

# 华安幸福生活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：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

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

基金托管人中国建设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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	15
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	15
<b>§ 6 审计报告</b>	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末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 .....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	65
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 .....	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>75</b>
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 .....	75
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安幸福生活混合型证券投资基金	
基金简称	华安幸福生活混合	
基金主代码	005136	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 10 月 26 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	319,927,537.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C
下属分级基金的交易代码	005136	014990
报告期末下属分级基金的份额总额	319,241,009.23 份	686,528.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、权证投资策略 6、股指期货投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率+20%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云
	联系电话	021-38969999
	电子邮箱	service@huaan.com.cn
客户服务电话	4008850099	021-60637228
传真	021-68863414	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼	北京市西城区金融大街 25 号

	2118 室	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层

## § 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		2022 年 5 月 10 日 (基金合同生效日) - 2022 年 12 月 31 日
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	
本期已实现收益	19,767,998.53	276,916.35	-	131,117,175.85	-	122,359.61	-
本期利润	24,661,129.23	-	-	114,772,165.86	-	118,153.39	-
加权平均基金份额本期利润	0.0691	-0.3974	-0.2915	-0.2922	-	-1.7559	-0.4437

本期加权平均净值利润率	3. 63%	-20. 80%	-14. 33%	-14. 37%	-67. 99%	-17. 44%
本期基金份额净值增长率	4. 41%	3. 80%	-14. 86%	-15. 37%	-37. 33%	-2. 07%
3. 1. 2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	185, 835, 520. 61	378, 560. 99	192, 403, 356. 16	177, 751. 05	396, 472, 091. 42	364, 748. 18
期末可供分配基金份额利润	0. 5821	0. 5514	0. 5261	0. 5074	0. 8684	0. 8589
期末基金资产净值	593, 519, 426. 64	1, 256, 151. 58	651, 218, 614. 41	617, 596. 28	954, 825, 664. 89	884, 568. 58
期末基金份额净值	1. 8592	1. 8297	1. 7806	1. 7628	2. 0914	2. 0829
3. 1. 3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	85. 92%	-13. 98%	78. 06%	-17. 12%	109. 14%	-2. 07%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金 2022 年 05 月 10 日起新增 C 类基金份额。

### 3. 2 基金净值表现

#### 3. 2. 1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安幸福生活混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	-9.35%	1.81%	-0.71%	1.42%	-8.64%	0.39%
过去六个月	-6.14%	1.69%	12.11%	1.37%	-	0.32%
过去一年	4.41%	1.52%	11.17%	1.14%	-6.76%	0.38%
过去三年	-44.29%	1.47%	-15.12%	0.96%	-	0.51%
过去五年	42.64%	1.55%	2.45%	0.98%	40.19%	0.57%
自基金合同生效起至今	85.92%	1.46%	1.27%	0.99%	84.65%	0.47%

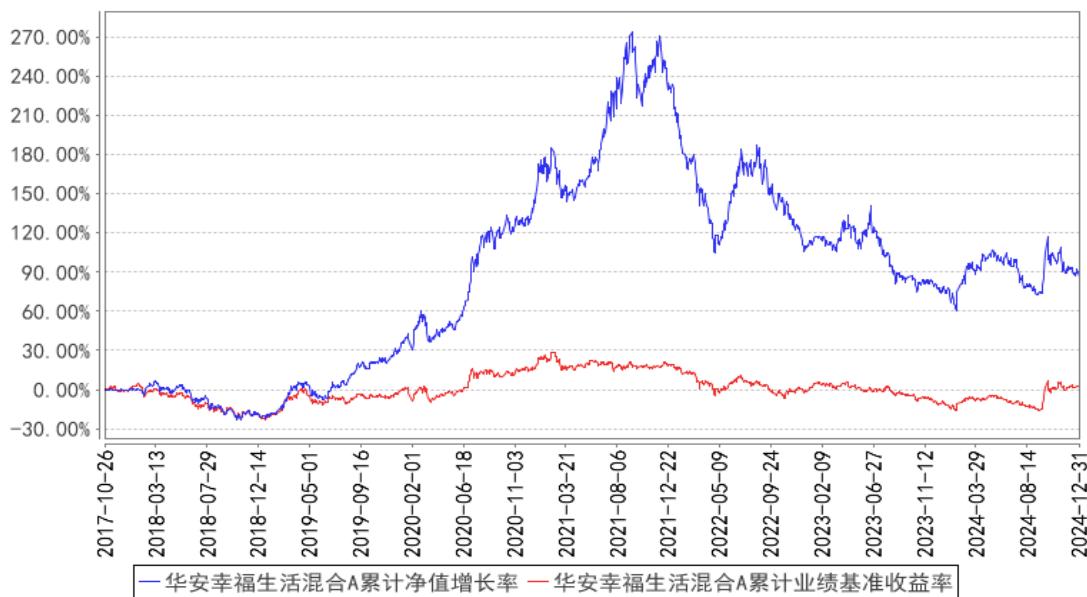
## 华安幸福生活混合 C

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	-9.49%	1.81%	-0.71%	1.42%	-8.78%	0.39%
过去六个月	-6.44%	1.69%	12.11%	1.37%	-	0.32%
过去一年	3.80%	1.52%	11.17%	1.14%	-7.37%	0.38%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-13.98%	1.43%	2.39%	0.91%	-	0.52%
					16.37%	

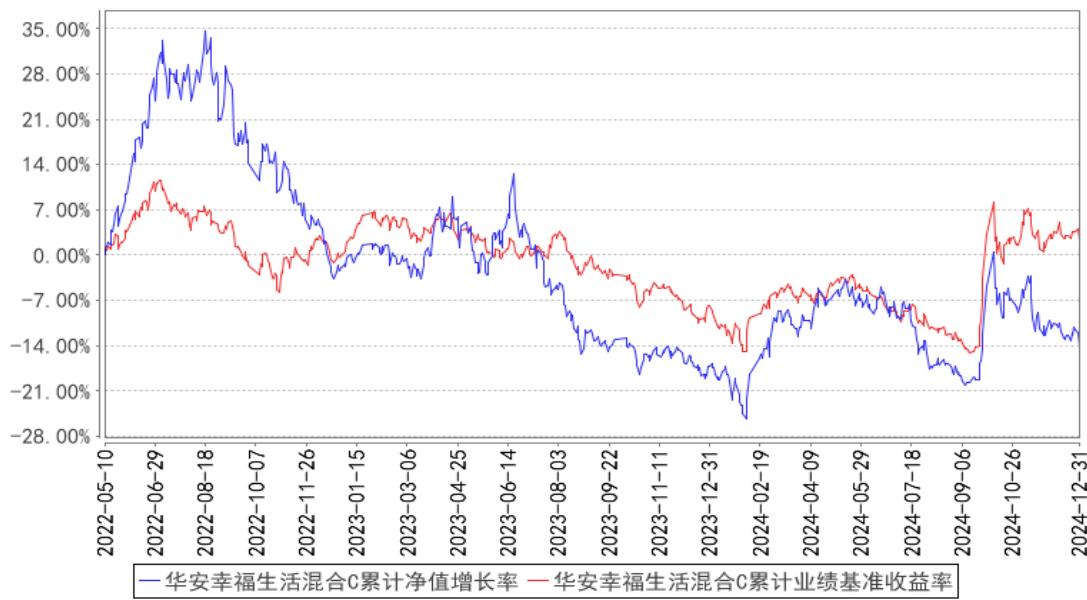
注：本基金 2022 年 05 月 10 日起新增 C 类基金份额。

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

华安幸福生活混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

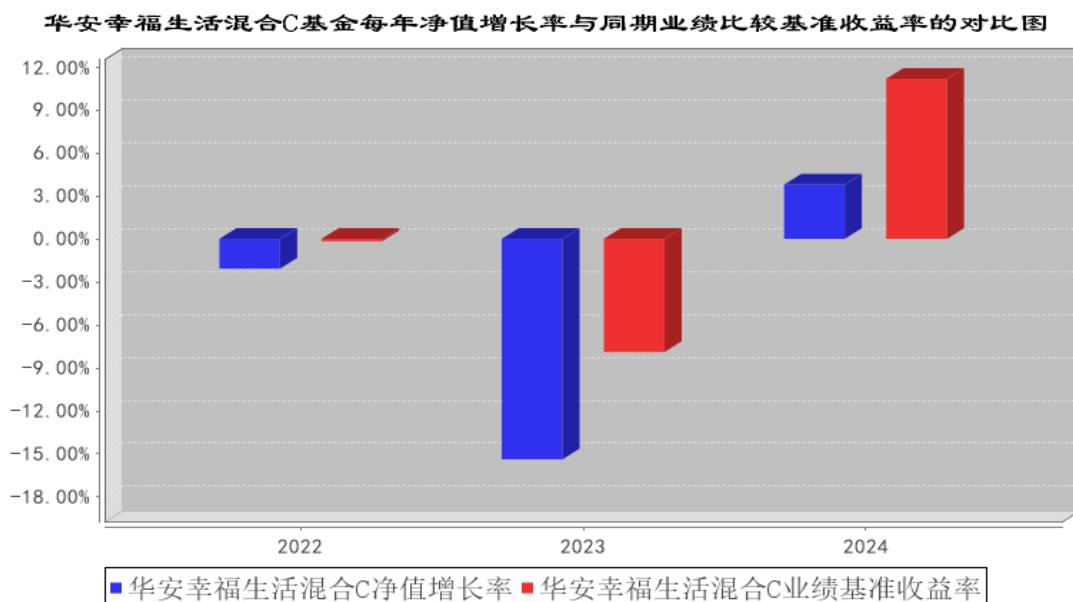
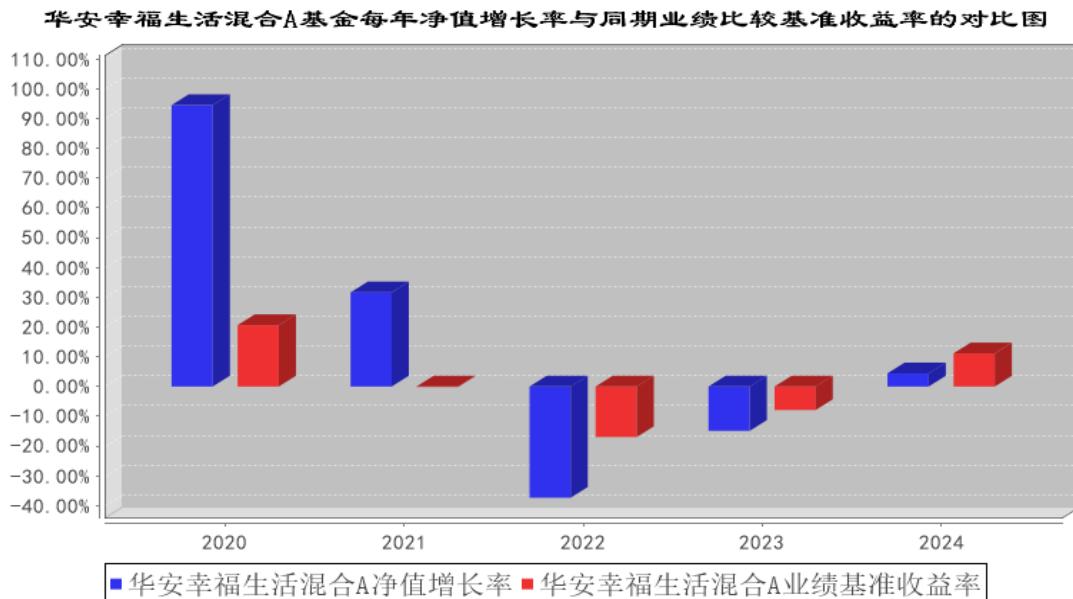


华安幸福生活混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：华安幸福生活混合型证券投资基金自 2022 年 05 月 10 日起新增 C 类基金份额。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是

国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 275 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,931.69 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔涛	本基金的 基金经理	2021 年 1 月 11 日	-	12 年	硕士研究生，12 年基金行业从业经验，曾任国海富兰克林基金管理有限公司研究员、汇添富基金管理股份有限公司行业分析师。2017 年 12 月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2021 年 1 月起担任华安幸福生活混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起，同时担任华安动力领航混合型证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风

格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

#### 4.4 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，市场先抑后扬，尤其是从三季度末开始大幅上涨，主要源于政策出现反转，货币政策、财政政策有望双宽松，资金大幅入市，流动性拐点显现。本基金在 2024 年的配置主要集中于

出海、海外算力、高股息等方向。出海主要以自下而上寻找产业周期向上同时企业竞争力提升的标的。海外算力主要受益于英伟达等企业的持续放量。高股息板块是国债收益率持续下行背景下的绝对收益选择。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.8592 元，C 类份额净值为 1.8297 元，本报告期 A 类份额净值增长率为 4.41%，同期业绩比较基准增长率为 11.17%，C 类份额净值增长率为 3.80%，同期业绩比较基准增长率为 11.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，市场出现了一些积极变化。从流动性角度，增量资金明显入市，成交量有望维持较高水平，市场整体估值水平有进一步提升空间。国内宏观经济逐步向好，尤其是房地产销售平稳，二手房成交价格止跌回稳，通缩环境有望得以缓解。

从行业角度看，今年变化最大的方向集中在国产 AI、人形机器人、智能驾驶等领域。随着 Deepseek 全新模型的推出，其下载量和活跃用户数快速增长，使得国内低成本部署推理模型成为现实，从而带动云计算、AIDC、国产芯片、服务器等一系列需求爆发式增长。人形机器人是未来三年增长最快的行业之一，特斯拉的马斯克宣布其人形机器人将从几千台产量提高到近百万台产量，拉动整个产业链的快速增长。而国内机器人公司进步迅速，产业链投资机会同样值得关注。智能驾驶方面，随着比亚迪宣布其大规模配置高阶智能驾驶功能，国内高阶智能驾驶渗透率有望迎来突变式拐点，其相关硬件最为受益。除此以外，我们依然看好制造业出海的投资机会，对此板块进行了精选，主要配置了下游需求周期向上的个股。我们将积极关注各个行业出现的新变化，在板块均衡配置的基础上，选择风险收益比合适的标的进行重点布局。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合法合规运作出发，持续加强合规风控与内审稽核工作。

公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理体系建设，稳步夯实投资风险管理基础。坚持全流程合规与风险管控，借助系统平台贯彻落实法律法规、基金合同和内控制度的各项要求，实现事前、事中、事后全方位监控、提示及跟踪，并进一步加强对公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等的监控。通过持续完善风险管理制度建设，提升对流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

公司定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各

业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平有效提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以风险控制为核心，不断提高合规与风险管理水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、绝对收益投资部负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本托管人复核审查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。

# § 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	德师报(审)字(25)第 P00761 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	华安幸福生活混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华安幸福生活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，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华安幸福生活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，我们独立于华安幸福生活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>华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华安幸福生活混合型证券投资基金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</p>

	<p>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。</p> <p>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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估华安幸福生活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，除非基金管理人管理层计划清算华安幸福生活混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华安幸福生活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> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价基金管理人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。</p> <p>(4) 对基金管理人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，就可能导致对华安幸福生活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</p>

	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华安幸福生活混合型证券投资基金不能持续经营。
	(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。 我们与基金管理人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。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	汪芳 冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安幸福生活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	78,505,608.59	67,374,812.93
结算备付金		2,740,603.28	1,808,435.78
存出保证金		286,107.37	302,807.32
交易性金融资产	7.4.7.2	507,029,434.33	586,387,905.38
其中：股票投资		507,029,434.33	586,005,177.70
基金投资		—	—
债券投资		—	382,727.68
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	—	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		14,056,410.35	2,519,395.90
应收股利		—	—

应收申购款		36,622.50	92,564.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		602,654,786.42	658,485,921.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<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		-	-
应付清算款		3,884,765.16	1,487,809.02
应付赎回款		1,657,423.93	796,229.36
应付管理人报酬		628,632.92	669,238.08
应付托管费		104,772.14	111,539.67
应付销售服务费		1,925.51	307.30
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,601,688.54	3,584,586.94
负债合计		7,879,208.20	6,649,711.23
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	319,927,537.44	366,085,278.24
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	274,848,040.78	285,750,932.45
净资产合计		594,775,578.22	651,836,210.69
<b>负债和净资产总计</b>		<b>602,654,786.42</b>	<b>658,485,921.92</b>

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 319,927,537.44 份，其中 A 类基金份额净值 1.8592 元，基金份额总额 319,241,009.23 份；C 类基金份额净值 1.8297 元，基金份额总额 686,528.21 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安幸福生活混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
<b>一、营业收入</b>		32,763,612.25	-101,753,322.40
1. 利息收入		294,436.15	394,694.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	294,436.15	394,694.91

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		29,393,176.45	-118,700,751.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	13,267,621.06	-127,467,374.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	60,305.01	610,564.77
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	-	-
股利收益	7.4.7.15	16,065,250.38	8,156,058.63
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,845,671.24	16,349,216.21
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	230,328.41	203,517.83
<b>减：二、营业总支出</b>		9,873,026.13	13,136,996.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,250,231.88	11,060,699.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,375,038.59	1,843,449.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	49,711.69	4,921.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.19	0.65
8. 其他费用	7.4.7.19	198,043.78	227,925.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,890,586.12	-114,890,319.25
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,890,586.12	-114,890,319.25

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,890,586.12	-114,890,319.25

### 7.3 净资产变动表

会计主体：华安幸福生活混合型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	366,085,278.24	-	285,750,932.45	651,836,210.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	366,085,278.24	-	285,750,932.45	651,836,210.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,157,740.80	-	-10,902,891.67	-57,060,632.47
(一)、综合收益总额	-	-	22,890,586.12	22,890,586.12
(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)	-46,157,740.80	-	-33,793,477.79	-79,951,218.59
其中：1.基金申购款	63,406,098.90	-	62,270,323.48	125,676,422.38
2.基金赎回款	- 109,563,839.70	-	-96,063,801.27	-205,627,640.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	319,927,537.44	-	274,848,040.78	594,775,578.22
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	456,975,729.61	-	498,734,503.86	955,710,233.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	456,975,729.61	-	498,734,503.86	955,710,233.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,890,451.37	-	-212,983,571.41	-303,874,022.78
(一)、综合收益总额	-	-	-114,890,319.25	-114,890,319.25
(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)	-90,890,451.37	-	-98,093,252.16	-188,983,703.53
其中：1.基金申购款	23,845,587.39	-	25,719,754.85	49,565,342.24
2.基金赎回款	-114,736,038.76	-	-123,813,007.01	-238,549,045.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	366,085,278.24	-	285,750,932.45	651,836,210.69

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>朱学华</u> 基金管理人负责人	<u>朱学华</u> 主管会计工作负责人	<u>陈松一</u> 会计机构负责人
------------------------	-------------------------	-----------------------

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安幸福生活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[2017]第 1535 号《关于准予华安幸福生活混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 10 月 26 日生效，首次设立募集为 3,844,867,784.03 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及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人华安基金管理有限公司于 2022 年 5 月 10 日发布的《华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2022 年 5 月 10 日起，本基金增加 C 类份额。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、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)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指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相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。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：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的“幸福生活”相关的证券的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合约需

缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围相应调整。

本基金的业绩比较基准为：80%×中证 800 指数收益率+20%×中债综合全价指数收益率。

#### 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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形

的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

## (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

## (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### (5) 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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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) 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；

(2) 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不能低于面值；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

#### 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得

额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	78,505,608.59	67,374,812.93
等于：本金	78,496,364.35	67,367,923.32
加：应计利息	9,244.24	6,889.61
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	78,505,608.59	67,374,812.93

### 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	500,070,463.93	-	507,029,434.33	6,958,970.40
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	500,070,463.93	-	507,029,434.33	6,958,970.40
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	581,891,878.54	-	586,005,177.70	4,113,299.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	382,700.00	27.68	382,727.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	382,700.00	27.68	382,727.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	582,274,578.54	27.68	586,387,905.38	4,113,299.16

### 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

无余额。

### 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

无余额。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 7.4.7.5 其他资产

无余额。

### 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	134.28	1,402.43
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,441,554.26	3,393,184.51
其中：交易所市场	1,441,554.26	3,393,184.51
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	1,601,688.54	3,584,586.94

### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

#### 华安幸福生活混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	365,734,934.00	365,734,934.00
本期申购	48,462,567.99	48,462,567.99
本期赎回(以“-”号填列)	-94,956,492.76	-94,956,492.76
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	319,241,009.23	319,241,009.23

#### 华安幸福生活混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	350,344.24	350,344.24
本期申购	14,943,530.91	14,943,530.91
本期赎回(以“-”号填列)	-14,607,346.94	-14,607,346.94
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	686,528.21	686,528.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安幸福生活混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	192,403,356.16	93,080,324.25	285,483,680.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	192,403,356.16	93,080,324.25	285,483,680.41
本期利润	19,767,998.53	4,893,130.70	24,661,129.23
本期基金份额交易产生的变动数	-26,335,834.08	-9,530,558.15	-35,866,392.23
其中：基金申购款	24,919,764.72	23,213,269.32	48,133,034.04
基金赎回款	-51,255,598.80	-32,743,827.47	-83,999,426.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	185,835,520.61	88,442,896.80	274,278,417.41

华安幸福生活混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	177,751.05	89,500.99	267,252.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	177,751.05	89,500.99	267,252.04
本期利润	276,916.35	-2,047,459.46	-1,770,543.11
本期基金份额交易产生的变动数	-76,106.41	2,149,020.85	2,072,914.44
其中：基金申购款	7,425,812.00	6,711,477.44	14,137,289.44
基金赎回款	-7,501,918.41	-4,562,456.59	-12,064,375.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	378,560.99	191,062.38	569,623.37

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	263,911.93	336,909.14
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	27,442.75	50,502.79
其他	3,081.47	7,282.98
合计	294,436.15	394,694.91

### 7.4.7.10 股票投资收益

#### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,267,621.06	-127,467,374.75
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	13,267,621.06	-127,467,374.75

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出股票成交总额	2,883,877,168.86	4,422,892,218.99
减：卖出股票成本总额	2,865,008,388.71	4,537,651,428.27
减：交易费用	5,601,159.09	12,708,165.47
买卖股票差价收入	13,267,621.06	-127,467,374.75

### 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1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	57.90	182.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	60,247.11	610,382.03
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	60,305.01	610,564.77

#### 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1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1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	505,054.59	2,933,809.62
减：卖出债券（债转股 及债券到期兑付）成本 总额	444,700.00	2,323,000.00
减：应计利息总额	87.12	310.59
减：交易费用	20.36	117.00
买卖债券差价收入	60,247.11	610,382.03

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

##### 7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资产生的股利 收益	16,065,250.38	8,156,058.63
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	16,065,250.38	8,156,058.63

#### 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1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	2,845,671.24	16,349,216.21
股票投资	2,845,671.24	16,349,216.21
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,845,671.24	16,349,216.21

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	221,352.66	189,399.79
基金转换费收入	8,975.75	14,118.04
合计	230,328.41	203,517.83

#### 7.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	40,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	646.93	725.35

账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,396.85	1,200.00
合计	198,043.78	227,925.35

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股 票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)
国泰君安证券股 份有限公司	1,029,436,497.89	18.18	1,492,458,830.02	17.04

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
国泰君安证券股份 有限公司	432,140.38	76.21	382,700.00	9.97

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安证券股 份有限公司	726,516.70	19.14	225,037.29	15.61
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安证券股 份有限公司	1,382,077.31	16.97	453,030.15	13.35

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）根据《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

#### 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1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,250,231.88	11,060,699.53
其中：应支付销售机构的客户维 护费	3,447,444.22	4,661,438.59
应支付基金管理人的净管理费	4,802,787.66	6,399,260.94

注：2023年7月10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；2023年7月10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，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,375,038.59	1,843,449.89

注：2023年7月10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；2023年7月10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，逐日累计至每月月末，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1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	170.81	170.81
中国建设银行股份有限 公司	-	-	-
合计	-	170.81	170.81

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	226.61	226.61
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	226.61	226.61

注：自 2022 年 5 月 10 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.60% 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销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

份额单位：份

华安幸福生活混合 A

关联方名称	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
国泰君安投资管理股份有限公司	10,206,242.86	3.19	10,206,242.86	2.79

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定确定，符合公允性要求。

#### 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1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1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
建设银行	78,505,608.59	263,911.93	67,374,812.93	336,909.14

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	7,740	125,388.00
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安证券股份有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
国泰君安证券股份有限公司	301607	富特科技	网下申购	2,567	35,938.00
国泰君安证券股份有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,872	74,672.00
国泰君安证券股份有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
国泰君安证券股份有限公司	301571	国科天成	网下申购	3,499	38,978.86
国泰君安证券股份有限公司	301556	托普云农	网下申购	2,663	38,613.50
国泰君安证券股份有限公司	603194	中力股份	网下申购	2,904	59,009.28
上年度可比期间					

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单 位: 股/ 张 )	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	7,473	176,362.80
国泰君安证券股份有限公司	301456	盘古智能	网下申购	4,061	154,155.56
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688347	华虹公司	网下申购	28,322	1,472,744.00
国泰君安证券股份有限公司	301511	德福科技	网下申购	9,813	274,764.00
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	9,241	103,961.25
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量 (单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型		单价	位： 股)			
001279	强邦新材	2024 年 9 月 27 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	2.30	6.80	4,461	10,260.30	30,334.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024 年 10 月 10 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024 年 7 月 3 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特	2024 年 8	1-6 个 月	新股 限售	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-

	科 技	月 28 日	(含)							
301611	珂 玛 科 技	2024 年 8 月 7 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新 铝 时 代	2024 年 10 月 18 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博 苑 股 份	2024 年 12 月 3 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301626	苏 州 天 脉	2024 年 10 月 17 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	1 个 月 (含)	新股 未上 市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众 鑫 股 份	2024 年 9 月 10 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中 力 股 份	2024 年 12 月 17 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健 尔 康	2024 年 10 月 29 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小 方 制 药	2024 年 8 月 19 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键 邦	2024 年 6	1-6 个 月	新股 限售	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

	股 份	月 28 日	(含)							
603310	巍 华 新 材	2024 年 8 月 7 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安 乃 达	2024 年 6 月 26 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力 聚 热 能	2024 年 7 月 24 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688605	先 锋 精 科	2024 年 12 月 4 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合 合 信 息	2024 年 9 月 19 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳 驰 科 技	2024 年 11 月 27 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益 诺 思	2024 年 8 月 27 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙 图 光 罩	2024 年 7 月 30 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉 普 拉 斯	2024 年 10 月 22 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金 天 钛 业	2024 年 11 月 12 日	1-6 个 月 (含)	新股 限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

##### 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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

###### 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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	78,505,608.59	-	-	-	78,505,608.59
结算备付金	2,740,603.28	-	-	-	2,740,603.28
存出保证金	286,107.37	-	-	-	286,107.37
交易性金融资产	-	-	-	507,029,434.33	507,029,434.33
应收申购款	-	-	-	36,622.50	36,622.50
应收清算款	-	-	-	14,056,410.35	14,056,410.35
资产总计	81,532,319.24	-	-	521,122,467.18	602,654,786.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,657,423.93	1,657,423.93
应付管理人报酬	-	-	-	628,632.92	628,632.92
应付托管费	-	-	-	104,772.14	104,772.14
应付清算款	-	-	-	3,884,765.16	3,884,765.16
应付销售服务费	-	-	-	1,925.51	1,925.51
其他负债	-	-	-	1,601,688.54	1,601,688.54
负债总计	-	-	-	7,879,208.20	7,879,208.20
利率敏感度缺口	81,532,319.24	-	-	513,243,258.98	594,775,578.22
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	67,374,812.93	-	-	-	67,374,812.93
结算备付金	1,808,435.78	-	-	-	1,808,435.78
存出保证金	302,807.32	-	-	-	302,807.32
交易性金融资产	382,727.68	-	-	586,005,177.70	586,387,905.38
应收申购款	-	-	-	92,564.61	92,564.61
应收清算款	-	-	-	2,519,395.90	2,519,395.90
资产总计	69,868,783.71	-	-	588,617,138.21	658,485,921.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	796,229.36	796,229.36
应付管理人报酬	-	-	-	669,238.08	669,238.08
应付托管费	-	-	-	111,539.67	111,539.67
应付清算款	-	-	-	1,487,809.02	1,487,809.02
应付销售服务费	-	-	-	307.30	307.30
应交税费	-	-	-	0.86	0.86
其他负债	-	-	-	3,584,586.94	3,584,586.94
负债总计	-	-	-	6,649,711.23	6,649,711.23
利率敏感度缺口	69,868,783.71	-	-	581,967,426.98	651,836,210.69

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2023年12月31日：0.06%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023年12月31日：同)。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 60–95%；投资于本基金界定的“幸福生活”相关的证券的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合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	507,029,434.33	85.25	586,005,177.70	89.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	382,727.68	0.06
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	507,029,434.33	85.25	586,387,905.38	89.96

注：本表中交易性金融资产—债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	33,060,525.02	36,566,425.64
	业绩比较基准下降5%	-33,060,525.02	-36,566,425.64

#### 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	506,475,724.47	584,439,217.13
第二层次	27,736.50	382,727.68
第三层次	525,973.36	1,565,960.57
合计	507,029,434.33	586,387,905.38

#### 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1月1日至2024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	-	1,565,960.57	1,565,960.57
当期购买	-	461,997.74	461,997.74
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,986,100.37	3,986,100.37
当期利得或损失总额	-	2,484,115.42	2,484,115.42
其中：计入损益的利得或损失	-	2,484,115.42	2,484,115.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	525,973.36	525,973.36
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	-	315,142.62	315,142.62
项目	上年度可比期间 2023年1月1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	-	735,742.59	735,742.59
当期购买	-	2,418,084.81	2,418,084.81
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,800,300.13	4,800,300.13

当期利得或损失总额	-	3,212,433.30	3,212,433.30
其中：计入损益的利得或损失	-	3,212,433.30	3,212,433.30
计入其他综合收益的利得或损失	-		-
期末余额	-	1,565,960.57	1,565,960.57
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	-	-123,727.74	-123,727.74

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资(2023 年 12 月 31 日：同)。于 2024 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资(2023 年度：同)。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 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
流通受限股票	525,973.36	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	26.65%— 574.44%	负相关
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
流通受限股票	1,565,960.57	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	14.62%— 217.75%	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 3 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	507,029,434.33	84.13
	其中：股票	507,029,434.33	84.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	81,246,211.87	13.48
8	其他各项资产	14,379,140.22	2.39
9	合计	602,654,786.42	100.00

### 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,596,883.00	1.95
C	制造业	371,744,141.42	62.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,944,041.00	0.33
E	建筑业	1,462,066.00	0.25

F	批发和零售业	263,120.35	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	59,826,253.40	10.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,808,020.60	0.47
J	金融业	53,483,555.00	8.99
K	房地产业	384,340.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	181,772.56	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	3,335,241.00	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	507,029,434.33	85.25

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	002463	沪电股份	1,072,450	42,522,642.50	7.15
2	601398	工商银行	4,189,200	28,989,264.00	4.87
3	300705	九典制药	1,525,900	27,389,905.00	4.61
4	600066	宇通客车	1,033,000	27,250,540.00	4.58
5	600428	中远海特	3,448,800	25,176,240.00	4.23
6	002241	歌尔股份	868,000	22,403,080.00	3.77
7	603129	春风动力	117,600	18,471,432.00	3.11
8	601919	中远海控	1,179,400	18,280,700.00	3.07
9	601288	农业银行	3,246,600	17,336,844.00	2.91
10	601567	三星医疗	528,023	16,241,987.48	2.73
11	300308	中际旭创	118,457	14,630,624.07	2.46
12	000977	浪潮信息	258,000	13,385,040.00	2.25
13	002444	巨星科技	411,100	13,299,085.00	2.24
14	601702	华峰铝业	725,500	13,291,160.00	2.23
15	002429	兆驰股份	1,821,600	10,528,848.00	1.77
16	601127	赛力斯	76,786	10,242,484.54	1.72
17	603871	嘉友国际	523,796	10,135,452.60	1.70
18	300750	宁德时代	37,800	10,054,800.00	1.69
19	002668	TCL 智家	747,500	9,807,200.00	1.65

20	601857	中国石油	1,095,700	9,795,558.00	1.65
21	002984	森麒麟	379,460	9,357,483.60	1.57
22	002897	意华股份	196,000	8,104,600.00	1.36
23	603556	海兴电力	209,930	7,765,310.70	1.31
24	300502	新易盛	60,700	7,015,706.00	1.18
25	300863	卡倍亿	144,200	6,445,740.00	1.08
26	601229	上海银行	685,700	6,274,155.00	1.05
27	000988	华工科技	143,100	6,196,230.00	1.04
28	601111	中国国航	736,400	5,824,924.00	0.98
29	688800	瑞可达	107,849	5,404,313.39	0.91
30	688208	道通科技	99,729	3,905,387.64	0.66
31	603005	晶方科技	129,000	3,644,250.00	0.61
32	300274	阳光电源	49,100	3,625,053.00	0.61
33	600323	瀚蓝环境	140,700	3,323,334.00	0.56
34	688041	海光信息	21,921	3,283,546.59	0.55
35	605196	华通线缆	280,086	3,271,404.48	0.55
36	002765	蓝黛科技	375,300	3,227,580.00	0.54
37	002837	英维克	79,500	3,211,800.00	0.54
38	002078	太阳纸业	212,300	3,156,901.00	0.53
39	000333	美的集团	41,200	3,099,064.00	0.52
40	301498	乖宝宠物	39,000	3,054,480.00	0.51
41	300866	安克创新	30,000	2,929,200.00	0.49
42	301327	华宝新能	36,900	2,830,599.00	0.48
43	603596	伯特利	63,200	2,818,088.00	0.47
44	301187	欧圣电气	76,500	2,608,650.00	0.44
45	600577	精达股份	353,800	2,579,202.00	0.43
46	688278	特宝生物	22,794	1,672,395.78	0.28
47	603338	浙江鼎力	20,937	1,350,855.24	0.23
48	600559	老白干酒	62,700	1,316,073.00	0.22
49	605286	同力日升	40,800	1,230,528.00	0.21
50	000543	皖能电力	146,900	1,161,979.00	0.20
51	601668	中国建筑	185,320	1,111,920.00	0.19
52	688376	美埃科技	31,487	1,051,350.93	0.18
53	601958	金钼股份	100,600	1,012,036.00	0.17
54	605319	无锡振华	44,300	932,515.00	0.16
55	002353	杰瑞股份	23,800	880,362.00	0.15
56	600732	爱旭股份	74,300	818,786.00	0.14
57	002294	信立泰	24,700	763,971.00	0.13
58	002475	立讯精密	18,700	762,212.00	0.13
59	603297	永新光学	7,791	730,951.62	0.12
60	002991	甘源食品	7,300	682,696.00	0.11
61	300679	电连技术	11,100	662,670.00	0.11
62	002155	湖南黄金	41,400	651,222.00	0.11

63	300354	东华测试	18,700	650,573.00	0.11
64	688378	奥来德	28,223	643,766.63	0.11
65	600150	中国船舶	16,000	575,360.00	0.10
66	300580	贝斯特	24,635	565,373.25	0.10
67	603380	易德龙	21,700	542,283.00	0.09
68	002371	北方华创	1,300	508,300.00	0.09
69	600958	东方证券	45,700	482,592.00	0.08
70	002558	巨人网络	37,800	479,682.00	0.08
71	603927	中科软	22,052	478,528.40	0.08
72	002891	中宠股份	13,400	478,380.00	0.08
73	688226	威腾电气	18,621	467,945.73	0.08
74	600536	中国软件	9,500	443,555.00	0.07
75	300772	运达股份	33,300	440,892.00	0.07
76	600011	华能国际	64,100	433,957.00	0.07
77	603699	纽威股份	18,200	403,494.00	0.07
78	688981	中芯国际	4,068	384,914.16	0.06
79	601333	广深铁路	110,200	377,986.00	0.06
80	002916	深南电路	3,010	376,250.00	0.06
81	600246	万通发展	50,400	375,480.00	0.06
82	601601	中国太保	11,000	374,880.00	0.06
83	600522	中天科技	25,500	365,160.00	0.06
84	603197	保隆科技	9,500	358,625.00	0.06
85	603393	新天然气	11,500	348,105.00	0.06
86	301269	华大九天	2,800	339,080.00	0.06
87	600285	羚锐制药	15,100	334,616.00	0.06
88	601390	中国中铁	50,400	322,056.00	0.05
89	301392	汇成真空	4,969	306,885.44	0.05
90	300014	亿纬锂能	6,500	303,810.00	0.05
91	688563	航材股份	5,416	302,429.44	0.05
92	002850	科达利	3,000	293,040.00	0.05
93	300953	震裕科技	4,100	285,524.00	0.05
94	600989	宝丰能源	16,800	282,912.00	0.05
95	300130	新国都	13,000	281,580.00	0.05
96	300896	爱美客	1,500	273,750.00	0.05
97	600933	爱柯迪	16,500	268,950.00	0.05
98	000034	神州数码	7,507	263,120.35	0.04
99	688588	凌志软件	18,616	256,900.80	0.04
100	002324	普利特	24,600	234,438.00	0.04
101	002540	亚太科技	37,449	230,685.84	0.04
102	300820	英杰电气	4,100	226,525.00	0.04
103	688088	虹软科技	4,567	176,103.52	0.03
104	603259	药明康德	3,100	170,624.00	0.03
105	688521	芯原股份	3,127	163,948.61	0.03

106	688010	福光股份	5,543	157,975.50	0.03
107	002291	遥望科技	22,600	142,606.00	0.02
108	300260	新莱应材	5,180	140,326.20	0.02
109	601001	晋控煤业	10,100	138,067.00	0.02
110	300607	拓斯达	5,000	127,450.00	0.02
111	688275	万润新能	2,617	126,479.61	0.02
112	301617	博苑股份	2,524	126,387.49	0.02
113	603194	中力股份	2,904	101,705.10	0.02
114	301345	涛涛车业	1,434	94,787.40	0.02
115	688256	寒武纪	100	65,800.00	0.01
116	688692	达梦数据	175	63,777.00	0.01
117	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
118	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
119	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
120	688122	西部超导	1,000	42,820.00	0.01
121	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
122	300418	昆仑万维	1,000	38,480.00	0.01
123	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
124	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.01
125	001391	国货航	4,461	30,334.80	0.01
126	688111	金山办公	100	28,639.00	0.00
127	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
128	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
129	300059	东方财富	1,000	25,820.00	0.00
130	300785	值得买	761	25,493.50	0.00
131	688032	禾迈股份	222	25,006.08	0.00
132	300433	蓝思科技	1,000	21,900.00	0.00
133	300634	彩讯股份	1,000	21,800.00	0.00
134	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
135	000997	新大陆	1,000	19,950.00	0.00
136	000032	深桑达 A	1,000	17,640.00	0.00
137	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
138	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
139	301565	中仑新材	711	15,215.40	0.00
140	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
141	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
142	000888	峨眉山 A	900	11,907.00	0.00
143	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
144	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
145	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
146	601800	中国交建	1,000	10,450.00	0.00
147	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
148	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00

149	600048	保利发展	1,000	8,860.00	0.00
150	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
151	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
152	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
153	301071	力量钻石	180	6,525.00	0.00
154	300769	德方纳米	160	5,900.80	0.00
155	688063	派能科技	140	5,607.00	0.00
156	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
157	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
158	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
159	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
160	600219	南山铝业	1,000	3,910.00	0.00
161	603381	永臻股份	178	3,901.76	0.00
162	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
163	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
164	603799	华友钴业	100	2,926.00	0.00
165	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
166	003033	征和工业	100	2,685.00	0.00
167	603897	长城科技	100	2,350.00	0.00
168	002487	大金重工	100	2,049.00	0.00
169	601012	隆基绿能	100	1,571.00	0.00
170	300421	力星股份	100	1,119.00	0.00
171	601816	京沪高铁	100	616.00	0.00

## 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	601398	工商银行	71,520,169.00	10.97
2	002371	北方华创	60,038,477.00	9.21
3	002384	东山精密	58,815,947.00	9.02
4	300308	中际旭创	56,157,732.49	8.62
5	600066	宇通客车	55,450,141.00	8.51
6	002916	深南电路	54,171,529.48	8.31
7	300394	天孚通信	53,655,619.40	8.23
8	000977	浪潮信息	51,801,812.00	7.95
9	600011	华能国际	49,884,776.00	7.65
10	300502	新易盛	44,983,394.30	6.90
11	601288	农业银行	41,882,479.00	6.43
12	600150	中国船舶	41,312,316.96	6.34
13	601919	中远海控	40,706,213.50	6.24
14	603129	春风动力	39,557,499.00	6.07
15	002475	立讯精密	39,302,997.85	6.03

16	300705	九典制药	38,026,059.28	5.83
17	000521	长虹美菱	37,679,706.00	5.78
18	601857	中国石油	37,426,581.00	5.74
19	688376	美埃科技	35,279,196.24	5.41
20	601127	赛力斯	33,735,272.25	5.18
21	601166	兴业银行	31,518,176.00	4.84
22	601001	晋控煤业	31,515,669.46	4.83
23	000034	神州数码	31,104,006.16	4.77
24	601666	平煤股份	30,898,554.44	4.74
25	002463	沪电股份	28,849,428.20	4.43
26	605196	华通线缆	28,527,211.15	4.38
27	002353	杰瑞股份	28,105,981.97	4.31
28	601702	华峰铝业	26,425,523.00	4.05
29	002897	意华股份	26,309,211.00	4.04
30	002241	歌尔股份	25,233,711.00	3.87
31	002749	国光股份	24,720,545.25	3.79
32	603871	嘉友国际	24,619,148.00	3.78
33	600428	中远海特	24,459,507.50	3.75
34	002984	森麒麟	24,258,242.12	3.72
35	605319	无锡振华	23,912,506.00	3.67
36	601138	工业富联	23,828,432.00	3.66
37	600985	淮北矿业	23,305,141.94	3.58
38	002668	TCL 智家	22,653,483.00	3.48
39	300866	安克创新	22,557,423.24	3.46
40	002991	甘源食品	21,746,605.32	3.34
41	002594	比亚迪	21,727,970.75	3.33
42	002273	水晶光电	21,727,049.56	3.33
43	600026	中远海能	21,679,512.00	3.33
44	002833	弘亚数控	21,018,676.56	3.22
45	002765	蓝黛科技	20,547,118.00	3.15
46	002444	巨星科技	20,490,606.00	3.14
47	300842	帝科股份	20,387,913.64	3.13
48	002533	金杯电工	20,260,971.80	3.11
49	002938	鹏鼎控股	20,243,058.00	3.11
50	600323	瀚蓝环境	20,032,797.00	3.07
51	688521	芯原股份	19,857,529.89	3.05
52	603337	杰克股份	19,108,531.00	2.93
53	601668	中国建筑	18,326,985.40	2.81
54	603556	海兴电力	18,098,313.00	2.78
55	601985	中国核电	17,879,489.00	2.74
56	688800	瑞可达	17,594,836.82	2.70
57	688676	金盘科技	17,305,245.87	2.65
58	600522	中天科技	17,033,731.92	2.61

59	300130	新国都	16,704,309.76	2.56
60	603050	科林电气	16,484,775.47	2.53
61	600732	爱旭股份	16,222,862.40	2.49
62	301345	涛涛车业	16,164,727.75	2.48
63	301589	诺瓦星云	16,073,006.20	2.47
64	300274	阳光电源	15,996,988.80	2.45
65	601333	广深铁路	15,687,329.26	2.41
66	688278	特宝生物	15,236,721.72	2.34
67	600566	济川药业	14,706,397.99	2.26
68	300750	宁德时代	14,493,131.20	2.22
69	688010	福光股份	14,485,695.69	2.22
70	601600	中国铝业	14,288,756.00	2.19
71	000680	山推股份	14,200,589.25	2.18
72	688208	道通科技	14,157,025.94	2.17
73	605286	同力日升	14,106,805.00	2.16
74	600894	广日股份	13,851,381.00	2.12
75	603927	中科软	13,812,453.52	2.12
76	000404	长虹华意	13,772,748.50	2.11

注：本项“买入金额”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。

#### 8.4.2 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	002384	东山精密	69,871,339.62	10.72
2	300308	中际旭创	62,884,314.13	9.65
3	002371	北方华创	61,837,501.52	9.49
4	300394	天孚通信	56,638,108.60	8.69
5	603871	嘉友国际	48,737,911.40	7.48
6	601398	工商银行	47,257,521.00	7.25
7	600011	华能国际	47,044,512.00	7.22
8	002916	深南电路	45,399,237.36	6.96
9	601567	三星医疗	41,913,999.26	6.43
10	000521	长虹美菱	41,650,769.05	6.39
11	300502	新易盛	41,042,934.00	6.30
12	301345	涛涛车业	38,395,059.71	5.89
13	605319	无锡振华	38,346,657.52	5.88
14	000977	浪潮信息	37,704,137.82	5.78
15	600150	中国船舶	36,373,921.60	5.58
16	002475	立讯精密	36,361,112.00	5.58
17	601166	兴业银行	35,450,475.00	5.44
18	688376	美埃科技	34,216,359.92	5.25

19	603556	海兴电力	33,280,405.30	5.11
20	002463	沪电股份	33,224,326.00	5.10
21	300130	新国都	32,780,705.38	5.03
22	000034	神州数码	32,442,138.83	4.98
23	601666	平煤股份	32,204,721.00	4.94
24	601058	赛轮轮胎	30,960,534.86	4.75
25	605098	行动教育	30,494,859.20	4.68
26	600066	宇通客车	30,204,677.17	4.63
27	002273	水晶光电	29,254,158.00	4.49
28	002749	国光股份	28,250,093.56	4.33
29	300866	安克创新	27,626,009.67	4.24
30	300832	新产业	26,680,879.12	4.09
31	601001	晋控煤业	26,576,547.37	4.08
32	600985	淮北矿业	26,568,735.47	4.08
33	601138	工业富联	26,131,739.00	4.01
34	300679	电连技术	25,807,983.00	3.96
35	601857	中国石油	25,363,603.00	3.89
36	002594	比亚迪	25,318,368.00	3.88
37	601288	农业银行	25,157,412.00	3.86
38	002353	杰瑞股份	23,993,645.00	3.68
39	605196	华通线缆	23,921,455.00	3.67
40	601225	陕西煤业	23,918,621.00	3.67
41	601127	赛力斯	23,634,168.30	3.63
42	603050	科林电气	22,537,494.57	3.46
43	601919	中远海控	22,387,506.00	3.43
44	600566	济川药业	21,896,650.76	3.36
45	600026	中远海能	21,820,111.00	3.35
46	002533	金杯电工	21,487,534.67	3.30
47	603129	春风动力	21,008,564.00	3.22
48	300842	帝科股份	20,728,003.64	3.18
49	002938	鹏鼎控股	20,228,506.00	3.10
50	002833	弘亚数控	20,186,768.51	3.10
51	688676	金盘科技	20,162,181.80	3.09
52	603337	杰克股份	20,127,643.54	3.09
53	000680	山推股份	19,729,233.00	3.03
54	601985	中国核电	19,441,874.98	2.98
55	600188	兖矿能源	19,253,036.95	2.95
56	688521	芯原股份	18,665,854.46	2.86
57	688062	迈威生物	18,264,794.40	2.80
58	600323	瀚蓝环境	17,943,126.54	2.75
59	688981	中芯国际	17,868,630.70	2.74
60	000403	派林生物	17,099,960.25	2.62
61	002429	兆驰股份	17,008,307.00	2.61

62	603338	浙江鼎力	16,562,837.00	2.54
63	002765	蓝黛科技	16,560,320.00	2.54
64	688278	特宝生物	16,557,651.26	2.54
65	600522	中天科技	16,424,175.00	2.52
66	688318	财富趋势	16,312,961.76	2.50
67	002991	甘源食品	16,077,209.31	2.47
68	601668	中国建筑	16,060,178.60	2.46
69	002897	意华股份	15,719,352.00	2.41
70	600276	恒瑞医药	15,555,496.76	2.39
71	300695	兆丰股份	15,549,316.00	2.39
72	601600	中国铝业	15,385,262.00	2.36
73	600546	山煤国际	14,909,879.00	2.29
74	601163	三角轮胎	14,838,022.00	2.28
75	002984	森麒麟	14,635,311.20	2.25
76	000404	长虹华意	14,531,914.50	2.23
77	605286	同力日升	14,228,763.00	2.18
78	601333	广深铁路	14,197,403.00	2.18
79	605090	九丰能源	14,187,108.14	2.18
80	600894	广日股份	14,016,502.99	2.15
81	300476	胜宏科技	13,923,845.04	2.14
82	002668	TCL 智家	13,764,872.00	2.11
83	300274	阳光电源	13,748,769.44	2.11
84	301589	诺瓦星云	13,669,854.28	2.10
85	600732	爱旭股份	13,072,854.00	2.01
86	002444	巨星科技	13,071,414.00	2.01

注：本项“卖出金额”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。

#### 8.4.3 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	2,783,186,974.10
卖出股票收入（成交）总额	2,883,877,168.86

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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投资。

**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投资。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

**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**

无。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

**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**

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

**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	286,107.37
2	应收清算款	14,056,410.35

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,622.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,379,140.22

#### 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情况。

### § 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(%)
华安幸福生活混合 A	45,799	6,970.48	10,256,360.15	3.21	308,984,649.08	96.79
华安幸福生活混合 C	169	4,062.30	410,934.78	59.86	275,593.43	40.14
合计	45,968	6,959.79	10,667,294.93	3.33	309,260,242.51	96.67

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 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	华安幸福生活混合 A	606,299.57	0.19
	华安幸福生活混合 C	-	-

有本基金			
	合计	606,299.57	0.19

### 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	华安幸福生活混合 A	-
	华安幸福生活混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	华安幸福生活混合 A	10~50
	华安幸福生活混合 C	-
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C
基金合同生效日 (2017 年 10 月 26 日) 基金份额总额	3,844,867,784.03	-
本报告期期初基金份额总额	365,734,934.00	350,344.24
本报告期基金总申购份额	48,462,567.99	14,943,530.91
减：本报告期基金总赎回份额	94,956,492.76	14,607,346.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	319,241,009.23	686,528.21

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 3 月 12 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公

告》，范伊然女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 11 月 9 日起更换会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。此次变更已经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并已按照相关规定及基金合同约定通知基金托管人。

报告年度应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 40,000.00 元。

目前该审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2024 年 11 月 9 日起至今。

### 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

本报告期内无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

本报告期内无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 (%)	
国泰君安	3	1,029,436,497.89	18.18	726,516.70	19.14	-
华安证券	1	699,067,590.85	12.34	622,283.69	16.39	-

海通证券	1	652,287,542 .45	11.52	333,191.40	8.78	-
国盛证券	1	563,487,790 .76	9.95	398,987.44	10.51	-
方正证券	3	548,656,809 .47	9.69	354,819.59	9.35	-
天风证券	2	382,927,358 .45	6.76	209,663.23	5.52	-
申万宏源	2	293,485,949 .21	5.18	157,536.91	4.15	-
东北证券	1	223,310,865 .88	3.94	176,534.49	4.65	-
兴业证券	1	194,634,481 .60	3.44	88,727.74	2.34	-
西南证券	1	184,453,207 .68	3.26	84,091.15	2.22	-
财通证券	1	150,459,097 .36	2.66	140,814.14	3.71	-
招商证券	4	146,621,704 .06	2.59	138,684.04	3.65	-
国信证券	1	133,360,391 .37	2.35	60,833.94	1.60	-
中信证券	1	90,101,553. 85	1.59	41,078.98	1.08	-
光大证券	2	86,537,030. 37	1.53	39,453.33	1.04	-
中信建投	2	66,267,984. 86	1.17	30,254.17	0.80	-
广发证券	2	58,667,822. 83	1.04	55,496.57	1.46	-
长江证券	2	52,517,264. 56	0.93	45,159.51	1.19	-
上海证券	2	42,751,569. 99	0.75	40,009.80	1.05	-
中泰证券	1	34,902,700. 97	0.62	32,665.15	0.86	-
瑞银证券	1	17,062,898. 32	0.30	7,781.10	0.20	-
华泰证券	1	12,288,493. 00	0.22	11,625.01	0.31	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-	-

注：本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《华安基金管理有限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）》的报告期为 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。

### 1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

- (1) 财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；
- (2) 提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；
- (3) 交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

### 2、选择证券公司参与证券交易的程序：

#### (1) 候选证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

#### (2) 候选证券公司的准入评估

对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

#### (3) 候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

#### (4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：国泰君安、广发证券、招商证券。

撤销交易单元的证券公司：上海证券、财信证券、财达证券、光大证券。

### 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	
	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(%)
国泰君安	432,140.38	76.21	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	72,914.21	12.86	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	62,000.00	10.93	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-

投						
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## 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	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（永兴股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024年1月12日
2	华安幸福生活混合 2023 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024年1月19日
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（北	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2024年1月24日

	自科技)	站	
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（肯特股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 21 日
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（龙旗科技）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 2 月 24 日
6	华安基金管理有限公司关于副总经理任职的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 12 日
7	华安幸福生活混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
8	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 3 月 27 日
9	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
10	华安幸福生活混合 2024 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 4 月 22 日
11	华安幸福生活混合 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
12	华安幸福生活混合 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（键邦股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 29 日
14	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
15	华安幸福生活混合 2024 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 19 日
16	关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 7 月 24 日
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（国科天成）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 15 日
18	华安基金管理有限公司关于旗下基	中国证监会基金电子披	2024 年 8 月 29 日

	金投资关联方承销证券的公告（富特科技）	露网站及基金管理人网站	
19	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
20	华安幸福生活 2024 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 8 月 31 日
21	华安基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 12 日
22	关于终止中民财富基金销售(上海)有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 18 日
23	华安幸福生活混合更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 20 日
24	华安幸福生活混合 A 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 20 日
25	华安幸福生活混合 C 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 9 月 20 日
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（托普云农）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 11 日
27	华安幸福生活混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
28	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 10 月 25 日
29	华安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 11 月 9 日
30	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（中力股份）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 18 日
31	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日
32	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 12 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## § 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

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《华安幸福生活混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安幸福生活混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安幸福生活混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安幸福生活混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日