

永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	11
§ 4	管理人报告 .....	11
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	19
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	19
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	20
4.9	管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 .....	20
4.10	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	20
§ 5	托管人报告 .....	20
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	20
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	20
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	20
§ 6	审计报告 .....	20
6.1	审计报告基本信息 .....	20
6.2	审计报告的基本内容 .....	21
§ 7	年度财务报表 .....	22
7.1	资产负债表 .....	22
7.2	利润表 .....	24
7.3	净资产变动表 .....	25
7.4	报表附注 .....	26
§ 8	投资组合报告 .....	55
8.1	期末基金资产组合情况 .....	55
8.2	报告期内按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	56
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
8.8	报告期内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 .....	61
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11	报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12	投资组合报告附注 .....	61
§ 9	基金份额持有人信息 .....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	63
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 63	
§ 10	开放式基金份额变动 .....	64
§ 11	重大事件揭示 .....	64
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	64
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4	基金投资策略的改变 .....	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8	其他重大事件 .....	68
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
12.1	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 .....	69
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
§ 13	备查文件目录 .....	70
13.1	备查文件目录 .....	70
13.2	存放地点 .....	70
13.3	查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金	
基金简称	永赢港股通品质生活慧选混合	
基金主代码	009983	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 09 月 29 日	
基金管理人	永赢基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	951,719,353.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C
下属分级基金的交易代码	009983	021918
报告期末下属分级基金的份额总额	936,099,919.80 份	15,619,433.39 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力争控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资策略包含资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质股票，严选具有较高安全边际和成长潜力较大的股票构建投资组合。
业绩比较基准	恒生指数收益率（经汇率调整后）*65%+中债-综合指数（全价）收益率*20%+沪深 300 指数收益率*15%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。 本基金将投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	永赢基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	汪成杰
	联系电话	021-20430340
	电子邮箱	wangcj@maxwealthfund.com
客户服务电话	400-805-8888	95559
传真	021-51690177	021-62701216
注册地址	浙江省宁波市鄞州区中山东路	中国（上海）自由贸易试验区

	466 号	银城中路 188 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	马宇晖	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	永赢基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	永赢港股通 品质生活慧 选混合 A	永赢港股通 品质生活慧 选混合 C	永赢港股通 品质生活慧 选混合 A	永赢港 股通品 质生活 慧选混 合 C	永赢港股通 品质生活慧 选混合 A	永赢港 股通品 质生活 慧选混 合 C
本期已实现 收益	53,049,609. 16	332,247.86	95,690,044. 20	-	267,363,875 .05	-
本期利润	63,235,988. 84	- 410,903.02	- 173,054,502 .26	-	114,006,249 .08	-
加权平均基 金份额本期 利润	0.0614	-0.0494	-0.1391	-	-0.0840	-
本期加权平 均净值利润 率	9.50%	-7.59%	-20.56%	-	-11.59%	-

本期基金份额净值增长率	9.84%	-2.03%	-18.63%	-	-9.26%	-
3.1.2 期末数据和指标		2024年末		2023年末		2022年末
永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 C
326,908,581 .62	5,496,569. 75	455,205,596 .62	-	415,044,316 .16	-	-
期末可供分配利润	-0.3492	-0.3519	-0.4040	-	-0.3260	-
期末基金资产净值	622,955,590 .14	10,122,863 .64	682,798,615 .04	-	948,067,032 .72	-
期末基金份额净值	0.6655	0.6481	0.6059	-	0.7446	-
3.1.3 累计期末指标		2024年末		2023年末		2022年末
永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C	永赢港股通品质生活慧选混合 C
基金份额累计净值增长率	-33.45%	-2.03%	-39.41%	-	-25.54%	-

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、自 2024 年 07 月 24 日起，永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

永赢港股通品质生活慧选混合 A

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

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-3.91%	1.43%	-1.36%	1.08%	-2.55%	0.35%
过去六个月	-2.97%	1.28%	12.47%	1.08%	-15.44%	0.20%
过去一年	9.84%	1.17%	16.89%	1.05%	-7.05%	0.12%
过去三年	-18.90%	1.35%	-1.91%	1.17%	-16.99%	0.18%
自基金合同生效起至今	-33.45%	1.37%	-4.69%	1.09%	-28.76%	0.28%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金业绩比较基准为：恒生指数收益率（经汇率调整后）\*65%+中债-综合指数（全价）收益率\*20%+沪深 300 指数收益率\*15%。

#### 永赢港股通品质生活慧选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.41%	1.42%	-1.36%	1.08%	-5.05%	0.34%
自基金合同生效起至今	-2.03%	1.28%	13.46%	1.11%	-15.49%	0.17%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金业绩比较基准为：恒生指数收益率（经汇率调整后）\*65%+中债-综合指数（全价）收益率\*20%+沪深 300 指数收益率\*15%。

3、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 C 类份额合同生效日为 2024 年 07 月 24 日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

永贏港股通品質生活慧選混合A累計淨值收益率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

(2020年09月29日-2024年12月31日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

永贏港股通品質生活慧選混合C累計淨值收益率與業績比較基準收益率歷史走勢對比圖

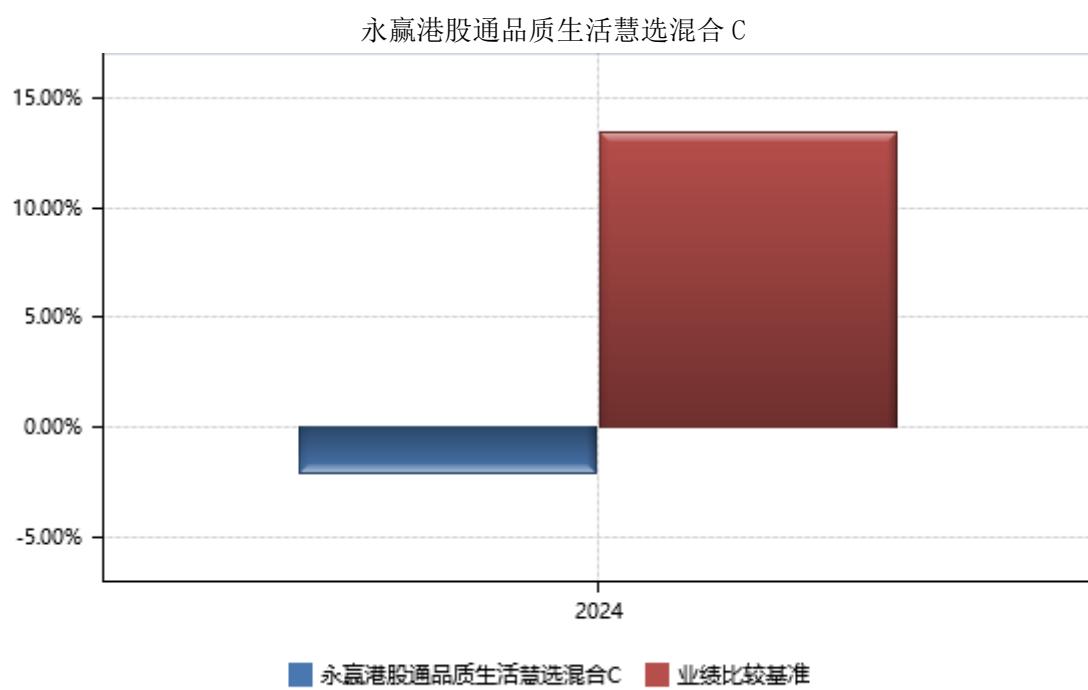
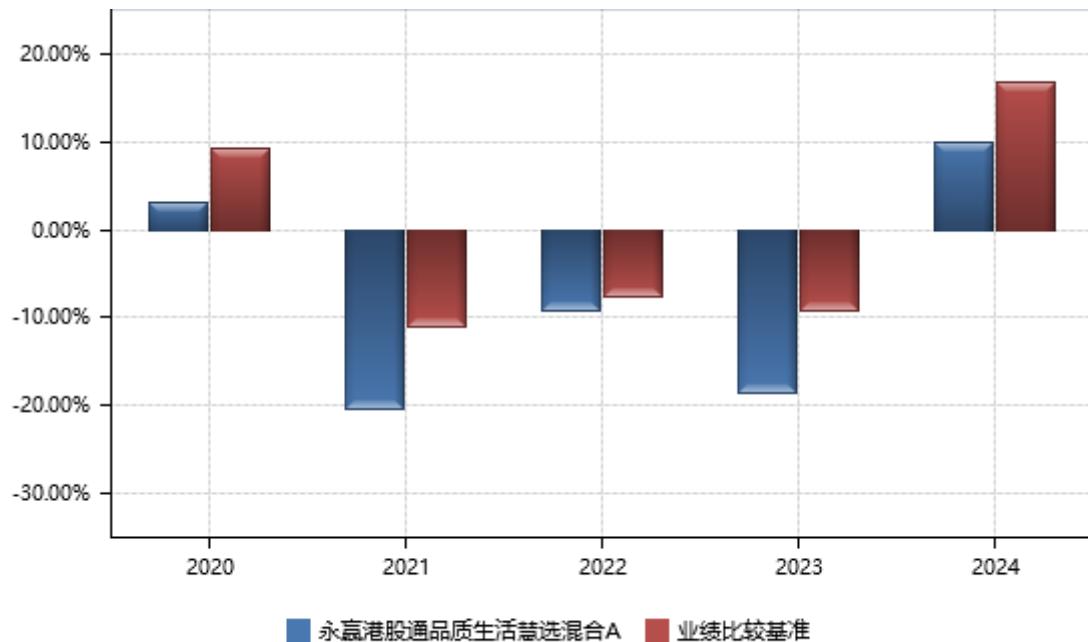
(2024年07月24日-2024年12月31日)



注：本基金自 2024 年 07 月 24 日增设 C 类份额，截至本报告期末，本类基金份额生效未满一年。

### 3.2.3 自基金合同生效基金每年淨值增长率及其與同期業績比較基準收益率的比較

永贏港股通品質生活慧選混合 A



注：1、本基金合同于 2020 年 09 月 29 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、根据《永赢基金管理有限公司关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，本基金自 2024 年 07 月 24 日起增加 C 类基金份额类别，C 类份额自 2024 年 07 月 24 日起存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于 2013 年 10 月 8 日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280 号），随后，公司于 2013 年 10 月 11 日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008 号），并于 2013 年 11 月 7 日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于 2013 年 11 月 12 日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号 A087），并于 2017 年 3 月 14 日获得中国证监会颁发的信用代码为 913302007178854322 的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014 年 8 月 18 日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018 年 1 月 25 日，公司完成增资，注册资本由人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股 71.49%，Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 持股 28.51%。

截止 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中的开放式证券投资基金共计 139 只，即永赢货币市场基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢天天利货币市场基金、永赢永益债券型证券投资基金、永赢丰利债券型证券投资基金、永赢增益债券型证券投资基金、永赢恒益债券型证券投资基金、永赢惠添利灵活配置混合型证券投资基金、永赢普惠债券型证券投资基金、永赢泰益债券型证券投资基金、永赢润益债券型证券投资基金、永赢聚益债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、永赢盛益债券型证券投资基金、永赢嘉益债券型证券投资基金、永赢裕益债券型证券投资基金、永赢祥益债券型证券投资基金、永赢通益债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、永赢诚益债券型证券投资基金、永赢昌益债券型证券投资基金、永赢宏益债券型证券投资基金、永赢伟益债券型证券投资基金、永赢颐利债券型证券投资基金、永赢迅利中高等级短债债券型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢智能领先混合型证券投资基金、永赢泰利债券型证券投资基金、永赢悦利债券型证券投资基金、永赢卓利债券型证券投资基金、永赢凯利债券型证券投资基金、永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式

证券投资基金、永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢众利债券型证券投资基金、永赢同利债券型证券投资基金、永赢昌利债券型证券投资基金、永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金、永赢创业板指指数型发起式证券投资基金、永赢汇利六个月定期开放债券型证券投资基金、永赢淳利债券型证券投资基金、永赢高端制造混合型证券投资基金、永赢久利债券型证券投资基金、永赢乾元三年定期开放混合型证券投资基金、永赢科技驱动混合型证券投资基金、永赢元利债券型证券投资基金、永赢易弘债券型证券投资基金、永赢股息优选混合型证券投资基金、永赢中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、永赢医药健康股票型证券投资基金、永赢邦利债券型证券投资基金、永赢瑞宁 87 个月定期开放债券型证券投资基金、永赢欣益纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫享混合型证券投资基金、永赢鼎利债券型证券投资基金、永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金、永赢成长领航混合型证券投资基金、永赢泰宁 63 个月定期开放债券型证券投资基金、永赢鑫欣混合型证券投资基金、永赢稳健增利 18 个月持有期混合型证券投资基金、永赢鑫盛混合型证券投资基金、永赢宏泽一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、永赢惠添益混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、永赢华嘉信用债债券型证券投资基金、永赢港股通优质成长一年持有期混合型证券投资基金、永赢深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、永赢乾益债券型证券投资基金、永赢鑫辰混合型证券投资基金、永赢中债-3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、永赢长远价值混合型证券投资基金、永赢信利碳中和主题一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢惠添盈一年持有期混合型证券投资基金、永赢中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢轩益债券型证券投资基金、永赢合享混合型发起式证券投资基金、永赢慧盈一年持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、永赢安盈 90 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、永赢稳健增强债券型证券投资基金、永赢添添欣 12 个月持有期混合型证券投资基金、永赢养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、永赢成长远航一年持有期混合型证券投资基金、永赢卓越臻选股票型发起式证券投资基金、永赢新能源智选混合型发起式证券投资基金、永赢坤益债券型证券投资基金、永赢高端装备智选混合型发起式证券投资基金、永赢宏泰短债债券型证券投资基金、永赢添添悦 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢优质生活混合型证券投资基金、永赢安悦 60 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢湖北国有企业债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、永赢半导体产业智选混合型发起式证券投资基金、永赢低碳环保智选混合型发起式证券投资基金、永赢安泰中短债债券型证券投资基金、永赢医药创新智选混合型发起式证券投资

基金、永赢消费鑫选 6 个月持有期混合型证券投资基金、永赢新兴消费智选混合型发起式证券投资基金、永赢消费龙头智选混合型发起式证券投资基金、永赢合嘉一年持有期混合型证券投资基金、永赢季季享 90 天持有期中短债债券型证券投资基金、永赢昭利债券型证券投资基金、永赢恒欣稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、永赢数字经济智选混合型发起式证券投资基金、永赢月月享 30 天持有期短债债券型证券投资基金、永赢先进制造智选混合型发起式证券投资基金、永赢浩益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、永赢匠心增利债券型证券投资基金、永赢启源混合型发起式证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、永赢睿信混合型证券投资基金、永赢中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、永赢腾利债券型证券投资基金、永赢红利慧选混合型发起式证券投资基金、永赢瑞弘 12 个月持有期债券型证券投资基金、永赢璟利债券型证券投资基金、永赢安裕 120 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢悦享债券型证券投资基金、永赢上证科创板 100 指数增强型发起式证券投资基金、永赢启鑫混合型证券投资基金、永赢安怡 30 天持有期债券型证券投资基金、永赢安源 60 天滚动持有债券型证券投资基金、永赢逸享债券型证券投资基金、永赢融安混合型证券投资基金、永赢汇享债券型证券投资基金、永赢科技智选混合型发起式证券投资基金、永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、永赢安泽 6 个月持有期债券型证券投资基金、永赢睿恒混合型证券投资基金、永赢中证 A50 指数增强型发起式证券投资基金、永赢安和 30 天持有期债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
晏青	基金经理兼投资经理	2020 年 09 月 29 日	-	18 年	晏青先生，上海交通大学经济学硕士，18 年证券相关从业经验。曾任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理，上海泓尚资产管理中心（有限合伙）投资经理、海外投资总监。现任永赢基金管理有限公司权益投资部基金经理兼投资经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》及行业协会关于从业人员的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
晏青	公募基金	2	877,727,554.76	2019 年 10 月 16 日
	私募资产管理计划	4	159,536,584.44	2022 年 03 月 11 日
	其他组合	-	-	-
	合计	6	1,037,264,139.20	-

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限；投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预；基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除因业务管理的需要外，不同基金经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。另外，本基金管理人还建立机制要求公募基金经理与资产管理计划投资经理互相隔离，且原则上不能互相授权投资。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各基金经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后分析，确保交易得到公平和公允的执行；对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，基金经理须提出申请并阐明具体原因，交由投资决策委员会进行严格的公平性审核；（4）严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外），确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生同日反向交易的，相关基金经理须向风险控制委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，风险管理部开展定期分析工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了对非公开发行股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，以及对非连续竞价交易的价格公允性进行审查；事后分析评估上，风险管理部在每个季度的公平交易与异常交易稽核中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资授权

管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先、比例分配”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，分别于每季度和每年度对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行分析，每季度对连续四个季度期间内、不同时间窗下不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现显著违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

#### **4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况**

针对兼任基金经理，基金管理人加强投资指令管理，兼任基金经理下达所管理多个产品的同一证券、同日、同向投资指令，原则上应做到“同时同价”，尽量同时发送投资指令；对于因产品策略、头寸变化等原因导致无法“同时同价”的，应经管理人内部审议授权后方可执行交易。基金管理人每日开展兼任产品间的同日及临近交易日同向交易价差分析；每季度对兼任产品间不同时间窗下反向交易和同向交易价差进行监测分析，其中最长时间窗延长至 10 个交易日及以上；并结合投资指令下达时间、价格偏差、产品规模、产品投资策略和投资目标说明、成交量等情况开展进一步分析，独立分析认为合理性不足的，将要求兼任基金经理进行解释说明。报告期内，兼任基金经理所管理的产品严格执行公平交易制度，其管理的多个产品间未发现有显失公平的行为。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2024 年，全球股票市场整体呈现上涨态势，但各地区表现并未呈现出很强的同步性。中国股票市场经历了较大的波动，A 股在不同季度表现各异，上证指数全年上涨 12.67%，深证综指和创业板指分别上涨 6.51% 和 13.23%，市场在波动中逐步修复。港股市场则呈现出大起大落的态势，恒生指数和恒生国企指数全年分别上涨 17.67% 和 26.37%，其涨幅主要集中在季末，显现出政策预期和资金流向对市场的显著影响。美国股票市场呈现出很强的韧性，新兴行业表现抢眼，纳斯达克指数和标普指数全年分别上涨 28.63% 和 23.31%；资金回流日本市场，日经指数全年涨幅达到 19.22%。

A 股市场行业分化显著，银行、非银金融和通信等行业表现领先，这些防御性的低估值资产显著受益于利率下行；而医药生物、农林牧渔和食品饮料等行业表现相对落后，主要受到国内医保政策和行业周期的影响。港股市场中，能源、电信和恒生科技等行业涨幅较大，说明全球需求对大宗商品的支撑力和低估值防御性资产的吸引力；而医疗保健、房地产建筑和必选消费品等行业则跌幅较大，反映出市场对这些行业的短期担忧。在主题投资方面，人工智能、低空经济、机器人等新兴产业逻辑得到了市场广泛认可，相关股票保持较高的热度，成为全年市场的重要亮点。

2024 年，国内宏观经济整体维持较为疲弱的状态。国内制造业 PMI 指数在不同季度波动，四季度终于回到荣枯线之上，在国内政策的积极推动下，经济呈现一定的复苏迹象。然而，内需疲弱的局面未有根本性改善，房地产市场虽有政策刺激的推动，但销售好转的持续性显著不够，需求改善的持续性仍需观察。与此同时，美国经济表现出较好的韧性，通胀水平处于较高水位，降息预期在不同季度之间有所反复，造成市场的阶段性动荡。

资金流向的变化对股票市场产生了重要影响。三季度国内宏观政策出现较大转向，市场的悲观预期得以逆转，A 股和港股阶段性迎来资金流入。然而国内推出的刺激性措施主要目的是防止经济增速过快下滑，防范系统性风险，整体经济增长的动能依然较弱。年末中国相关的风险资产出现回调，海外主动基金继续流出中国资产，显示出市场对全球经济前景的谨慎态度。

2024 年的股票市场波动较大，本基金采取较为谨慎的投资策略，提升行业配置策略的有效性，优化交易策略以防范个股风险。在国内疲弱的经济环境下，特别是在利率不断下行的背景下，低估值价值股和高股息率公司在市场中表现较强，国央企和互联网平台公司通过大比例派息和回购来提升股东回报，进一步凸显其独特的投资价值。本年度基金重点配置了高股息的红利资产，深入挖掘了其中我们认为最具投资价值的企业，确保组合具有较高的抗风险能力。总体上本基金在 2024 年经历了诸多挑战，通过进化投资方法论和加强个股的价值判断，努力在充满挑战的市场环境中把握机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢港股通品质生活慧选混合 A 基金份额净值为 0.6655 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 9.84%，同期业绩比较基准收益率为 16.89%；截至报告期末永赢港股通品质生活慧选混合 C 基金份额净值为 0.6481 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 -2.03%，同期业绩比较基准收益率为 13.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年全球形势仍将复杂多变，各国经济政策的差异和地缘政治的紧张局势将继续对市场产

生深远影响。

国内房地产经过多年的调整，有望在 2025 年迎来企稳。随着一系列宽松政策的推出，房地产市场的供需关系可能逆转。以人工智能为代表的一系列新兴产业正在蓬勃发展，从智能驾驶到医疗健康，从智能制造到机器人，人工智能从技术突破到各个行业落地，正在深刻改变各个行业的生态。这些新兴产业的崛起不仅推动了经济结构的优化，也为中国经济转型成功带来了曙光。

美国经济的韧性可能在 2025 年继续延续，但其面临的挑战也不容忽视。通货膨胀和利率政策的不确定性仍然是影响美股市场的重要因素。尽管美联储可能继续采取灵活的货币政策来应对经济波动，但利率调整的时点和幅度仍存在不确定性。此外，美国国内的政治分歧和贸易政策的不确定性也将对全球经济和市场产生扰动。

尽管存在诸多不确定性，股票市场结构性机会一直存在，中国资产在全球范围内的吸引力有所上升。从风险收益比来看，中国资产在经历了近几年的调整后，估值水平相对较低，具备较高的投资价值。与全球其他主要经济体相比，中国经济的韧性和政策空间为投资者提供了具吸引力的风险收益比。在国内低利率环境中，权益资产在各类资产中的性价比也有所凸显。

本基金将秉持价值投资的理念，聚焦于下列可能带来超额收益的投资机会，精选个股，构建稳健组合。

首先是具有垄断属性和特许经营权的公司。这类公司拥有独特的竞争优势，能够抵御外部竞争压力，保持稳定的盈利能力和自由现金流。公用事业、电信运营商以及具有品牌垄断地位的消费公司，凭借其独特的市场地位和政策保护，能够在经济波动中保持相对稳定的业绩表现。

其次是供给侧改革后的剩者。供给侧改革是中国经济结构调整的重要举措，也是这十年多以来的常态，许多行业经历了产能出清和市场竞争的洗礼，剩者为王的格局逐渐显现。这些在供给侧改革中脱颖而出的公司，具备了更强的安全性和获取超额利润的能力。钢铁、煤炭、水泥、房地产、电解铝等行业，经过产能去化和行业整合，龙头企业进一步提升其市场地位。这些供给侧改革后的剩者，不仅可以分享行业集中度提升带来的红利，还能在经济复苏中获得良好的盈利弹性。

最后是致力于提高股东回报的公司。优秀的公司通常具备良好的治理结构和管理团队，能够通过合理的资本配置和运营策略，提升企业的盈利能力和股东价值。一些公司通过增加派息、股份回购等方式，直接提升股东回报；另一些公司则通过优化资产负债表、降低财务成本、剥离不良资产，提高企业的运营效率和盈利能力。

本基金将努力洞察时代脉搏，致力于寻找最具投资价值的优质企业，分享中国经济转型、产业升级和优秀企业经营所带来的红利，努力为投资者创造长期稳定的回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障合规运作、维护投资者合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，持续健全、完善内控建设，提升风险管理水平，确保基金管理业务规范运作。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作主要包括：

1、持续加强制度建设。公司高度重视内控管理与风险防范工作，坚持制度先行原则，并持续完善制度体系。报告期内，公司根据法律法规、监管政策及业务开展实际情况，对公司制度进行了全面梳理与评估，共新设、修订制度 90 余项，确保制度的合规性、有效性和可操作性，保障各项业务规范开展。

2、扎实推进新规落实。2024 年，公司持续密切关注各项最新法律法规、监管政策，及时开展新规新政的传达和解读，并拟定落实方案，由各相关部门具体落实，同时定期对落实情况进行跟踪检查。

3、积极开展合规培训。为持续提升员工合规意识，不断推进合规文化建设，公司坚持在全员覆盖的基础上有针对性地开展多类合规培训，结合实际需要自行开展或邀请外部律师开展专题培训，并通过组织合规考试、定期宣贯风险案例等多样化的方式强化员工合规意识。

4、深入开展内部审计工作。公司建立了全面的内部审计体系和流程，并设置审计部作为公司风险防控机制中的一道重要防线独立履行内部审计检查职责。2024 年，公司有序开展各类专项审计、离任审查、年度/季度监察稽核项目、即时通讯工具例行检查、风险事件调查等内审工作，并聘请外部机构独立开展年度合规管理有效性评估、年度内部控制评价等项目。针对上述审计检查发现的问题，审计部牵头推进整改，促进制度体系及业务流程不断完善，为公司防范风险、完善内控管理提供有力支持。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。本基金管理人估值委员会成员包括公司总经理、督察长、投资和研究部门的分管领导、基金运营的分管领导、基金运营部负责人、合规部负责人和风险管理部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高

准则。

报告期内，本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务；本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，未发生会计师事务所出具非标准审计报告的情形。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，永赢基金管理有限公司在永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由永赢基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2025) 审字第 70077306_B78 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金不能持续经营。</li> <li>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</li> </ul> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	石静筠 沈熙苑
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产:</b>			
货币资金	7.4.7.1	59,739,525.89	97,073,461.48
结算备付金		1,173,317.22	3,202,361.20
存出保证金		136,779.06	124,750.47
交易性金融资产	7.4.7.2	582,425,830.84	610,792,493.12
其中: 股票投资		569,666,642.79	610,792,493.12
基金投资		—	—
债券投资		12,759,188.05	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收清算款		31,923.50	—
应收股利		131,208.00	—
应收申购款		5,802.67	36,628.20
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		643,644,387.18	711,229,694.47
<b>负债和净资产</b>	附注号	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		8,235,461.75	—
应付清算款		38,966.81	604,752.86
应付赎回款		639,597.24	25,958,730.21
应付管理人报酬		643,964.34	722,946.73
应付托管费		107,327.38	120,491.14
应付销售服务费		5,198.99	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.6	895,416.89	1,024,158.49
负债合计		10,565,933.40	28,431,079.43
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	951,719,353.19	1,126,861,664.33
未分配利润	7.4.7.8	-318,640,899.41	-444,063,049.29
净资产合计		633,078,453.78	682,798,615.04

负债和净资产总计		643,644,387.18	711,229,694.47
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6652 元，基金份额总额 951,719,353.19 份。其中永赢港股通品质生活慧选混合 A 类基金份额净值 0.6655 元，份额总额 936,099,919.80 份；永赢港股通品质生活慧选混合 C 类基金份额净值 0.6481 元，份额总额 15,619,433.39 份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金  
本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01 日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01 日至2023年12月 31日
<b>一、营业收入</b>		72,482,456.99	-159,199,776.44
1. 利息收入		513,440.58	933,234.49
其中：存款利息收入	7.4.7.9	510,776.40	933,234.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,664.18	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		62,476,629.28	-82,881,270.42
其中：股票投资收益	7.4.7.10	39,565,036.16	-100,546,783.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	23,462.29	58,847.17
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-7,243.84
股利收益	7.4.7.15	22,888,130.83	17,613,909.28
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	9,443,228.80	-77,364,458.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	49,158.33	112,717.55
<b>减：二、营业总支出</b>		9,657,371.17	13,854,725.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,025,216.95	11,639,151.02
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,337,536.08	1,939,858.46
3. 销售服务费		13,497.32	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,410.33	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,410.33	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	7. 4. 7. 19	276, 710. 49	275, 716. 34
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		62, 825, 085. 82	-173, 054, 502. 26
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		62, 825, 085. 82	-173, 054, 502. 26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		62, 825, 085. 82	-173, 054, 502. 26

### 7.3 净资产变动表

会计主体：永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 126, 861, 664. 33	-444, 063, 049. 29	682, 798, 615. 04
二、本期期初净资产	1, 126, 861, 664. 33	-444, 063, 049. 29	682, 798, 615. 04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-175, 142, 311. 14	125, 422, 149. 88	-49, 720, 161. 26
(一)、综合收益总额	-	62, 825, 085. 82	62, 825, 085. 82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-175, 142, 311. 14	62, 597, 064. 06	-112, 545, 247. 08
其中：1. 基金申购款	35, 279, 202. 56	-11, 641, 249. 16	23, 637, 953. 40
2. 基金赎回款	-210, 421, 513. 70	74, 238, 313. 22	-136, 183, 200. 48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	951, 719, 353. 19	-318, 640, 899. 41	633, 078, 453. 78
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 273, 262, 223. 78	-325, 195, 191. 06	948, 067, 032. 72
二、本期期初净资产	1, 273, 262, 223. 78	-325, 195, 191. 06	948, 067, 032. 72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-146, 400, 559. 45	-118, 867, 858. 23	-265, 268, 417. 68
(一)、综合收益总额	-	-173, 054, 502. 26	-173, 054, 502. 26
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-146, 400, 559. 45	54, 186, 644. 03	-92, 213, 915. 42
其中：1. 基金申购款	98, 035, 814. 27	-28, 958, 214. 99	69, 077, 599. 28
2. 基金赎回款	-244, 436, 373. 72	83, 144, 859. 02	-161, 291, 514. 70

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,126,861,664.33	-444,063,049.29	682,798,615.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>芦特尔</u> 基金管理人负责人	<u>虞俏依</u> 主管会计工作负责人	<u>曹婷</u> 会计机构负责人
------------------------	-------------------------	----------------------

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1551 号《关于准予永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由永赢基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于 2020 年 9 月 29 日生效，首次设立募集规模为 2,170,666,810.23 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金管理人于 2024 年 7 月 24 日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自 2024 年 7 月 24 日起，对永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于品质生活类证券的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的

5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：恒生指数收益率（经汇率调整后）\*65%+中债-综合指数（全价）收益率\*20%+沪深 300 指数收益率\*15%。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获

得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公

允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够的可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确

认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况对本基金进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后均不能低于面值；
- (4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- (5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告，且不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。  
以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务

等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计

入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	59,739,525.89	97,073,461.48
等于：本金	59,733,595.28	97,055,495.97
加：应计利息	5,930.61	17,965.51
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	59,739,525.89	97,073,461.48

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		532,911,540.76	-	569,666,642.79	36,755,102.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,617,331.99	137,768.05	12,759,188.05	4,088.01
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,617,331.99	137,768.05	12,759,188.05	4,088.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		545,528,872.75	137,768.05	582,425,830.84	36,759,190.04
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		583,476,531.88	-	610,792,493.12	27,315,961.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		583,476,531.88	-	610,792,493.12	27,315,961.24

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	26.95	89,643.30
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	706,089.94	754,515.19
其中：交易所市场	706,089.94	754,515.19
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提费用	189,300.00	180,000.00
合计	895,416.89	1,024,158.49

#### 7.4.7.7 实收基金

永赢港股通品质生活慧选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,126,861,664.33	1,126,861,664.33
本期申购	19,203,039.80	19,203,039.80
本期赎回(以“-”号填列)	-209,964,784.33	-209,964,784.33
本期末	936,099,919.80	936,099,919.80

永赢港股通品质生活慧选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	16,076,162.76	16,076,162.76
本期赎回(以“-”号填列)	-456,729.37	-456,729.37
本期末	15,619,433.39	15,619,433.39

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据基金管理人于 2024 年 07 月 24 日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告》，自 2024 年 07 月 24 日起，对本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

永赢港股通品质生活慧选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-455,205,596.62	11,142,547.33	-444,063,049.29
本期期初	-455,205,596.62	11,142,547.33	-444,063,049.29
本期利润	53,049,609.16	10,186,379.68	63,235,988.84
本期基金份额交易产生的变动数	75,247,405.84	-7,564,675.05	67,682,730.79
其中：基金申购款	-7,661,822.96	1,269,816.11	-6,392,006.85
基金赎回款	82,909,228.80	-8,834,491.16	74,074,737.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-326,908,581.62	13,764,251.96	-313,144,329.66

永赢港股通品质生活慧选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	332,247.86	-743,150.88	-410,903.02
本期基金份额交易产生的变动数	-5,824,048.77	738,382.04	-5,085,666.73
其中：基金申购款	-5,986,231.62	736,989.31	-5,249,242.31
基金赎回款	162,182.85	1,392.73	163,575.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,491,800.91	-4,768.84	-5,496,569.75

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
活期存款利息收入	362,498.46	786,084.63
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	144,114.16	142,201.30
其他	4,163.78	4,948.56
合计	510,776.40	933,234.49

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

#### 7.4.7.10 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	2,617,901,861.20	2,437,524,659.70
减：卖出股票成本总额	2,570,739,905.51	2,529,259,928.44

减：交易费用	7,596,919.53	8,811,514.29
买卖股票差价收入	39,565,036.16	-100,546,783.03

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
债券投资收益—利息收入	23,462.29	50,219.18
债券投资收益—买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	—	8,627.99
债券投资收益—赎回差价收入	—	—
债券投资收益—申购差价收入	—	—
合计	23,462.29	58,847.17

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益—买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	—	5,094,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	—	4,991,372.01
减：应计利息总额	—	94,000.00
减：交易费用	—	—
买卖债券差价收入	—	8,627.99

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	2023年01月01日至2023年12月31日
卖出权证成交总额	-	-7,243.84
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-7,243.84

注：本项包含权证行权产生的差价收入。

#### 7.4.7.14.2 衍生工具收益—其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	22,888,130.83	17,613,909.28
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	22,888,130.83	17,613,909.28

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,443,228.80	-77,364,458.06
--股票投资	9,439,140.79	-77,365,330.07
--债券投资	4,088.01	872.01
--资产支持证券投资	-	-
--贵金属投资	-	-
--其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
--权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	9,443,228.80	-77,364,458.06

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
基金赎回费收入	46,479.02	111,234.20
基金转换费收入	2,679.31	1,483.35
合计	49,158.33	112,717.55

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	5,490.36	5,309.67
账户维护费	45,000.00	36,000.00
证券组合费	44,720.13	53,206.67
其他	1,500.00	1,200.00
合计	276,710.49	275,716.34

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
Oversea-Chinese Banking Corporation Limited（“Oversea-Chinese Banking”）	基金管理人的股东
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司
永赢国际资产管理有限公司（“永赢国	基金管理人的子公司

际” )	
------	--

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,025,216.95	11,639,151.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,265,865.76	4,593,316.87
应支付基金管理人的净管理费	4,759,351.19	7,045,834.15

注：2023年07月24日前，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。自2023

年07月24日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
	2024年01月01日至2024年 12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,337,536.08	1,939,858.46

注：2023年07月24日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。自2023年07月24日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	永赢港股通品 质生活慧选混 合 A	永赢港股通品 质生活慧选混 合 C	合计
永赢基金	-	0.71	0.71
合计	-	0.71	0.71

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.60%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的

## 情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期内及上年度末均未投资本基金。

### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31 日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	59,739,525.89	362,498.46	97,073,461.48	786,084.63

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末 2024 年 12 月 31 日本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,235,461.75 元，于 2025 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人视风险管理为规范经营的重点，建立以五道防线为框架的风险控制组织体系。五道防线分别为员工自律及业务部门的自控和互控的第一道防线，合规风控部门监督管理的第二道防线，审计部事后检查的第三道防线，公司风险控制委员会监督管理的第四道防线，董事会及其下设的审计及风险管理委员会对公司风险控制监督管理的第五道防线。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,759,188.05	-
合计	12,759,188.05	-

注：1、国债、政策性金融债以及仅有长期债券评级的1年期及以内信用债券列示为未评级；

2、上年度末，本基金未持有短期债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有短期同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金均未持有长期同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金可以投资于固定收益品种，且持有银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月 31日	1个月以内	1-3个 月	3个月-1年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	59,739,525.89	-	-	-	-	-	59,739,525.89
结算备付金	1,173,317.22	-	-	-	-	-	1,173,317.22
存出保证金	136,779.06	-	-	-	-	-	136,779.06
交易性金融资 产			12,759,188.0 5			569,666,642.7 9	582,425,830.8 4
衍生金融资产			-	-	-	-	-
买入返售金融 资产			-	-	-	-	-
应收清算款		-	-	-	-	31,923.50	31,923.50
应收股利		-	-	-	-	131,208.00	131,208.00
应收申购款		-	-	-	-	5,802.67	5,802.67
递延所得税资 产			-	-	-	-	-
其他资产		-	-	-	-	-	-
资产总计	61,049,622.17		12,759,188.0 5			569,835,576.9 6	643,644,387.1 8
负债							
短期借款		-	-	-	-	-	-
交易性金融负 债			-	-	-	-	-
衍生金融负债		-	-	-	-	-	-
卖出回购金融 资产款	8,235,461.75		-	-	-	-	8,235,461.75
应付清算款		-	-	-	-	38,966.81	38,966.81
应付赎回款		-	-	-	-	639,597.24	639,597.24
应付管理人报 酬		-	-	-	-	643,964.34	643,964.34

应付托管费						107,327.38	107,327.38
应付销售服务费						5,198.99	5,198.99
应付投资顾问费							
应交税费							
应付利润							
递延所得税负债							
其他负债						895,416.89	895,416.89
负债总计	8,235,461.75					2,330,471.65	10,565,933.40
利率敏感度缺口	52,814,160.42		12,759,188.05			567,505,105.31	633,078,453.78
上年度末 2023年12月 31日	1个月以内	1-3个 月	3个月-1年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	97,073,461.48						97,073,461.48
结算备付金	3,202,361.20						3,202,361.20
存出保证金	124,750.47						124,750.47
交易性金融资产						610,792,493.12	610,792,493.12
衍生金融资产							
买入返售金融资产							
应收清算款							
应收股利							
应收申购款						36,628.20	36,628.20
递延所得税资产							
其他资产							
资产总计	100,400,573.15					610,829,121.32	711,229,694.47
负债							
短期借款							
交易性金融负债							
衍生金融负债							
卖出回购金融资产款							
应付清算款						604,752.86	604,752.86
应付赎回款						25,958,730.21	25,958,730.21
应付管理人报						722,946.73	722,946.73

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	120,491.14	120,491.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,024,158.49	1,024,158.49
负债总计	-	-	-	-	-	28,431,079.43	28,431,079.43
利率敏感度缺口	100,400,573.15					582,398,041.89	682,798,615.04

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率曲线向上、向下平行移动 50 个基点 2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
			本期末（2024 年 12 月 31 日） 上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率平行上升 50 个基点		-19,897.95 -
市场利率平行下降 50 个基点		19,897.95	-

注：上年度末，本基金未持有债券，无重大利率风险。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

货币资金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	569,666,642.79	-	569,666,642.79
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	131,208.00	-	131,208.00
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	569,797,850.79	-	569,797,850.79
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	569,797,850.79	-	569,797,850.79
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	535,034,030.65	-	535,034,030.65
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	535,034,030.65	-	535,034,030.65
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	535,034,030.65	-	535,034,030.65

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	所有外币相对人民币升值	28,489,892.54	26,751,701.53

	5%		
	所有外币相对人民币贬值 5%	-28,489,892.54	-26,751,701.53

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	569,666,642.79	89.98	610,792,493.12	89.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	569,666,642.79	89.98	610,792,493.12	89.45

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动		对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
	本期末(2024年12月31日)		上年度末(2023年12月31日)
	业绩比较基准增加1%	5,490,537.57	6,632,116.98
	业绩比较基准减少1%	-5,490,537.57	-6,632,116.98

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
	2024年12月31日	2023年12月31日
第一层次	569,666,642.79	610,741,774.65
第二层次	12,759,188.05	-
第三层次	-	50,718.47
合计	582,425,830.84	610,792,493.12

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		合计
	交易性金融资产		
期初余额	-	50,718.47	50,718.47
当期购买	-	6,521.56	6,521.56
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	50,404.64	50,404.64
当期利得或损失总额	-	-6,835.39	-6,835.39
其中：计入损益的利得或损失	-	-6,835.39	-6,835.39
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
交易性金融资产		合计	
债券投资		股票投资	
期初余额	-	498,937.01	498,937.01
当期购买	-	245,838.96	245,838.96
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	809,901.75	809,901.75
当期利得或损失总额	-	115,844.25	115,844.25
其中：计入损益的利得或损失	-	115,844.25	115,844.25
期末余额	-	50,718.47	50,718.47
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	16,839.68	16,839.68

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	50,718.47	平均价格亚洲期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.5576-2.1775	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 03 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

### § 8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	569,666,642.79	88.51
	其中：股票	569,666,642.79	88.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,759,188.05	1.98
	其中：债券	12,759,188.05	1.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,912,843.11	9.46
8	其他各项资产	305,713.23	0.05
9	合计	643,644,387.18	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 569,666,642.79 元，占期末净值比例 89.98%。

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	81,233,062.23	12.83
原材料	—	—
工业	34,413,952.23	5.44
非日常生活消费品	63,040,654.54	9.96
日常消费品	—	—
医疗保健	—	—
金融	213,457,879.03	33.72
信息技术	18,724,973.30	2.96
通讯业务	144,404,140.25	22.81
公用事业	14,391,981.21	2.27
房地产	—	—
合计	569,666,642.79	89.98

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	156,900	60,588,296.89	9.57
2	00941	中国移动	637,500	45,220,848.30	7.14
3	00728	中国电信	8,558,000	38,594,995.06	6.10
4	01288	农业银行	7,753,000	31,805,575.37	5.02
5	00883	中国海洋石油	1,627,000	28,807,474.57	4.55
6	00857	中国石油股份	4,726,000	26,740,201.39	4.22
7	01088	中国神华	825,500	25,685,386.27	4.06
8	02601	中国太保	1,096,800	25,595,152.93	4.04
9	01398	工商银行	5,289,000	25,517,671.17	4.03
10	00939	建设银行	4,240,000	25,443,134.21	4.02
11	00388	香港交易所	81,400	22,221,922.59	3.51
12	01339	中国人民保险集团	6,187,000	22,172,814.69	3.50
13	00038	第一拖拉机股份	3,278,000	21,795,314.48	3.44
14	09988	阿里巴巴-W	250,400	19,106,946.28	3.02
15	00489	东风集团股份	5,472,000	18,850,322.07	2.98
16	00992	联想集团	2,006,000	18,724,973.30	2.96
17	03618	重庆农村商业银行	2,984,000	12,849,360.62	2.03
18	02328	中国财险	1,130,000	12,829,172.95	2.03
19	06881	中国银河	1,952,500	12,819,380.08	2.02
20	06030	中信证券	642,000	12,692,952.47	2.00

21	09987	百胜中国	35,700	12,370,912.80	1.95
22	06886	HTSC	782,800	9,510,741.95	1.50
23	01193	华润燃气	276,300	7,867,844.20	1.24
24	01816	中广核电力	2,472,000	6,524,137.01	1.03
25	09896	名创优品	149,200	6,500,671.15	1.03
26	01308	海丰国际	333,000	6,383,286.32	1.01
27	00316	东方海外国际	58,500	6,235,351.43	0.98
28	01114	BRILLIANCE CHI	1,756,000	6,211,802.24	0.98

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00388	香港交易所	94,392,614.52	13.82
2	00857	中国石油股份	80,845,500.65	11.84
3	00941	中国移动	80,386,502.89	11.77
4	00939	建设银行	66,581,203.96	9.75
5	09988	阿里巴巴-W	56,053,928.11	8.21
6	00700	腾讯控股	54,293,719.98	7.95
7	00883	中国海洋石油	54,004,258.17	7.91
8	09896	名创优品	53,998,581.32	7.91
9	01816	中广核电力	53,665,460.07	7.86
10	00175	吉利汽车	51,526,473.40	7.55
11	00728	中国电信	46,325,876.17	6.78
12	01109	华润置地	43,127,053.72	6.32
13	01398	工商银行	43,112,764.42	6.31
14	03968	招商银行	40,649,307.59	5.95
15	03898	时代电气	35,043,172.71	5.13
16	00257	光大环境	34,059,822.82	4.99
17	00992	联想集团	34,027,420.95	4.98
18	02607	上海医药	32,671,679.30	4.78
19	01288	农业银行	31,867,378.57	4.67
20	603198	迎驾贡酒	30,962,924.00	4.53
21	600559	老白干酒	30,562,476.05	4.48
22	01898	中煤能源	29,359,143.04	4.30
23	00386	中国石油化工股份	28,867,608.02	4.23
24	600900	长江电力	28,718,751.06	4.21
25	00688	中国海外发展	28,538,024.11	4.18

26	000550	江铃汽车	27,811,925.06	4.07
27	01766	中国中车	26,879,172.05	3.94
28	00576	浙江沪杭甬	26,543,851.28	3.89
29	02601	中国太保	25,701,667.72	3.76
30	00038	第一拖拉机股份	24,929,732.31	3.65
31	00371	北控水务集团	24,878,426.30	3.64
32	600197	伊力特	24,430,105.00	3.58
33	06030	中信证券	24,239,793.61	3.55
34	300783	三只松鼠	23,755,998.00	3.48
35	01088	中国神华	22,947,520.72	3.36
36	01339	中国人民保险集团	22,539,668.93	3.30
37	002293	罗莱生活	21,872,583.20	3.20
38	06886	HTSC	21,661,220.23	3.17
39	00489	东风集团股份	21,599,061.05	3.16
40	06881	中国银河	21,018,272.19	3.08
41	000625	长安汽车	20,847,908.58	3.05
42	03690	美团-W	20,289,139.67	2.97
43	02628	中国人寿	19,951,944.14	2.92
44	00867	康哲药业	18,974,420.63	2.78
45	00384	中国燃气	18,914,448.14	2.77
46	01929	周大福	18,776,470.17	2.75
47	01193	华润燃气	18,597,992.56	2.72
48	00960	龙湖集团	18,214,325.34	2.67
49	01336	新华保险	16,919,565.43	2.48
50	09626	哔哩哔哩-W	15,786,677.87	2.31
51	688256	寒武纪	15,710,258.64	2.30
52	603919	金徽酒	15,445,837.00	2.26
53	00123	越秀地产	15,286,874.94	2.24
54	603365	水星家纺	14,900,533.00	2.18
55	01024	快手-W	14,859,704.44	2.18
56	000425	徐工机械	14,660,869.00	2.15
57	02883	中海油田服务	14,460,533.46	2.12
58	01177	中国生物制药	14,396,234.63	2.11
59	03900	绿城中国	13,783,221.86	2.02
60	000858	五粮液	13,756,236.89	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00388	香港交易所	95,012,712.62	13.92
2	00941	中国移动	79,473,531.49	11.64
3	00857	中国石油股份	74,485,660.30	10.91
4	09896	名创优品	72,369,601.75	10.60
5	00175	吉利汽车	62,968,626.22	9.22
6	00883	中国海洋石油	56,050,624.55	8.21
7	00728	中国电信	54,839,281.07	8.03
8	01816	中广核电力	53,872,588.62	7.89
9	01109	华润置地	41,210,306.73	6.04
10	00135	昆仑能源	39,492,799.67	5.78
11	03898	时代电气	38,754,663.78	5.68
12	00939	建设银行	38,280,319.15	5.61
13	03968	招商银行	38,145,304.87	5.59
14	00257	光大环境	36,063,245.80	5.28
15	01797	东方甄选	34,650,713.23	5.07
16	01088	中国神华	34,284,117.28	5.02
17	600938	中国海油	33,838,097.00	4.96
18	09988	阿里巴巴-W	33,143,841.12	4.85
19	600559	老白干酒	33,088,482.00	4.85
20	00386	中国石油化工股份	31,218,792.01	4.57
21	02607	上海医药	30,796,023.17	4.51
22	601857	中国石油	30,483,019.00	4.46
23	01898	中煤能源	29,056,091.71	4.26
24	000550	江铃汽车	28,886,528.96	4.23
25	603198	迎驾贡酒	28,847,008.00	4.22
26	600150	中国船舶	28,720,017.00	4.21
27	600900	长江电力	28,659,991.00	4.20
28	01164	中广核矿业	28,037,038.28	4.11
29	00371	北控水务集团	27,649,719.37	4.05
30	300783	三只松鼠	27,628,324.41	4.05
31	09633	农夫山泉	27,493,984.83	4.03
32	01766	中国中车	26,939,535.11	3.95
33	002345	潮宏基	26,721,728.00	3.91
34	00992	联想集团	26,635,717.94	3.90
35	00995	安徽皖通高速公路	26,182,389.64	3.83
36	00688	中国海外发展	25,938,601.18	3.80
37	02018	瑞声科技	25,768,076.97	3.77
38	00576	浙江沪杭甬	25,601,547.10	3.75

39	03668	兖煤澳大利亚	24,479,661.44	3.59
40	600197	伊力特	24,340,171.00	3.56
41	00038	第一拖拉机股份	22,913,476.87	3.36
42	01415	高伟电子	21,784,668.79	3.19
43	000625	长安汽车	21,298,746.20	3.12
44	03690	美团-W	21,099,565.63	3.09
45	002293	罗莱生活	20,919,373.23	3.06
46	00867	康哲药业	20,745,311.29	3.04
47	01929	周大福	19,584,354.93	2.87
48	01177	中国生物制药	18,932,631.85	2.77
49	02628	中国人寿	18,812,136.96	2.76
50	09626	哔哩哔哩-W	17,577,586.64	2.57
51	00960	龙湖集团	17,489,383.15	2.56
52	01398	工商银行	16,707,556.90	2.45
53	00384	中国燃气	16,706,054.84	2.45
54	688256	寒武纪	16,498,926.63	2.42
55	06855	亚盛医药-B	16,087,641.34	2.36
56	01024	快手-W	15,681,060.88	2.30
57	603919	金徽酒	15,612,580.40	2.29
58	01336	新华保险	15,574,293.04	2.28
59	01896	猫眼娱乐	15,525,954.67	2.27
60	603365	水星家纺	15,232,761.00	2.23
61	000425	徐工机械	15,064,055.00	2.21
62	09956	安能物流	14,500,335.54	2.12
63	00788	中国铁塔(新)	13,921,476.91	2.04
64	000858	五粮液	13,685,620.00	2.00

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,520,174,914.39
卖出股票收入（成交）总额	2,617,901,861.20

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,759,188.05	2.02

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,759,188.05	2.02

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	126,000	12,759,188.05	2.02

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前

## 一年内受到公开谴责、处罚说明

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	136,779.06
2	应收清算款	31,923.50
3	应收股利	131,208.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,802.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,713.23

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
永赢港股通品质生	29,720	31,497.31	9,498,785.91	1.0147%	926,601,133.89	98.9853%

活慧选混合 A						
永赢港股通品质生活慧选混合 C	32	488,107.29	15,492,600.32	99.1880%	126,833.07	0.8120%
合计	29,752	31,988.42	24,991,386.23	2.6259%	926,727,966.96	97.3741%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	永赢港股通品质生活慧选混合 A	3,799,304.86	0.41%
	永赢港股通品质生活慧选混合 C	171.37	0.00%
	合计	3,799,476.23	0.40%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	永赢港股通品质生活慧选混合 A	10~50
	永赢港股通品质生活慧选混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	永赢港股通品质生活慧选混合 A	>100
	永赢港股通品质生活慧选混合 C	0
	合计	>100

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万份)
晏青	公募基金	>100

	私募资产管理计划	0
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	永赢港股通品质生活慧选混合 A	永赢港股通品质生活慧选混合 C
基金合同生效日（2020 年 09 月 29 日）基金份额总额	2,170,666,810.23	-
本报告期期初基金份额总额	1,126,861,664.33	-
本报告期基金总申购份额	19,203,039.80	16,076,162.76
减：本报告期基金总赎回份额	209,964,784.33	456,729.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	936,099,919.80	15,619,433.39

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经永赢基金管理有限公司董事会审议通过，聘任虞俏依女士担任公司总经理助理职务，郑凌云先生不再担任公司总经理助理职务。本基金管理人已于 2024 年 4 月 19 日在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为 60,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
财通证券	2	35,394,388.00	0.69%	26,195.82	0.98%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	268,092,084.76	5.22%	139,549.71	5.22%	-
东北证券	2	18,039,708.00	0.35%	13,351.76	0.50%	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	1,602,105,636.26	31.18%	881,845.28	32.98%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	6,551,884.00	0.13%	4,838.37	0.18%	-
广发证券	2	811,963,867.12	15.80%	359,286.31	13.44%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	538,907,673.91	10.49%	215,150.22	8.05%	-
国盛证券	2	347,138,272.69	6.76%	142,291.79	5.32%	-
国泰君安 证券	2	109,536,960.92	2.13%	79,941.92	2.99%	-
国投证券	2	292,229,471.35	5.69%	109,805.44	4.11%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	193,016,362.73	3.76%	131,158.55	4.91%	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-

华安证券	2	-	-	-	-
华创证券	2	536,080,942.53	10.43%	327,051.00	12.23%
华西证券	2	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-
天风证券	2	25,879,902.78	0.50%	11,960.19	0.45%
西部证券	2	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-
兴业证券	2	3,413,723.00	0.07%	2,512.11	0.09%
中国银河证券	2	257,613,451.52	5.01%	182,115.46	6.81%
中金公司	2	-	-	-	-
中泰证券	2	88,625,110.85	1.72%	44,559.40	1.67%
中信建投证券	2	3,422,464.73	0.07%	2,305.90	0.09%
中信证券	2	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2、基金交易单元的选择程序如下：(1)本基金管理人根据证券公司选择标准进行评估并确定选用的证券公司。(2)本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

3、本基金本报告期内退租宏信证券交易席位1个、退租申港证券交易席位1个、退租天风证券交易席位1个、退租中信建投证券交易席位1个、退租中信证券交易席位2个。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致。本公司将按规定在网站披露《永赢基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》，报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	6,710,138.0 0	53.18%	33,826,000. 00	28.18%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,802,296.0 0	22.21%	4,754,000.0 0	3.96%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	3,104,897.9 9	24.61%	15,157,000. 00	12.63%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	66,307,000. 00	55.24%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 01 月 08 日
2	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 01 月 19 日
3	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 03 月 27 日
4	永赢基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 03 月 28 日
5	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2024 年 04 月 11 日
6	永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024 年 04 月 19 日
7	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 04 月 20 日
8	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2024 年 06 月 26 日
9	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新(2024 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 06 月 27 日
10	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 18 日
11	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金(A 份额)基金产品资料概要更新(2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24 日
12	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24

	资基金（C 份额）基金产品资料概要更新(2024 年第 1 号)		日
13	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24 日
14	永赢基金管理有限公司关于永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24 日
15	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24 日
16	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024 年 07 月 24 日
17	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定媒介	2024 年 08 月 29 日
18	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 03 日
19	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 10 日
20	永赢基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的声明	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 18 日
21	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 24 日
22	永赢基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票及相关风险提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 11 月 30 日
23	永赢基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年末及 2025 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 28 日
24	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新(2024 年第 3 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 28 日
25	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新(2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 28 日
26	永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金更新招募说明书(2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本基金报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金注册的文件;
2. 《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金托管协议》;
4. 《永赢港股通品质生活慧选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新(如有);
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号二十一世纪大厦 21、22、23、27 层

### 13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询

网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)

如有疑问，可以向本基金管理人永赢基金管理有限公司咨询。

客户服务电话：400-805-8888

永赢基金管理有限公司

2025 年 03 月 28 日