

贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 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 2024 年 3 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56

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	56
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	56
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12	投资组合报告附注	56
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
§10	开放式基金份额变动	59
§11	重大事件揭示	60
11.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8	其他重大事件	62
§12	影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	64
§13	备查文件目录	65
13.1	备查文件目录	65
13.2	存放地点	65
13.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金	
基金简称	贝莱德港股通远景视野混合	
基金主代码	014746	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 21 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
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	354,438,560.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德港股通远景视野混合 A	贝莱德港股通远景视野混合 C
下属分级基金的交易代码	014746	014747
报告期末下属分级基金的份额总额	208,216,874.28 份	146,221,685.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格风险控制的基础上，通过使用偏向长期投资的总收益策略，从深入的个股研究出发，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>在股票投资层面，本基金采用主动投资管理策略，精选具有核心竞争优势和长期持续稳定增长模式的上市公司。</p> <p>（1）定性分析，主要考虑以下四个方面因素：1）市场容量；2）行业周期；3）公司；4）人员。</p> <p>（2）定量分析，通过量化指标，考察个股的估值水平、上市公司成长性和盈利水平。</p> <p>（3）港股通标的股票投资策略。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。</p> <p>3、资产支持证券投资策略；</p> <p>4、金融衍生品投资策略；</p> <p>5、存托凭证投资策略；</p> <p>6、融资投资策略。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×80%+沪深 300 指数收益率×10%+一年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

	本基金投资港股通标的股票，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		贝莱德基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈剑	陆志俊
	联系电话	021-80225188	95559
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-002-6655	95559
传真		021-80225288	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		张弛	任德奇

注：本报告截止日至报告批准送出日期间，基金管理人法定代表人变更为：陈剑。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 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	2023 年		2022 年 1 月 21 日（基金合同生效日） - 2022 年 12 月 31 日	
	贝莱德港股通远景 视野混合 A	贝莱德港股通远 景视野混合 C	贝莱德港股通远 景视野混合 A	贝莱德港股通远 景视野混合 C
本期已实现收益	-42,730,476.02	-30,843,714.97	-30,220,167.92	-24,617,236.63
本期利润	-49,859,022.07	-36,002,725.49	-32,530,378.28	-27,090,594.96
加权平均基金份额本期利润	-0.2146	-0.2168	-0.1168	-0.1254
本期加权平均净值利润率	-27.04%	-27.46%	-12.90%	-13.85%
本期基金份额净值增长率	-24.17%	-24.55%	-10.71%	-11.13%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-67,240,347.32	-48,178,712.78	-27,113,707.05	-20,832,531.38
期末可供分配基金份额利润	-0.3229	-0.3295	-0.1071	-0.1113
期末基金资产净值	140,976,526.96	98,042,973.06	226,061,263.98	166,345,049.86
期末基金份额净值	0.6771	0.6705	0.8929	0.8887
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-32.29%	-32.95%	-10.71%	-11.13%

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

3、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、表中的“期末”指报告期最后一日，即 12 月 31 日。

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

贝莱德港股通远景视野混合 A

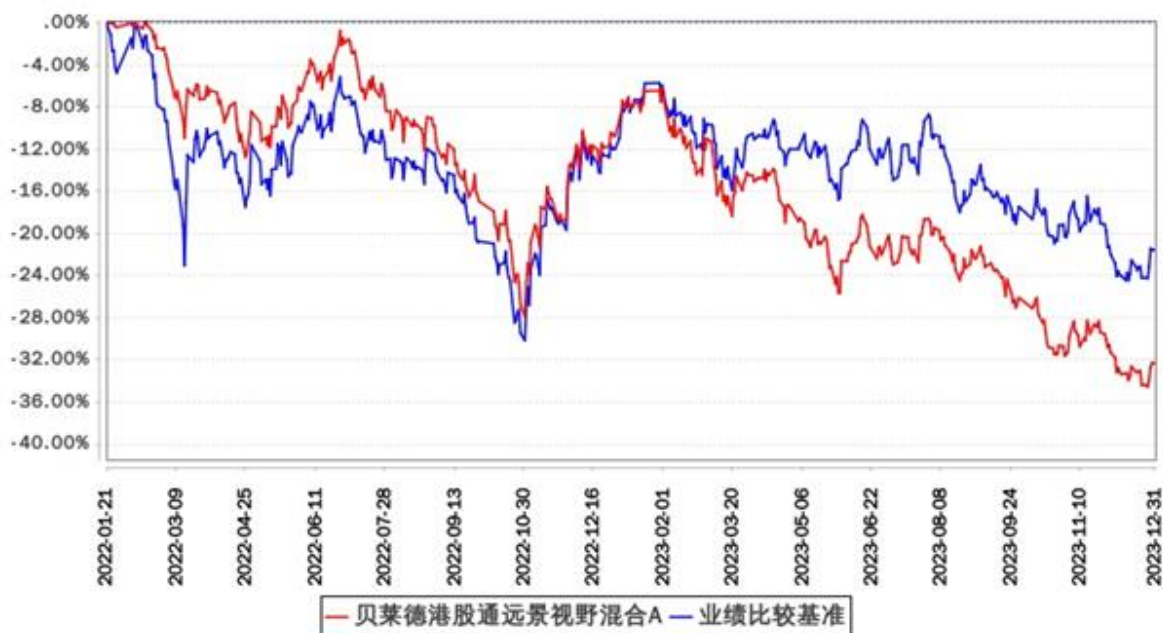
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.38%	1.03%	-4.98%	1.16%	-3.40%	-0.13%
过去六个月	-13.49%	1.04%	-10.06%	1.16%	-3.43%	-0.12%
过去一年	-24.17%	1.12%	-10.88%	1.14%	-13.29%	-0.02%
自基金合同生效日起至 今	-32.29%	1.22%	-21.54%	1.44%	-10.75%	-0.22%

贝莱德港股通远景视野混合 C

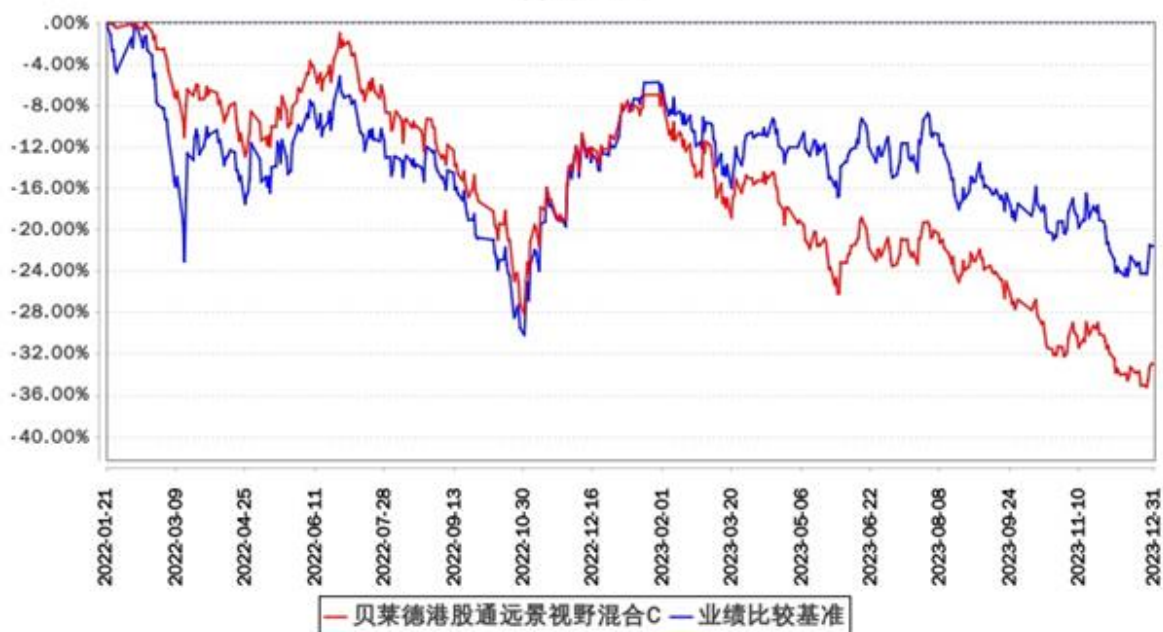
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.50%	1.04%	-4.98%	1.16%	-3.52%	-0.12%
过去六个月	-13.72%	1.04%	-10.06%	1.16%	-3.66%	-0.12%
过去一年	-24.55%	1.12%	-10.88%	1.14%	-13.67%	-0.02%
自基金合同生效日起至 今	-32.95%	1.22%	-21.54%	1.44%	-11.41%	-0.22%

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

贝莱德港股通远景视野混合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



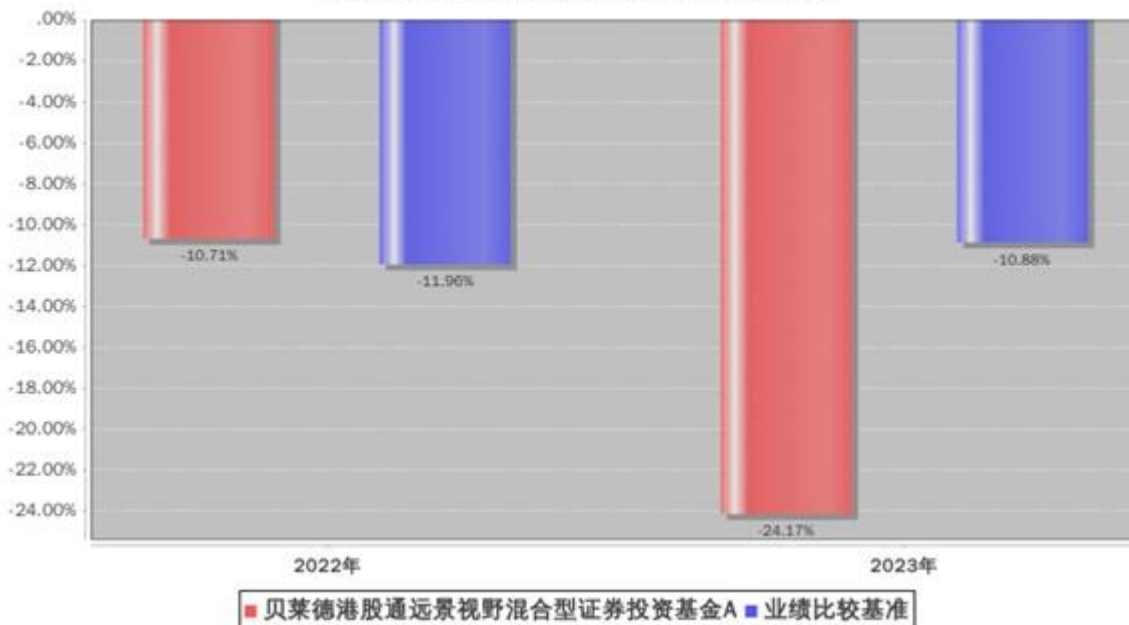
贝莱德港股通远景视野混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



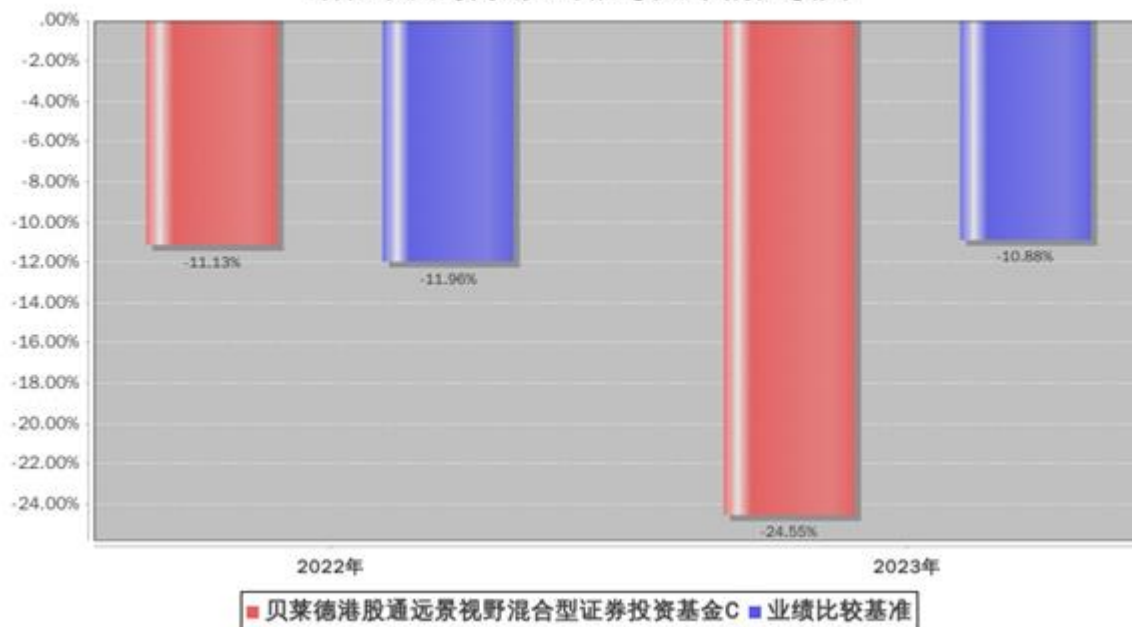
注：本基金的基金合同于 2022 年 1 月 21 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金A自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金C自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：1、本基金合同生效日期为 2022 年 1 月 21 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2022 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 7 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿 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		
陆文杰	本基金的基金经理、副总经理、首席投资官、权益投资总监	2022 年 1 月 21 日	-	16	陆文杰先生，副总经理、首席投资官、权益投资总监、权益投资部基金经理。曾任贝莱德投资管理（上海）有限公司投资负责人、瑞银证券有限责任公司投资策略师、平安资产管理有限责任公司组合配置经理、中国国际金融（香港）有限公司投资经理，还曾供职于德意志银行香港分行、波士顿咨询（上海）有限公司。陆文杰先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有上海交通大学应用数学理学硕士学位、法国巴黎中央理工大学工程硕士学位。

单秀丽	本基金的 基金经理	2022 年 1 月 21 日	-	7	单秀丽女士，权益投资部基金经理。曾任贝莱德投资管理（上海）有限公司投资经理，贝莱德资本管理公司（威明顿，美国）量化风控/收益分析师。单秀丽女士是金融风险管理师（FRM）持证人，拥有美国里海大学理学硕士学位。
杨栋	本基金的 基金经理	2022 年 3 月 8 日	-	10	杨栋女士，权益投资部基金经理。曾任汇添富资产管理（香港）有限公司研究员、基金经理，穆迪投资者服务公司研究分析员，毕马威会计师事务所审计员。杨栋女士是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有香港大学经济与金融学士学位。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《贝莱德基金管理有限公司公平交易管理流程》。公司通过严谨科学的投资决策体系、内控制度和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和内部审计等对公平交易过程和结果

进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5%的情况。

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

2023 年上半年，在市场对美联储政策放松和中国经济增长修复的预期下，港股市场在开年迎来“抢跑”行情。但之后，中国经济的弱复苏使得投资者年初的强预期不断下修，港股市场也持续回调。因此组合在二季度将仓位适度降低，以求在政策、宏观经济不确定性较大的时期增加组合的防御性，同时将持仓聚焦在业绩确定性强、估值具有吸引力的个股上，特别是滞涨的绩优成长股，力求获得超额收益。

进入下半年，在 7 月政治局会议后的一系列政策组合拳下，国内宏观经济出现了改善趋势，基本面预期逐渐向好，但仍呈现缓慢复苏的状况。海外层面，地缘风险扰动、美国通胀再度超预期引发美债利率冲高，对市场风险偏好带来一定扰动，也对港股形成一定压制。

截至报告期末，恒生指数下跌 13.82%，恒生科技指数下跌 8.83%。

截至报告期末，组合仓位处于中等偏上水平，板块上采用相对均衡的配置策略，将持仓聚焦在业绩确定性强、估值具有吸引力的个股以及部分具有较高贝塔的弹性标的。具体到板块变动上，本季度组合主要降低了泛消费板块的风险暴露，增加了高股息股票的占比，加强组合的防御性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 0.6771 元，本报告期内净值增长率-24.17%，同期业绩比较基准收益率-10.88%。截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 0.6705 元，本报告期内净值增长率-24.55%，同期业绩比较基准收益率-10.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望中长期，中国经济将持续面临转型期的挑战，以发展先进制造，促进科技进步、刺激消费等为主要发展目标，逐步摆脱对地产和基建的依赖，经济增长中枢将不可避免下移。短期来看，市场已经在逐步消化对中长期较为悲观的预期，加上政策的托底，市场底部或许已经出现。

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，本基金管理人有效落实合规管理、风险防控及监察稽核工作。合规管理方面，公司制定了一系列合规管理制度，建立健全合规管理机制，并对投资交易等重点领域强化合规风险防控。公司建立了投资监督机制，对基金投资交易过程中的合规风险进行把控。公司积极开展合规培训，强化员工合规意识，培育合规文化，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露要求，按期完成信息披露工作。风险防控方面，公司秉承风险管理为核心的管理理念，搭建了内部风险管理系统并持续完善，对投资、流动性、信用、集中度、赎回和可持续性等相关风险进行度量，保障基金承担的风险审慎、适当。同时，动态监测并与基金经理密切沟通基金风险水平，力争确保投资组合预期与业绩的一致性。监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及合规检查，对发现的问题积极完善，为公司业务合规运作和稳健经营保驾护航。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将持续加强监察稽核管理，坚持基金份额持有人利益优先，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《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，委托基金服务机构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。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，交通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关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	普华永道中天审字(2024)第 20516 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	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(以下简称“贝莱德港股通远景视野混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</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在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了贝莱德港股通远景视野混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于贝莱德港股通远景视野混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>贝莱德港股通远景视野混合基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括贝莱德港股通远景视野混合基金 2023 年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。基于我们已经执行的工作，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监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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贝莱德港股通远景视野混合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贝莱德港股通远景视野混合基金、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贝莱德港股通远景视野混合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> <p>(一) 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>(二) 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>(三) 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>(四) 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，就可能对贝莱德港股通远景视野混合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</p>

	<p>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贝莱德港股通远景视野混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰 顾俊懿
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	39,519,310.23	18,735,897.73
结算备付金		-	51,495,415.45
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	200,647,236.83	323,806,394.47
其中：股票投资		200,647,236.83	323,806,394.47
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-112.25	-
应收清算款		-	-
应收股利		21,920.00	18,480.00
应收申购款		16,449.99	94,624.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		240,204,804.80	394,150,811.84
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		679,495.37	994,650.01
应付管理人报酬		243,447.33	496,512.53
应付托管费		40,574.54	82,752.09
应付销售服务费		41,547.13	70,158.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		240.41	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	180,000.00	100,424.52
负债合计		1,185,304.78	1,744,498.00
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	354,438,560.12	440,352,552.27
未分配利润	7.4.7.8	-115,419,060.10	-47,946,238.43
净资产合计		239,019,500.02	392,406,313.84
负债和净资产总计		240,204,804.80	394,150,811.84

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 354,438,560.12 份，其中 A 类基金份额净值 0.6771 元，基金份额 208,216,874.28 份；C 类基金份额净值 0.6705 元，基金份额 146,221,685.84 份。

7.2 利润表

会计主体：贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上期
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 21 日（基 金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-79,697,007.19	-51,028,775.79
1.利息收入		326,551.44	1,666,911.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	162,605.49	723,969.41
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		163,945.95	942,942.12
--其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-67,752,400.61	-48,080,976.52
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-71,343,037.55	-57,003,035.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	45,875.58
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	3,590,636.94	8,876,183.53
以摊余成本计量的金融资 产终止确认产生的收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	7.4.7.14	-12,287,556.57	-4,783,568.69

号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.15	16,398.55	168,857.89
减：二、营业总支出		6,164,740.37	8,592,197.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,547,868.33	6,362,978.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	757,978.08	1,060,496.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	659,527.56	927,012.40
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. 税金及附加		590.21	3,394.59
8. 其他费用	7.4.7.16	198,776.19	238,315.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-85,861,747.56	-59,620,973.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-85,861,747.56	-59,620,973.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-85,861,747.56	-59,620,973.24

7.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1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	440,352,552.27	-47,946,238.43	392,406,313.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	440,352,552.27	-47,946,238.43	392,406,313.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-85,913,992.15	-67,472,821.67	-153,386,813.82
(一)、综合收益总额	-	-85,861,747.56	-85,861,747.56
(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)	-85,913,992.15	18,388,925.89	-67,525,066.26

其中：1. 基金申购款	20,605,948.34	-3,365,754.97	17,240,193.37
2. 基金赎回款	-106,519,940.49	21,754,680.86	-84,765,259.63
(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	354,438,560.12	-115,419,060.10	239,019,500.02
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2022 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	573,134,187.27	-	573,134,187.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-132,781,635.00	-47,946,238.43	-180,727,873.43
(一)、综合收益总额	-	-59,620,973.24	-59,620,973.24
(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)	-132,781,635.00	11,674,734.81	-121,106,900.19
其中：1. 基金申购款	34,233,007.87	-3,932,925.52	30,300,082.35
2. 基金赎回款	-167,014,642.87	15,607,660.33	-151,406,982.54
(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	440,352,552.27	-47,946,238.43	392,406,313.84

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：

_____ 陈剑

基金管理人负责人

_____ 杨怡

主管会计工作负责人

_____ 罗元

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]4096号《关于准予贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币573,062,511.62元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0102号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同》于2022年1月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为573,134,187.27份基金份额,其中认购资金利息折合71,675.65份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同》和《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各该类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的公司股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、金融衍生品(国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具,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)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定,参与融资融券业务中的融资业务。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%,

投资于港股通标的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×80%+沪深 300 指数收益率×10%+一年期定期存款利率（税后）×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具

有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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逐日确认。

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

本基金同一类别内每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金分红形式与红利再投资形式分配，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。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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入账。

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本基金的基金管理人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）本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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）对于证券交易所上市的股票和债券，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,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，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。

对基金通过沪港通/深港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。基金通过沪港通/深港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) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	128,494.65	18,735,897.73
等于：本金	128,325.52	18,733,843.52
加：应计利息	169.13	2,054.21
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	39,390,815.58	-
等于：本金	39,387,003.96	-
加：应计利息	3,811.62	-
合计	39,519,310.23	18,735,897.73

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	217,718,362.09	-	200,647,236.83	-17,071,125.26
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	217,718,362.09	-	200,647,236.83	-17,071,125.26

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	328,589,963.16	-	323,806,394.47	-4,783,568.69
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	328,589,963.16	-	323,806,394.47	-4,783,568.69

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未持有衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-112.25	-
银行间市场	-	-
合计	-112.25	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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未持有从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未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	24.52
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
预提费用	180,000.00	100,400.00
合计	180,000.00	100,424.52

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德港股通远景视野混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	253,174,971.03	253,174,971.03
本期申购	12,591,619.64	12,591,619.64
本期赎回（以“-”号填列）	-57,549,716.39	-57,549,716.39
本期末	208,216,874.28	208,216,874.28

金额单位：人民币元

贝莱德港股通远景视野混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,177,581.24	187,177,581.24
本期申购	8,014,328.70	8,014,328.70
本期赎回（以“-”号填列）	-48,970,224.10	-48,970,224.10
本期末	146,221,685.84	146,221,685.84

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

贝莱德港股通远景视野混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,691,431.93	-422,275.12	-27,113,707.05
本期期初	-26,691,431.93	-422,275.12	-27,113,707.05
本期利润	-42,730,476.02	-7,128,546.05	-49,859,022.07
本期基金份额交易产生的变动数	8,481,015.32	1,251,366.48	9,732,381.80
其中：基金申购款	-1,838,670.59	-164,317.83	-2,002,988.42
基金赎回款	10,319,685.91	1,415,684.31	11,735,370.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,940,892.63	-6,299,454.69	-67,240,347.32

单位：人民币元

贝莱德港股通远景视野混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,492,831.04	-339,700.34	-20,832,531.38
本期期初	-20,492,831.04	-339,700.34	-20,832,531.38
本期利润	-30,843,714.97	-5,159,010.52	-36,002,725.49
本期基金份额交易产生的变动数	7,580,574.59	1,075,969.50	8,656,544.09
其中：基金申购款	-1,226,786.14	-135,980.41	-1,362,766.55
基金赎回款	8,807,360.73	1,211,949.91	10,019,310.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,755,971.42	-4,422,741.36	-48,178,712.78

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,166.21	146,357.41
定期存款利息收入	-	346,491.67
其他存款利息收入	129,439.28	-
结算备付金利息收入	-	231,120.33
其他	-	-
合计	162,605.49	723,969.41

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 21 日(基金合同生效 日)至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	392,375,234.83	415,600,255.26
减: 卖出股票成本总额	462,242,796.33	470,277,492.27
减: 交易费用	1,475,476.05	2,325,798.62
买卖股票差价收入	-71,343,037.55	-57,003,035.63

7.4.7.10.2 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 21 日(基金合同生 效日)至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	-	64,412.08
债券投资收益——买卖债券(债转股 及债券到期兑付)差价收入	-	-18,536.50
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	-	45,875.58

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 21 日(基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成交总额	-	92,686,522.00
减: 卖出债券(债转股及债券	-	90,698,626.30

到期兑付)成本总额		
减：应计利息总额	-	1,987,907.00
减：交易费用	-	18,525.20
买卖债券差价收入	-	-18,536.50

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月21日(基金合同生 效日)至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,590,636.94	8,876,183.53
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	3,590,636.94	8,876,183.53

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月21日(基金合同生效 日)至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,287,556.57	-4,783,568.69
——股票投资	-12,287,556.57	-4,783,568.69
——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	-12,287,556.57	-4,783,568.69

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月21日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
基金赎回费收入	16,362.64	168,753.78
基金转出费收入	35.91	101.48
其他	-	2.63
合计	16,398.55	168,857.89

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月21日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	60,000.00	100,400.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	400.00
证券组合费	18,776.19	17,515.55
合计	198,776.19	238,315.55

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

贝莱德金融管理公司	基金管理人的股东
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月21日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,547,868.33	6,362,978.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,110,319.49	2,937,373.87
应支付基金管理人的净管理费	2,437,548.84	3,425,604.67

注：自2022年1月21日（基金合同生效日）至2023年9月21日，支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

根据《贝莱德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自2023年9月22日起，支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月21日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	757,978.08	1,060,496.37

注：自2022年1月21日（基金合同生效日）至2023年9月21日，支付基金托管人交通银行的托

管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《贝莱德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 9 月 22 日起，支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

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 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		
	贝莱德港股通远景 视野混合 A	贝莱德港股通远景 视野混合 C	合计
交通银行	-	13,286.93	13,286.93
合计	-	13,286.93	13,286.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 21 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德港股通远景 视野混合 A	贝莱德港股通远景 视野混合 C	合计
交通银行	-	20,049.18	20,049.18
合计	-	20,049.18	20,049.18

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.50%/当年天数。

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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月21日(基金合同生效日)至2022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	128,494.65	33,166.21	18,735,897.73	146,357.41

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

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**

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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出借业务的证券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度触发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，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

存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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，违约可能性很小；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并对证券交割方式进行限制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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%）。

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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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

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%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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货币资金、结算备付金、买入返售金融资产和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	39,519,310.23	-	-	-	39,519,310.23
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	200,647,236.83	200,647,236.83
买入返售金融资产	-112.25	-	-	-	-112.25
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	21,920.00	21,920.00
应收申购款	-	-	-	16,449.99	16,449.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,519,197.98	-	-	200,685,606.82	240,204,804.80
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	679,495.37	679,495.37
应付管理人报酬	-	-	-	243,447.33	243,447.33
应付托管费	-	-	-	40,574.54	40,574.54
应付销售服务费	-	-	-	41,547.13	41,547.13
应交税费	-	-	-	240.41	240.41
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,185,304.78	1,185,304.78
利率敏感度缺口	39,519,197.98	-	-	199,500,302.04	239,019,500.02
上期末 2022 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	18,735,897.73	-	-	-	18,735,897.73
结算备付金	51,495,415.45	-	-	-	51,495,415.45
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	323,806,394.47	323,806,394.47
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	18,480.00	18,480.00
应收申购款	-	-	-	94,624.19	94,624.19
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	70,231,313.18	-	-	323,919,498.66	394,150,811.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	994,650.01	994,650.01
应付管理人报酬	-	-	-	496,512.53	496,512.53
应付托管费	-	-	-	82,752.09	82,752.09
应付销售服务费	-	-	-	70,158.85	70,158.85
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,424.52	100,424.52
负债总计	-	-	-	1,744,498.00	1,744,498.00
利率敏感度缺口	70,231,313.18	-	-	322,175,000.66	392,406,313.84

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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				
交易性金融资产	-	162,719,408.71	-	162,719,408.71
应收股利		21,920.00		21,920.00
资产合计	-	162,741,328.71	-	162,741,328.71
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	162,741,328.71	-	162,741,328.71
项目	上年度末 2022 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				
交易性金融资产	-	274,908,661.73	-	274,908,661.73
应收股利	-	18,480.00	-	18,480.00
资产合计	-	274,927,141.73	-	274,927,141.73
以外币计价的负债		-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	274,927,141.73	-	274,927,141.73

7.4.13.4.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	8,135,970.44	13,746,357.09
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,135,970.44	-13,746,357.09

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注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，投资于港股通标的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%，每个交易日日终，在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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，以识别和测算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 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	200,647,236.83	83.95
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	200,647,236.83	83.95
项目	上期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	323,806,394.47	82.52
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	323,806,394.47	82.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	9,267,172.92	-
	业绩比较基准下降 5%	- 9,267,172.92	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	200,647,236.83	323,806,394.47
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	200,647,236.83	323,806,394.47

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	200,647,236.83	83.53
	其中：股票	200,647,236.83	83.53
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	-112.25	0.00
	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	39,519,310.23	16.45
8	其他资产	38,369.99	0.02
9	合计	240,204,804.80	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 162,719,408.71 元，占资产净值比例为 68.08%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,327,185.40	13.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,105,790.72	0.88
J	金融业	2,494,852.00	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	37,927,828.12	15.87

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（%）
主要消费	17,222,194.54	7.21
金融	24,476,005.36	10.24
原材料	17,383,827.95	7.27
通信服务	41,796,511.19	17.49
信息技术	4,690,667.22	1.96
能源	16,516,620.72	6.91
公用事业	-	-
房地产	9,142,037.98	3.82
工业	17,807,177.69	7.45
医药卫生	8,019,924.67	3.36
可选消费	5,664,441.39	2.37
合计	162,719,408.71	68.08

注：以上分类采用中证行业分类标准。

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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	01024	快手-W	381,700	18,315,626.01	7.66
2	02588	中银航空租赁	288,900	15,629,875.39	6.54
3	00939	建设银行	3,101,000	13,067,375.22	5.47
4	00386	中国石油化工股份	3,240,000	12,008,864.95	5.02
5	00941	中国移动	200,500	11,773,972.73	4.93
6	00700	腾讯控股	44,000	11,706,912.45	4.90
7	01299	友邦保险	185,000	11,408,630.14	4.77
8	02367	巨子生物	252,600	8,149,237.72	3.41
9	002050	三花智控	265,200	7,796,880.00	3.26
10	688036	传音控股	48,141	6,662,714.40	2.79
11	02899	紫金矿业	548,000	6,316,860.88	2.64
12	01109	华润置地	196,000	4,973,335.36	2.08
13	00992	联想集团	474,000	4,690,667.22	1.96
14	00857	中国石油股份	964,000	4,507,755.77	1.89
15	06186	中国飞鹤	1,161,000	4,492,558.46	1.88
16	00189	东岳集团	875,000	4,480,125.13	1.87
17	02669	中海物业	785,000	4,168,702.62	1.74
18	002475	立讯精密	117,400	4,044,430.00	1.69
19	01818	招金矿业	457,000	4,021,324.06	1.68
20	300308	中际旭创	26,600	3,003,406.00	1.26
21	02359	药明康德	38,300	2,757,568.56	1.15
22	06078	海吉亚医疗	83,600	2,674,327.72	1.12
23	01515	华润医疗	592,500	2,588,028.39	1.08
24	03993	洛阳钼业	663,000	2,565,517.88	1.07
25	300124	汇川技术	40,500	2,557,170.00	1.07
26	002966	苏州银行	386,200	2,494,852.00	1.04
27	00168	青岛啤酒股份	48,000	2,279,324.54	0.95
28	603195	公牛集团	23,600	2,257,340.00	0.94
29	00669	创科实业	26,500	2,234,579.93	0.93
30	06110	滔搏	404,000	2,225,966.31	0.93
31	002430	杭氧股份	75,200	2,196,592.00	0.92
32	01138	中远海能	326,000	2,177,302.30	0.91
33	300750	宁德时代	13,300	2,171,358.00	0.91
34	688066	航天宏图	49,853	2,105,790.72	0.88
35	600519	贵州茅台	840	1,449,840.00	0.61
36	00291	华润啤酒	46,000	1,425,665.30	0.60
37	00780	同程旅行	92,000	1,203,895.15	0.50
38	002705	新宝股份	81,500	1,187,455.00	0.50

39	02319	蒙牛乳业	46,000	875,408.52	0.37
----	-------	------	--------	------------	------

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	00700	腾讯控股	19,406,191.16	4.95
2	00386	中国石油化工股份	18,484,841.27	4.71
3	02669	中海物业	15,918,580.37	4.06
4	002050	三花智控	15,097,145.00	3.85
5	01024	快手-W	14,879,351.31	3.79
6	00939	建设银行	12,812,261.01	3.27
7	600519	贵州茅台	12,652,391.00	3.22
8	01928	金沙中国有限公司	12,413,754.73	3.16
9	09995	荣昌生物	12,406,512.06	3.16
10	01515	华润医疗	12,057,140.31	3.07
11	00669	创科实业	11,985,864.56	3.05
12	00941	中国移动	11,569,561.35	2.95
13	02367	巨子生物	11,212,124.37	2.86
14	00200	新濠国际发展	11,025,032.52	2.81
15	01658	邮储银行	10,972,090.92	2.80
16	03690	美团-W	10,669,114.65	2.72
17	301155	海力风电	8,131,377.00	2.07
18	06078	海吉亚医疗	7,832,886.35	2.00
19	03993	洛阳钼业	5,995,100.32	1.53
20	688036	传音控股	5,987,087.05	1.53

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	03690	美团-W	27,284,096.00	6.95

2	00700	腾讯控股	20,960,966.44	5.34
3	00669	创科实业	17,083,679.98	4.35
4	02388	中银香港	15,715,158.30	4.00
5	600519	贵州茅台	15,081,228.00	3.84
6	00168	青岛啤酒股份	14,290,471.19	3.64
7	01299	友邦保险	12,175,195.48	3.10
8	00291	华润啤酒	10,345,731.73	2.64
9	02269	药明生物	9,973,129.16	2.54
10	01928	金沙中国有限公司	9,560,322.58	2.44
11	01658	邮储银行	9,454,184.62	2.41
12	00200	新濠国际发展	9,278,369.17	2.36
13	00857	中国石油股份	9,265,346.72	2.36
14	603939	益丰药房	9,254,423.20	2.36
15	01109	华润置地	9,187,898.47	2.34
16	02382	舜宇光学科技	9,104,101.03	2.32
17	03898	时代电气	9,092,541.30	2.32
18	02899	紫金矿业	9,027,335.16	2.30
19	01211	比亚迪股份	8,905,674.54	2.27
20	03323	中国建材	8,282,871.60	2.11
21	06078	海吉亚医疗	8,151,749.31	2.08
22	02669	中海物业	7,875,931.53	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	351,371,195.26
卖出股票收入（成交）总额	392,375,234.83

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：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

本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	21,920.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,449.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,369.99

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，投资组合报告中市值占净值比例的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
贝莱德港股通远景视野混合 A	4897	42,519.27	247,039.46	0.12%	207,969,834.82	99.88%
贝莱德港股通远景视野混合 C	3997	36,582.86	4,670,049.39	3.19%	141,551,636.45	96.81%
合计	8894	39,851.42	4,917,088.85	1.39%	349,521,471.27	98.61%

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	贝莱德港股通远景视野混合 A	1,147,230.53	0.5510%
	贝莱德港股通远景视野混合 C	1,106,041.18	0.7564%
	合计	2,253,271.71	0.6357%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，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）。

9.3 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的情况

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	贝莱德港股通远景视野混合 A	0

研究部门负责人持有本开放式基金	贝莱德港股通远景视野混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德港股通远景视野混合 A	50~100
	贝莱德港股通远景视野混合 C	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德港股通远景视野混合 A	贝莱德港股通远景视野混合 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 21 日） 基金份额总额	313,035,442.59	260,098,744.68
本报告期期初基金份额总额	253,174,971.03	187,177,581.24
本报告期基金总申购份额	12,591,619.64	8,014,328.70
减：本报告期基金总赎回份额	57,549,716.39	48,970,224.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	208,216,874.28	146,221,685.84

§ 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，基金管理人主要发生如下变更：

董事长变更：

2023 年 8 月 18 日起，汤晓东先生离任董事长，张弛先生代为履行董事长职务。

高级管理人员变更：

2023 年 4 月 1 日起，杨怡女士任副总经理、首席运营官，洪霞女士任副总经理、销售总监；

2023 年 5 月 18 日起，刘映洲先生任首席信息官，张鹏军/ PENG JUN ZHANG 先生离任首席信息官；

2023 年 7 月 1 日起，张鹏军/ PENG JUN ZHANG 先生离任副总经理。

本基金管理人已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无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 60,000.00 元人民币。

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**

注：本报告期内管理人及其高级管理人员无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

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
华泰证券股份有限公司		2743,746,430.09	100.00	603,402.75	100.00	

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

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
华泰证券股份有	-	-	2,039,084,000.00	100.00	-	-

限公司						
-----	--	--	--	--	--	--

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	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-1-20
2	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-3-31
3	贝莱德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	2023-4-3
4	贝莱德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	2023-4-3
5	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-4-21
6	贝莱德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	2023-5-19
7	贝莱德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	2023-7-1
8	关于贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金因新增港股通交易日恢复申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-7-4
9	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金因香港交易所休市暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-7-17
10	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2023-7-21
11	贝莱德基金管理有限公司董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告	中国证监会规定媒介	2023-8-19
12	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金招募说明书更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-8-30
13	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-8-30
14	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023-8-30
15	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-8-31
16	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金因香港交易所休市暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-9-1
17	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金因香港交易所休市暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-9-8
18	贝莱德基金管理有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告	中国证监会规定媒介	2023-9-13
19	贝莱德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金	中国证监会规定媒介	2023-9-20

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	费率并修改基金合同等法律文件的公告		
20	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023-9-20
21	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023-9-20
22	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金招募说明书更新(2023年第2号)	中国证监会规定媒介	2023-9-20
23	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-9-20
24	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-9-20
25	贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
26	关于贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金2024年非港股通交易日申购赎回安排的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-29

§ 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

注：本基金本报告期内未发生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、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的招募说明书
- 4、本基金的托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.blackrock.com.cn）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日