相關說明

本基金持有的不以公允價值計量的金融工具為以攤餘成本計量的金融資產和金融負債，這些金融工具因其剩餘期限較短，其帳面價值與公允價值差異很小。

7.4.15 有助於理解和分析會計報表需要說明的其他事項

截至資產負債表日本基金無需要說明的其他重要事項。

§8 投資組合報告

8.1 期末基金資產組合情況

金額單位：人民幣元

序號	項目	金額	佔基金總資產的比例 (%)
1	權益投資	6,335,640,279.80	66.01
	其中：股票	6,335,640,279.80	66.01
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	2,806,173,148.71	29.24

	其中：債券	2,806,173,148.71	29.24
	資產支持證券	-	-
4	貴金屬投資	-	-
5	金融衍生品投資	-	-
6	買入返售金融資產	207,993,078.58	2.17
	其中：買斷式回購的買入返售金融資產	-	-
7	銀行存款和結算備付金合計	243,593,046.01	2.54
8	其他各項資產	4,817,430.61	0.05
9	合計	9,598,216,983.71	100.00

8.2 報告期末按行業分類的股票投資組合

8.2.1 報告期末按行業分類的境內股票投資組合

代碼	行業類別	公允價值（元）	佔基金資產淨值比例（%）
A	農、林、牧、漁業	-	-
B	採礦業	140,944,768.00	1.47
C	製造業	4,553,892,837.31	47.65
D	電力、熱力、燃氣及水生產和供應業	5,218,530.00	0.05
E	建築業	30,647,040.00	0.32
F	批發和零售業	14,170,449.62	0.15
G	交通運輸、倉儲和郵政業	9,841,381.80	0.10
H	住宿和餐飲業	-	-
I	信息傳輸、軟件和信息技術服務業	22,818,284.09	0.24
J	金融業	875,903,549.34	9.17
K	房地產業	612,738,688.56	6.41
L	租賃和商務服務業	5,525,188.60	0.06
M	科學研究和技術服務業	40,843,320.48	0.43
N	水利、環境和公共設施管理業	13,230.00	0.00
O	居民服務、修理和其他服務業	-	-
P	教育	-	-
Q	衛生和社會工作	23,083,012.00	0.24
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	6,335,640,279.80	66.30

8.3 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有股票投資明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	數量(股)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	300750	寧德時代	2,792,604	742,832,664.00	7.77
2	600519	貴州茅台	465,764	709,824,336.00	7.43

3	600048	保利發展	59,040,546	523,099,237.56	5.47
4	600926	杭州銀行	26,166,578	382,293,704.58	4.00
5	600276	恒瑞醫藥	4,999,322	229,468,879.80	2.40
6	603816	顧家家居	6,637,682	183,067,269.56	1.92
7	600809	山西汾酒	991,780	182,695,793.80	1.91
8	600919	江蘇銀行	18,025,238	177,007,837.16	1.85
9	002572	索菲亞	9,595,300	164,847,254.00	1.73
10	000333	美的集團	2,096,270	157,681,429.40	1.65
11	300760	邁瑞醫療	556,082	141,800,910.00	1.48
12	601088	中國神華	3,241,600	140,944,768.00	1.47
13	300628	億聯網絡	3,638,644	140,451,658.40	1.47
14	002043	兔寶寶	11,570,056	137,452,265.28	1.44
15	002594	比亞迪	372,080	105,172,132.80	1.10
16	002371	北方華創	261,114	102,095,574.00	1.07
17	600522	中天科技	6,913,440	99,000,460.80	1.04
18	600007	中國國貿	3,628,400	88,750,664.00	0.93
19	000738	航發控制	3,981,659	88,552,096.16	0.93
20	600862	中航高科	3,312,531	83,674,533.06	0.88
21	002179	中航光電	2,108,391	82,859,766.30	0.87
22	002415	海康威視	2,211,466	67,892,006.20	0.71
23	600887	伊利股份	2,111,100	63,712,998.00	0.67
24	600036	招商銀行	1,461,700	57,444,810.00	0.60
25	300685	艾德生物	2,237,124	51,006,427.20	0.53
26	002966	蘇州銀行	5,882,366	47,705,988.26	0.50
27	000528	柳工	3,130,300	37,751,418.00	0.40
28	000651	格力電器	829,300	37,691,685.00	0.39
29	002025	航太電器	766,851	37,238,284.56	0.39
30	601577	長沙銀行	4,178,400	37,145,976.00	0.39
31	689009	九號公司	781,543	37,123,292.50	0.39
32	000858	五糧液	254,200	35,598,168.00	0.37
33	603338	浙江鼎力	525,020	33,874,290.40	0.35
34	603259	藥明康德	609,420	33,542,476.80	0.35
35	002142	寧波銀行	1,379,214	33,528,692.34	0.35
36	601528	瑞豐銀行	5,939,373	33,438,669.99	0.35
37	300274	陽光電源	449,855	33,212,794.65	0.35
38	001323	慕思股份	863,431	32,646,326.11	0.34
39	002847	鹽津鋪子	521,010	32,615,226.00	0.34
40	002920	德賽西威	288,000	31,711,680.00	0.33
41	601668	中國建築	5,107,840	30,647,040.00	0.32
42	688506	百利天恒	156,933	30,088,764.09	0.31
43	300181	佐力藥業	1,925,100	29,569,536.00	0.31
44	300476	勝宏科技	693,300	29,180,997.00	0.31
45	601288	農業銀行	5,443,600	29,068,824.00	0.30
46	601100	恒立液壓	542,000	28,601,340.00	0.30

47	000596	古井貢酒	157,854	27,356,098.20	0.29
48	002422	科倫藥業	854,900	25,587,157.00	0.27
49	600535	天士力	1,763,695	25,503,029.70	0.27
50	601825	滬農商行	2,884,051	24,543,274.01	0.26
51	603801	志邦家居	1,898,900	24,324,909.00	0.25
52	300015	愛爾眼科	1,697,900	22,497,175.00	0.24
53	601939	建設銀行	2,418,200	21,255,978.00	0.22
54	000680	山推股份	2,180,700	21,152,790.00	0.22
55	600893	航發動力	494,300	20,488,735.00	0.21
56	000786	北新建材	673,600	20,416,816.00	0.21
57	002508	老闆電器	944,900	20,249,207.00	0.21
58	603008	喜臨門	1,176,400	19,716,464.00	0.21
59	002946	新乳業	1,330,200	19,301,202.00	0.20
60	000538	雲南白藥	315,340	18,904,633.00	0.20
61	688297	中無人機	455,188	18,334,972.64	0.19
62	000999	華潤三九	410,843	18,216,778.62	0.19
63	601229	上海銀行	1,710,900	15,654,735.00	0.16
64	600285	羚銳制藥	684,800	15,175,168.00	0.16
65	603833	歐派家居	215,644	14,866,497.36	0.16
66	688266	澤璟制藥	219,780	13,694,491.80	0.14
67	688016	心脈醫療	123,071	13,519,349.35	0.14
68	300395	菲利華	345,417	12,991,133.37	0.14
69	300567	精測電子	187,900	12,081,970.00	0.13
70	688197	首藥控股	403,615	12,043,871.60	0.13
71	688188	柏楚電子	59,875	11,630,718.75	0.12
72	003012	東鵬控股	1,735,900	11,474,299.00	0.12
73	002697	紅旗連鎖	1,857,800	10,979,598.00	0.11
74	002901	大博醫療	349,500	10,778,580.00	0.11
75	601166	興業銀行	544,700	10,436,452.00	0.11
76	002304	洋河股份	123,400	10,307,602.00	0.11
77	688062	邁威生物	504,749	10,195,929.80	0.11
78	000425	徐工機械	1,244,800	9,871,264.00	0.10
79	601000	唐山港	2,082,700	9,809,517.00	0.10
80	601689	拓普集團	177,625	8,703,625.00	0.09
81	600566	濟川藥業	298,800	8,689,104.00	0.09
82	002475	立訊精密	199,161	8,117,802.36	0.08
83	603369	今世緣	163,211	7,382,033.53	0.08
84	300529	健帆生物	247,800	7,270,452.00	0.08
85	601838	成都銀行	372,800	6,378,608.00	0.07
86	603195	公牛集團	89,780	6,306,147.20	0.07
87	300661	聖邦股份	75,157	6,146,339.46	0.06
88	688235	百濟神州	34,690	5,585,783.80	0.06
89	600900	長江電力	176,600	5,218,530.00	0.05
90	300034	鋼研高納	318,340	4,966,104.00	0.05

91	600941	中國移動	41,820	4,941,451.20	0.05
92	002027	分眾傳媒	701,500	4,931,545.00	0.05
93	688488	艾迪藥業	609,414	4,789,994.04	0.05
94	003000	勁仔食品	347,600	4,762,120.00	0.05
95	300347	泰格醫藥	85,000	4,642,700.00	0.05
96	688521	芯原股份	86,977	4,560,204.11	0.05
97	002432	九安醫療	107,300	4,375,694.00	0.05
98	300308	中際旭創	34,460	4,256,154.60	0.04
99	002595	豪邁科技	84,800	4,256,112.00	0.04
100	002463	滬電股份	100,300	3,976,895.00	0.04
101	600557	康緣藥業	287,978	3,922,260.36	0.04
102	603551	奧普科技	343,500	3,668,580.00	0.04
103	300014	億緯鋰能	69,027	3,226,321.98	0.03
104	301363	美好醫療	98,400	3,190,128.00	0.03
105	688443	智翔金泰	119,785	3,005,405.65	0.03
106	300832	新產業	38,800	2,748,980.00	0.03
107	000963	華東醫藥	47,700	1,650,420.00	0.02
108	603939	益豐藥房	61,700	1,488,821.00	0.02
109	301257	普蕊斯	52,910	1,426,453.60	0.01
110	300558	貝達藥業	24,521	1,322,417.53	0.01
111	300723	一品紅	71,400	1,218,084.00	0.01
112	000977	浪潮信息	23,200	1,203,616.00	0.01
113	600438	通威股份	51,300	1,134,243.00	0.01
114	688617	惠泰醫療	2,701	1,005,663.33	0.01
115	300413	芒果超媒	37,270	1,002,190.30	0.01
116	002821	凱萊英	12,000	913,080.00	0.01
117	688658	悅康藥業	57,363	826,600.83	0.01
118	002262	恩華藥業	31,900	776,765.00	0.01
119	603506	南都物業	89,300	759,943.00	0.01
120	300759	康龍化成	29,213	750,774.10	0.01
121	688012	中微公司	3,841	726,563.56	0.01
122	000568	瀘州老窖	5,400	676,080.00	0.01
123	603606	東方電纜	12,800	672,640.00	0.01
124	301050	雷電微力	11,760	606,580.80	0.01
125	600153	建發股份	56,430	593,643.60	0.01
126	300454	深信服	9,200	528,080.00	0.01
127	002756	永興材料	13,900	524,308.00	0.01
128	002850	科達利	5,344	522,001.92	0.01
129	301267	華廈眼科	26,550	505,512.00	0.01
130	603127	昭衍新藥	26,434	439,597.42	0.00
131	688428	諾誠健華	34,472	423,316.16	0.00
132	688331	榮昌生物	12,369	372,430.59	0.00
133	002409	雅克科技	6,200	359,290.00	0.00
134	002812	恩捷股份	11,210	358,607.90	0.00

135	002709	天賜材料	14,740	290,672.80	0.00
136	688236	春立醫療	22,030	281,984.00	0.00
137	603501	韋爾股份	2,200	229,702.00	0.00
138	603998	方盛制藥	21,874	227,927.08	0.00
139	300373	揚傑科技	4,800	208,896.00	0.00
140	002603	以嶺藥業	11,215	179,552.15	0.00
141	601058	賽輪輪胎	10,000	143,300.00	0.00
142	301360	榮旗科技	2,540	136,296.40	0.00
143	603197	保隆科技	3,595	135,711.25	0.00
144	002648	衛星化學	6,600	124,014.00	0.00
145	603650	彤程新材	3,300	115,401.00	0.00
146	688085	三友醫療	4,748	100,610.12	0.00
147	600266	城建發展	18,600	94,860.00	0.00
148	600161	天壇生物	4,535	92,967.50	0.00
149	000513	麗珠集團	2,243	85,234.00	0.00
150	001301	尚太科技	1,200	82,260.00	0.00
151	002044	美年健康	17,500	80,325.00	0.00
152	688692	達夢數據	175	63,777.00	0.00
153	301626	蘇州天脈	957	62,951.46	0.00
154	603296	華勤技術	830	58,888.50	0.00
155	688169	石頭科技	268	58,769.72	0.00
156	688041	海光信息	390	58,418.10	0.00
157	603711	香飄飄	3,500	57,400.00	0.00
158	688117	聖諾生物	2,060	52,880.20	0.00
159	603233	大參林	3,427	51,610.62	0.00
160	600211	西藏藥業	1,300	48,022.00	0.00
161	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
162	603456	九洲藥業	3,400	46,512.00	0.00
163	301356	天振股份	2,900	45,704.00	0.00
164	688708	佳馳科技	780	38,181.00	0.00
165	600325	華發股份	5,900	33,984.00	0.00
166	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
167	001391	國貨航	4,686	31,864.80	0.00
168	688202	美迪西	1,000	30,170.00	0.00
169	301551	無線傳媒	652	28,185.96	0.00
170	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
171	688271	聯影醫療	211	26,670.40	0.00
172	301303	真蘭儀錶	1,481	22,688.92	0.00
173	001311	多利科技	844	21,766.76	0.00
174	688082	盛美上海	212	21,200.00	0.00
175	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
176	301556	托普雲農	267	15,766.35	0.00
177	301631	壹連科技	153	15,599.88	0.00
178	301606	綠聯科技	396	14,450.04	0.00

179	301571	國科天成	350	14,290.50	0.00
180	603341	龍旗科技	298	13,931.50	0.00
181	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
182	000888	峨眉山 A	1,000	13,230.00	0.00
183	301608	博實結	184	12,029.92	0.00
184	301613	新鋁時代	276	11,528.52	0.00
185	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
186	688710	益諾思	332	11,148.56	0.00
187	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
188	301603	喬鋒智能	233	9,781.34	0.00
189	688578	艾力斯	163	9,763.70	0.00
190	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
191	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
192	301552	科力裝備	143	8,132.41	0.00
193	688036	傳音控股	83	7,885.00	0.00
194	001279	強邦新材	265	7,396.15	0.00
195	688530	歐萊新材	344	6,370.88	0.00
196	688351	微電生理	318	6,054.72	0.00
197	301502	華陽智能	138	5,947.80	0.00
198	603395	紅四方	154	5,508.58	0.00
199	603207	小方制藥	185	4,930.25	0.00
200	603310	巍華新材	254	4,559.30	0.00
201	603091	眾鑫股份	94	4,176.42	0.00
202	603350	安乃達	106	3,834.02	0.00
203	603285	鍵邦股份	129	2,916.69	0.00
204	688382	益方生物	159	2,114.70	0.00
205	688200	華峰測控	4	418.00	0.00
206	688121	卓然股份	2	21.54	0.00

8.4 報告期內股票投資組合的重大變動

8.4.1 累計買入金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計買入金額	佔期初基金資產淨值比例 (%)
1	600809	山西汾酒	248,601,807.63	2.54
2	600048	保利發展	196,741,019.74	2.01
3	603816	顧家家居	148,489,410.50	1.52
4	000333	美的集團	144,840,772.10	1.48
5	601088	中國神華	139,203,677.87	1.42
6	002043	兔寶寶	136,524,306.31	1.40
7	600919	江蘇銀行	133,796,773.28	1.37
8	688506	百利天恒	120,391,713.54	1.23

9	300760	邁瑞醫療	119,754,031.71	1.23
10	002572	索菲亞	117,836,758.99	1.21
11	002966	蘇州銀行	106,362,914.10	1.09
12	600557	康緣藥業	104,503,080.58	1.07
13	603259	藥明康德	102,132,785.80	1.04
14	600276	恒瑞醫藥	97,968,075.04	1.00
15	300274	陽光電源	84,510,593.50	0.86
16	001914	招商積餘	77,263,868.00	0.79
17	600887	伊利股份	73,610,686.00	0.75
18	002415	海康威視	70,624,030.40	0.72
19	002466	天齊鋰業	66,625,436.05	0.68
20	600036	招商銀行	63,668,666.00	0.65

注：“買入金額”按買入成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.2 累計賣出金額超出期初基金資產淨值 2%或前 20 名的股票明細

金額單位：人民幣元

序號	股票代碼	股票名稱	本期累計賣出金額	佔期初基金資產淨值比例（%）
1	601668	中國建築	380,666,273.39	3.89
2	600048	保利發展	373,139,239.64	3.82
3	600919	江蘇銀行	173,464,717.19	1.77
4	600276	恒瑞醫藥	157,802,113.63	1.61
5	600519	貴州茅台	153,657,718.90	1.57
6	603259	藥明康德	142,591,211.83	1.46
7	600862	中航高科	134,107,333.98	1.37
8	600557	康緣藥業	133,230,210.74	1.36
9	300750	寧德時代	126,104,917.08	1.29
10	688506	百利天恒	124,868,160.32	1.28
11	000999	華潤三九	115,191,667.43	1.18
12	603369	今世緣	113,133,850.00	1.16
13	688012	中微公司	108,272,566.87	1.11
14	300760	邁瑞醫療	107,036,890.36	1.10
15	300059	東方財富	105,299,690.52	1.08
16	002142	寧波銀行	100,560,583.00	1.03
17	002371	北方華創	97,383,436.00	1.00
18	300274	陽光電源	93,657,368.20	0.96
19	300034	鋼研高納	87,847,218.00	0.90
20	688235	百濟神州	83,808,987.68	0.86

注：“賣出金額”按賣出成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.4.3 買入股票的成本總額及賣出股票的收入總額

單位：人民幣元

買入股票成本（成交）總額	4,882,856,770.69
賣出股票收入（成交）總額	5,887,641,244.80

注：“買入股票成本”、“賣出股票收入”均按買賣成交金額（成交單價乘以成交數量）填列，不考慮相關交易費用。

8.5 期末按債券品種分類的債券投資組合

金額單位：人民幣元

序號	債券品種	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	國家債券	-	-
2	央行票據	-	-
3	金融債券	2,606,031,688.33	27.27
	其中：政策性金融債	2,143,087,322.85	22.43
4	企業債券	-	-
5	企業短期融資券	200,112,164.38	2.09
6	中期票據	-	-
7	可轉債（可交換債）	29,296.00	0.00
8	同業存單	-	-
9	其他	-	-
10	合計	2,806,173,148.71	29.36

8.6 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名債券投資明細

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	數量(張)	公允價值	佔基金資產淨值比例(%)
1	240301	24 進出 01	10,800,000	1,101,440,655.74	11.53
2	240401	24 農發 01	5,500,000	558,858,907.10	5.85
3	524020	24 廣 D14	3,000,000	300,716,827.41	3.15
4	012484022	24 大唐集 SCP005	2,000,000	200,112,164.38	2.09
5	2202002QF	22 國開綠債 02 清發	1,800,000	184,056,410.96	1.93

8.7 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的所有資產支持證券投資明細

本基金本報告期末未持有資產支持證券。

8.8 報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

本基金本報告期末未持有貴金屬。

8.9 期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名權證投資明細

本基金本報告期末未持有權證。

8.10 本基金投資股指期貨的投資政策

本基金本報告期末無股指期貨投資。

8.11 報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

8.11.1 本期國債期貨投資政策

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.11.2 本期國債期貨投資評價

本基金本報告期末無國債期貨投資。

8.12 投資組合報告附注

8.12.1 報告期內，本基金投資決策程序符合相關法律法規的要求，未發現本基金投資的前十名證券的發行主體本期出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

8.12.2 基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

8.12.3 期末其他各項資產構成

單位：人民幣元

序號	名稱	金額
1	存出保證金	586,337.77
2	應收清算款	3,198,803.13
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	1,032,289.71
6	其他應收款	-
7	待攤費用	-
8	其他	-
9	合計	4,817,430.61

8.12.4 期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

金額單位：人民幣元

序號	債券代碼	債券名稱	公允價值	佔基金資產淨值比例 (%)
1	113655	歐 22 轉債	1,120.17	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

本基金本報告期末前十名股票中不存在流通受限情況。

8.12.6 投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入的原因，分項之和與合計項之間可能存在尾數差異。

§9 基金份額持有人信息

9.1 期末基金份額持有人戶數及持有人結構

份額單位：份

持有人戶數 (戶)	戶均持有的 基金份額	持有人結構			
		機構投資者		個人投資者	
		持有份額	佔總份額比例	持有份額	佔總份額比例
832,186	9,450.53	41,111,258.97	0.52%	7,823,488,548.42	99.48%

9.2 期末基金管理人的從業人員持有本基金的情況

項目	持有份額總數（份）	佔基金總份額比例
基金管理人所有從業人員持有本 基金	3,122,430.46	0.04%

9.3 期末基金管理人的從業人員持有本開放式基金份額總量區間的情況

項目	持有基金份額總量的數量區間（萬份）
本公司高級管理人員、基金投資和研究部門負責人 持有本開放式基金	10~50
本基金基金經理持有本開放式基金	>100

§10 開放式基金份額變動

單位：份

基金合同生效日（2003年9月5日）基金份額總額	3,796,885,823.40
本報告期期初基金份額總額	8,491,684,471.48
本報告期基金總申購份額	452,714,216.02
減：本報告期基金總贖回份額	1,079,798,880.11
本報告期基金拆分變動份額	-
本報告期期末基金份額總額	7,864,599,807.39

§11 重大事件披露

11.1 基金份額持有人大會決議

本報告期內，本基金無基金份額持有人大會決議。

11.2 基金管理人、基金託管人的專門基金託管部門的重大人事變動

本報告期內，本基金管理人未發生重大人事變動。

本報告期內，經中國銀行股份有限公司研究決定，郭德秋先生不再擔任中國銀行股份有限公司託管業務部總經理職務。上述人事變動已按相關規定備案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金財產、基金託管業務的訴訟

本報告期末發生影響基金管理人經營或基金運營業務的訴訟。

本報告期無涉及基金財產、基金託管業務的訴訟。

11.4 基金投資策略的改變

本基金本報告期投資策略未發生改變。

11.5 為基金進行審計的會計師事務所情況

本基金本報告期應支付給安永華明會計師事務所(特殊普通合夥)的報酬為 64,800.00 元人民幣。截至本報告期末，該事務所已向本基金提供 22 年的審計服務。

11.6 管理人、託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

措施 1	內容
受到稽查或處罰等措施的主體	管理人
受到稽查或處罰等措施的時間	2024-07-05
採取稽查或處罰等措施的機構	中國證監會北京監管局
受到的具體措施類型	責令改正並暫停辦理相關業務行政監管措施
受到稽查或處罰等措施的原因	部分制度不健全或執行不到位，部分業務管控不嚴
管理人採取整改措施的情況(如提出整改意見)	基金管理人高度重視，已按要求完成了整改，並已將整改落實情況報送監管機構
其他	無
措施 2	內容
受到稽查或處罰等措施的主體	高級管理人員
受到稽查或處罰等措施的時間	2024-08-16
採取稽查或處罰等措施的機構	中國證監會北京監管局
受到的具體措施類型	警示函
受到稽查或處罰等措施的原因	部分制度不健全或執行不到位，部分業務管控不嚴
管理人採取整改措施的情況(如提出整改意見)	不適用
其他	無

11.6.1 託管人及其高級管理人員受稽查或處罰等情況

本報告期內，本基金託管人的託管業務部門及其相關高級管理人員無受稽查或處罰等情況。

11.7 基金租用證券公司交易單元的有關情況

11.7.1 基金租用證券公司交易單元進行股票投資及佣金支付情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	交易單元數量	股票交易		應支付該券商的佣金		備註
		成交金額	佔當期股票成交總額的比例	佣金	佔當期佣金總量的比例	
興業證券	2	2,810,329,076.42	26.10%	1,490,857.59	22.32%	-

中信證券	2	2,069,055,000.06	19.22%	1,744,341.31	26.11%	-
廣發證券	1	1,608,182,181.66	14.94%	840,743.44	12.59%	-
德邦證券	1	1,110,754,716.06	10.32%	576,833.31	8.63%	-
中天證券	1	532,317,600.39	4.94%	393,841.03	5.90%	-
申萬宏源證券	1	512,930,006.89	4.76%	229,008.40	3.43%	-
國泰君安證券	1	453,412,867.93	4.21%	317,044.42	4.75%	-
長江證券	1	369,894,538.39	3.44%	166,242.98	2.49%	-
瑞銀證券	1	325,919,691.24	3.03%	145,330.45	2.18%	-
中國銀河證券	1	306,894,885.99	2.85%	290,289.68	4.35%	-
恒泰證券	1	266,479,232.98	2.47%	198,769.89	2.98%	-
海通證券	1	114,794,178.80	1.07%	104,745.67	1.57%	-
西部證券	1	111,425,600.72	1.03%	83,111.89	1.24%	-
國投證券	-	103,056,886.44	0.96%	45,953.30	0.69%	-
國都證券	1	71,459,996.67	0.66%	53,302.56	0.80%	-

注：①為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇研究服務證券公司的標準，即：

i 投研部門根據證券公司的總體資質情況、財務狀況、研究服務能力、經營行為及風控合規能力等情況，選擇證券公司進入交易合作庫，並進行跟蹤評估，對合作庫證券公司進行調整。

ii 投研部門牽頭制定證券公司研究服務評價制度，建立健全對證券公司研究服務的定期評價機制。評價指標包括但不限於：業績貢獻、回饋速度、觀點或數據品質等。

②為了貫徹中國證監會的有關規定，我公司制定了選擇交易服務證券公司的標準，即：

i 投資部門根據證券公司的總體資質、財務狀況、經營行為和合規風控能力、交易服務能力等情況，選擇證券公司進入交易合作庫，並進行跟蹤監控，對合作庫證券公司進行調整。

ii 投資部門牽頭制定證券公司交易服務評價制度，建立健全對證券公司交易服務的定期評價機制。

iii 投資部門定期對證券公司的交易服務開展評價，評價指標包括但不限於：交易服務成本、交易服務能力、交易系統穩定性、交易系統支持能力、應急交易能力等。

③證券公司專用交易單元選擇程序：

i 投資、研究部門牽頭制定規範、合理的合作證券公司管理制度，明確證券公司准入標準、退出程序等。合規管理部門對合作證券公司管理制度進行合規性審查。

ii 投資、研究部門根據上述標準進行評估並確定選用的證券公司。

iii 本基金管理人與被選擇的證券公司簽訂交易單元租用協議/證券經紀服務協議。

④除本表列示外，本基金還選擇了財通證券、東方證券、信達證券、招商證券、中銀國際證券的交易單元作為本基金交易單元，本報告期無股票交易及應付佣金。

⑤在上述租用的券商交易單元中，招商證券的交易單元為本基金本期新增的交易單元，川財證

券、國投證券、西南證券、中泰證券的交易單元為本期剔除的交易單元。

⑥本部分的數據統計時間區間與本報告的報告期一致；本公司網站披露的《華夏基金管理有限
公司旗下公募基金通過證券公司證券交易及佣金支付情況（2024 年度）》的報告期為 2024 年 7 月 1
日至 2024 年 12 月 31 日。敬請投資者關注上述報告統計時間區間的口徑差異。

11.7.2 基金租用證券公司交易單元進行其他證券投資的情況

金額單位：人民幣元

券商名稱	債券交易		債券回購交易		權證交易		基金交易	
	成交金額	佔當期 債券成 交總額 的比例	成交金 額	佔當 期債 券回 購成 交總 額的 比例	成交金額	佔當 期權 證成 交總 額的 比例	成交金 額	佔當 期基 金成 交總 額的 比例
興業證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信證券	1,867,334.95	0.57%	-	-	-	-	-	-
廣發證券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天證券	-	-	-	-	-	-	-	-
申萬宏源證 券	20,000,000.00	6.09%	-	-	-	-	-	-
國泰君安證 券	-	-	-	-	-	-	-	-
長江證券	6,642,837.18	2.02%	-	-	-	-	-	-
瑞銀證券	-	-	-	-	-	-	-	-
中國銀河證 券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰證券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通證券	300,000,000.00	91.32%	-	-	-	-	-	-
西部證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國投證券	-	-	-	-	-	-	-	-
國都證券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序號	公告事項	法定披露方式	法定披露日期
1	華夏基金管理有限 公司關於旗下基金投資關聯 方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及 網站	2024-01-13
2	華夏基金管理有限 公司關於旗下基金投資關聯 方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及 網站	2024-02-03
3	華夏基金管理有限 公司關於旗下基金投資關聯 方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及 網站	2024-03-21
4	華夏基金管理有限 公司關於旗下基金投資關聯	中國證監會規定報刊及	2024-09-12

	方承銷證券的公告	網站	
5	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及網站	2024-10-19
6	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及網站	2024-11-29
7	華夏基金管理有限公司關於旗下基金投資關聯方承銷證券的公告	中國證監會規定報刊及網站	2024-12-25

§12 影響投資者決策的其他重要信息

12.1 報告期內單一投資者持有基金份額比例達到或超過 20%的情況

本基金本報告期內未出現單一投資者持有基金份額比例達到或超過20%的情況。

§13 備查文件目錄

13.1 備查文件目錄

- 1、中國證監會核准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、託管協議；
- 4、法律意見書；
- 5、基金管理人業務資格批件、營業執照；
- 6、基金託管人業務資格批件、營業執照。

13.2 存放地點

備查文件存放於基金管理人和/或基金託管人的住所。

13.3 查閱方式

投資者可到基金管理人和/或基金託管人的住所免費查閱備查文件。在支付工本費後，投資者可在合理時間內取得備查文件的複製件或複印本。

§14 補充披露

補充披露 1：期末基金資產組合情況

名稱	數量（股）	公允價值（人民幣元）
(1)股票投資		
上市投資		
中國(100%)		

寧德時代	2,792,604	742,832,664.00
貴州茅台	465,764	709,824,336.00
保利發展	59,040,546	523,099,237.56
杭州銀行	26,166,578	382,293,704.58
恒瑞醫藥	4,999,322	229,468,879.80
顧家家居	6,637,682	183,067,269.56
山西汾酒	991,780	182,695,793.80
江蘇銀行	18,025,238	177,007,837.16
索菲亞	9,595,300	164,847,254.00
美的集團	2,096,270	157,681,429.40
邁瑞醫療	556,082	141,800,910.00
中國神華	3,241,600	140,944,768.00
億聯網絡	3,638,644	140,451,658.40
兔寶寶	11,570,056	137,452,265.28
比亞迪	372,080	105,172,132.80
北方華創	261,114	102,095,574.00
中天科技	6,913,440	99,000,460.80
中國國貿	3,628,400	88,750,664.00
航發控制	3,981,659	88,552,096.16
中航高科	3,312,531	83,674,533.06
中航光電	2,108,391	82,859,766.30
海康威視	2,211,466	67,892,006.20
伊利股份	2,111,100	63,712,998.00
招商銀行	1,461,700	57,444,810.00
艾德生物	2,237,124	51,006,427.20
蘇州銀行	5,882,366	47,705,988.26
柳工	3,130,300	37,751,418.00
格力電器	829,300	37,691,685.00
航太電器	766,851	37,238,284.56
長沙銀行	4,178,400	37,145,976.00
九號公司	781,543	37,123,292.50
五糧液	254,200	35,598,168.00
浙江鼎力	525,020	33,874,290.40
藥明康德	609,420	33,542,476.80
寧波銀行	1,379,214	33,528,692.34
瑞豐銀行	5,939,373	33,438,669.99
陽光電源	449,855	33,212,794.65
慕思股份	863,431	32,646,326.11
鹽津鋪子	521,010	32,615,226.00
德賽西威	288,000	31,711,680.00
中國建築	5,107,840	30,647,040.00
百利天恒	156,933	30,088,764.09
佐力藥業	1,925,100	29,569,536.00
勝宏科技	693,300	29,180,997.00

農業銀行	5,443,600	29,068,824.00
恒立液壓	542,000	28,601,340.00
古井貢酒	157,854	27,356,098.20
科倫藥業	854,900	25,587,157.00
天士力	1,763,695	25,503,029.70
滬農商行	2,884,051	24,543,274.01
志邦家居	1,898,900	24,324,909.00
愛爾眼科	1,697,900	22,497,175.00
建設銀行	2,418,200	21,255,978.00
山推股份	2,180,700	21,152,790.00
航發動力	494,300	20,488,735.00
北新建材	673,600	20,416,816.00
老闆電器	944,900	20,249,207.00
喜臨門	1,176,400	19,716,464.00
新乳業	1,330,200	19,301,202.00
雲南白藥	315,340	18,904,633.00
中無人機	455,188	18,334,972.64
華潤三九	410,843	18,216,778.62
上海銀行	1,710,900	15,654,735.00
羚銳制藥	684,800	15,175,168.00
歐派家居	215,644	14,866,497.36
澤璟制藥	219,780	13,694,491.80
心脈醫療	123,071	13,519,349.35
菲利華	345,417	12,991,133.37
精測電子	187,900	12,081,970.00
首藥控股	403,615	12,043,871.60
柏楚電子	59,875	11,630,718.75
東鵬控股	1,735,900	11,474,299.00
紅旗連鎖	1,857,800	10,979,598.00
大博醫療	349,500	10,778,580.00
興業銀行	544,700	10,436,452.00
洋河股份	123,400	10,307,602.00
邁威生物	504,749	10,195,929.80
徐工機械	1,244,800	9,871,264.00
唐山港	2,082,700	9,809,517.00
拓普集團	177,625	8,703,625.00
濟川藥業	298,800	8,689,104.00
立訊精密	199,161	8,117,802.36
今世緣	163,211	7,382,033.53
健帆生物	247,800	7,270,452.00
成都銀行	372,800	6,378,608.00
公牛集團	89,780	6,306,147.20
聖邦股份	75,157	6,146,339.46
百濟神州	34,690	5,585,783.80

長江電力	176,600	5,218,530.00
鋼研高納	318,340	4,966,104.00
中國移動	41,820	4,941,451.20
分眾傳媒	701,500	4,931,545.00
艾迪藥業	609,414	4,789,994.04
勁仔食品	347,600	4,762,120.00
泰格醫藥	85,000	4,642,700.00
芯原股份	86,977	4,560,204.11
九安醫療	107,300	4,375,694.00
中際旭創	34,460	4,256,154.60
豪邁科技	84,800	4,256,112.00
滬電股份	100,300	3,976,895.00
康緣藥業	287,978	3,922,260.36
奧普科技	343,500	3,668,580.00
億緯鋰能	69,027	3,226,321.98
美好醫療	98,400	3,190,128.00
智翔金泰	119,785	3,005,405.65
新產業	38,800	2,748,980.00
華東醫藥	47,700	1,650,420.00
益豐藥房	61,700	1,488,821.00
普蕊斯	52,910	1,426,453.60
貝達藥業	24,521	1,322,417.53
一品紅	71,400	1,218,084.00
浪潮信息	23,200	1,203,616.00
通威股份	51,300	1,134,243.00
惠泰醫療	2,701	1,005,663.33
芒果超媒	37,270	1,002,190.30
凱萊英	12,000	913,080.00
悅康藥業	57,363	826,600.83
恩華藥業	31,900	776,765.00
南都物業	89,300	759,943.00
康龍化成	29,213	750,774.10
中微公司	3,841	726,563.56
瀘州老窖	5,400	676,080.00
東方電纜	12,800	672,640.00
雷電微力	11,760	606,580.80
建發股份	56,430	593,643.60
深信服	9,200	528,080.00
永興材料	13,900	524,308.00
科達利	5,344	522,001.92
華廈眼科	26,550	505,512.00
昭衍新藥	26,434	439,597.42
諾誠健華	34,472	423,316.16
榮昌生物	12,369	372,430.59

雅克科技	6,200	359,290.00
恩捷股份	11,210	358,607.90
天賜材料	14,740	290,672.80
春立醫療	22,030	281,984.00
韋爾股份	2,200	229,702.00
方盛制藥	21,874	227,927.08
揚傑科技	4,800	208,896.00
以嶺藥業	11,215	179,552.15
賽輪輪胎	10,000	143,300.00
榮旗科技	2,540	136,296.40
保隆科技	3,595	135,711.25
衛星化學	6,600	124,014.00
彤程新材	3,300	115,401.00
三友醫療	4,748	100,610.12
城建發展	18,600	94,860.00
天壇生物	4,535	92,967.50
麗珠集團	2,243	85,234.00
尚太科技	1,200	82,260.00
美年健康	17,500	80,325.00
達夢數據	175	63,777.00
蘇州天脈	957	62,951.46
華勤技術	830	58,888.50
石頭科技	268	58,769.72
海光信息	390	58,418.10
香飄飄	3,500	57,400.00
聖諾生物	2,060	52,880.20
大參林	3,427	51,610.62
西藏藥業	1,300	48,022.00
合合信息	289	47,910.42
九洲藥業	3,400	46,512.00
天振股份	2,900	45,704.00
佳馳科技	780	38,181.00
華發股份	5,900	33,984.00
拉普拉斯	979	32,365.74
國貨航	4,686	31,864.80
美迪西	1,000	30,170.00
無線傳媒	652	28,185.96
天和磁材	2,255	27,736.50
聯影醫療	211	26,670.40
真蘭儀錶	1,481	22,688.92
多利科技	844	21,766.76
盛美上海	212	21,200.00
上大股份	816	20,269.44
托普雲農	267	15,766.35

壹連科技	153	15,599.88
綠聯科技	396	14,450.04
國科天成	350	14,290.50
龍旗科技	298	13,931.50
英思特	306	13,745.52
峨眉山 A	1,000	13,230.00
博實結	184	12,029.92
新鋁時代	276	11,528.52
佳力奇	215	11,425.10
益諾思	332	11,148.56
博苑股份	253	10,066.87
喬鋒智能	233	9,781.34
艾力斯	163	9,763.70
富特科技	257	9,287.98
中力股份	291	8,185.83
科力裝備	143	8,132.41
傳音控股	83	7,885.00
強邦新材	265	7,396.15
歐萊新材	344	6,370.88
微電生理	318	6,054.72
華陽智能	138	5,947.80
紅四方	154	5,508.58
小方制藥	185	4,930.25
巍華新材	254	4,559.30
眾鑫股份	94	4,176.42
安乃達	106	3,834.02
鍵邦股份	129	2,916.69
益方生物	159	2,114.70
華峰測控	4	418.00
卓然股份	2	21.54
合計	257,072,446	6,335,640,279.80
(2)債券投資		
上市投資		
中國(100%)		
24 進出 01	10,800,000	1,101,440,655.74
24 農發 01	5,500,000	558,858,907.10
24 廣 D14	3,000,000	300,716,827.41
24 大唐集 SCP005	2,000,000	200,112,164.38
22 國開綠債 02 清發	1,800,000	184,056,410.96
24 農發 21	800,000	80,652,493.15
15 國開 18	700,000	72,028,504.11
24 光大銀行小微債	700,000	71,884,956.16
24 平安證券 CP015	700,000	70,048,865.75

19 農發 08	500,000	52,535,452.05
22 進出 05	500,000	52,457,295.08
24 國開清發 02	200,000	20,561,315.07
24 華泰 Y1	200,000	20,293,716.16
24 國開 14	140,000	14,212,366.30
19 國開 09	60,000	6,283,923.29
保隆轉債	230	28,175.83
歐 22 轉債	10	1,120.17
合計	27,600,240	2,806,173,148.71
(3)資產支持證券投資		
上市投資		
中國(-)		
合計	0	0.00
(4)買入返售金融資產		
銀行間同業市場買入返售金融資產		207,993,078.58
交易所市場買入返售金融資產		
合計		207,993,078.58
總投資資產		9,349,806,507.09
銀行存款和結算備付金		243,593,046.01
其他各項資產		4,817,430.61
合計		9,598,216,983.71

補充披露 2：投資組合變動表

序號	證券類別	佔基金資產淨值的比例 (%)	佔基金資產淨值的比例 (%)
		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
1	股票	66.30	70.95
2	債券	29.36	20.99
3	資產支持證券	-	-
4	買入返售金融資產	2.18	-

華夏基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日