

# 汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月28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1月1日起至2024年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	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.....	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合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告.....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告.....	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	75
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.....	75
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.....	75

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 .....	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息 .....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
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.....	77
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	78
§10 开放式基金份额变动 .....	78
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
11.8 其他重大事件 .....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
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 .....	82
§13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点 .....	83
13.3 查阅方式 .....	83

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安沪深300增强	
基金主代码	003884	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年07月03日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	198,976,351.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	003884	003885
报告期末下属分级基金的份额总额	72,057,717.24份	126,918,634.21份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越沪深300指数的投资收益和基金财产的长期增值。</p>
投资策略	<p>本基金为增强型股票指数基金，在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。</p> <p>本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略等。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，理论上其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金</p>

	为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--------------------------

### 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		汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	朱萍
	联系电话	010-56711600	021-31888888
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95528
传真		010-56711640	021-63602540
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	上海市中山东一路12号
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		100007	200126
法定代表人		刘强	张为忠

### 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.huianfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26

注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元
--------	--------------	------------------------------

### §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	
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
本期已实现收益	-98,594.93	-1,418,776.90	-28,589,731.74	-35,499,166.07	-9,541,495.11	-12,450,114.45
本期利润	10,322,674.66	15,564,432.99	-24,318,382.32	-29,599,416.13	-37,276,592.20	-52,017,598.35
加权平均基金份额本期利润	0.1618	0.1483	-0.2602	-0.2329	-0.3904	-0.3919
本期加权平均净值利润率	12.86%	12.93%	-18.40%	-18.10%	-25.02%	-27.27%
本期基金份额净值增长率	13.12%	12.67%	-17.95%	-18.28%	-21.49%	-21.81%
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	17,028,969.50	15,582,868.15	12,667,466.96	12,578,964.62	46,567,004.55	49,020,325.40
期末可供分配基金份额利润	0.2363	0.1228	0.2029	0.1004	0.4660	0.3465
期末基金资产净值	98,047,646.68	157,351,163.56	75,099,593.33	137,828,448.32	146,491,873.46	190,496,737.96
期末基金份额净值	1.3607	1.2398	1.2029	1.1004	1.4660	1.3465
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	32.25%	28.34%	16.91%	13.91%	42.48%	39.39%

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、对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

### 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

##### 汇安沪深300增强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	-2.88%	1.59%	-1.92%	1.65%	-0.96%	-0.06%
过去六个月	10.12%	1.54%	13.05%	1.58%	-2.93%	-0.04%
过去一年	13.12%	1.25%	14.04%	1.27%	-0.92%	-0.02%
过去三年	-27.13%	1.18%	-19.21%	1.12%	-7.92%	0.06%
过去五年	4.39%	1.26%	-3.24%	1.17%	7.63%	0.09%
自基金合同生效起至今	32.25%	1.21%	15.45%	1.19%	16.80%	0.02%

##### 汇安沪深300增强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	-2.97%	1.59%	-1.92%	1.65%	-1.05%	-0.06%
过去六个月	9.90%	1.54%	13.05%	1.58%	-3.15%	-0.04%
过去一年	12.67%	1.25%	14.04%	1.27%	-1.37%	-0.02%
过去三年	-28.00%	1.18%	-19.21%	1.12%	-8.79%	0.06%
过去五年	2.34%	1.26%	-3.24%	1.17%	5.58%	0.09%
自基金合同	28.34%	1.21%	15.45%	1.19%	12.89%	0.02%



生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 3.2.2 自基金转型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

汇安沪深300增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年07月03日-2024年12月31日)

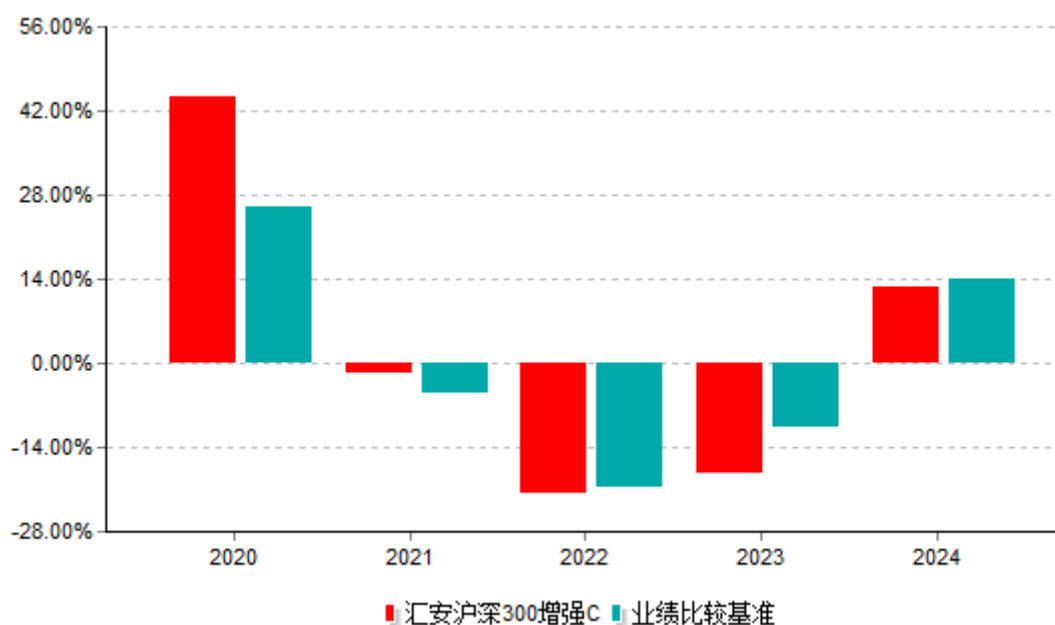
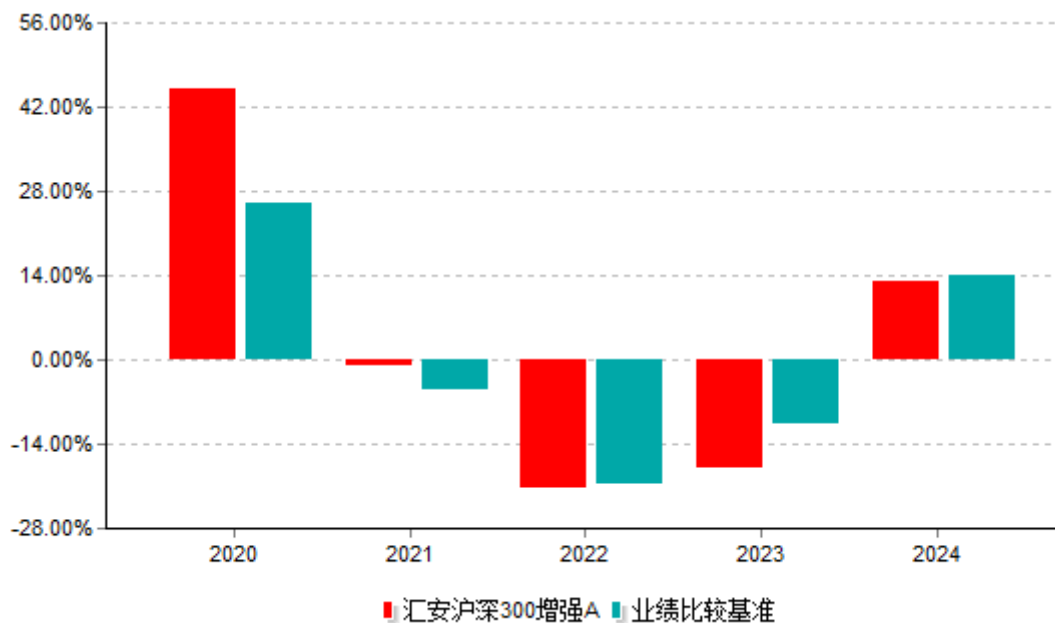


汇安沪深300增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年07月03日-2024年12月31日)



注：本基金实施转型日为2018年7月3日，本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

### 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

## §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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2024年12月31日，公司旗下管理64只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安嘉诚债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利混合型证券投资基金、汇安核心资产混合型证券投资基金、汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安价值蓝筹混合型证券投资基金、汇安消费龙头混合型证券投资基金、汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安中证500指数增强型证券投资基金、汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金、汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金、汇安均衡优选混合型证券投资基金、汇安核心价值混合型证券投资基金、汇安鑫利优选混合型证券投资基金、汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金、汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安优势企业精选混合型证券投资基金、汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金、汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金、汇安裕同纯债债券型证券投资基金、汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金、汇安远见成长混合型证券投资基金、汇安品质优选混合型证券投资基金、汇安价值先锋混合型证券投资基金、汇安裕泰纯债债券型证券投资基金、汇安裕盈纯债债券型证券投资基金、汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇安均衡成长

混合型证券投资基金、汇安行业优选混合型证券投资基金、汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金。

**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		
柳预才	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2023- 09-27	-	11年	柳预才先生，上海财经大学数量金融学硕士研究生，11年证券、基金行业从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究助理、研究员；安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员；农银汇理基金管理有限公司研究部研究员。2020年11月加入汇安基金管理有限责任公司，担任策略量化组基金经理。2021年9月3日至2023年6月19日，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至2024年12月23日，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年12月30日至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2022年12月23日至今，任汇安中证500指数增强型证券投资基金基金经理；2023年5月29

					<p>日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2023年6月6日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至今，任汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；2024年7月19日至今，任汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

- 1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。
- 3、本基金无基金经理助理。

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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩挂钩的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金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，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统中的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行业股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的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

回顾2024年，以沪深300为代表的宽基指数，在经历了长达三年的下跌后，年度收涨14.68%。指数在年内走势类似于W型，两个底部分别出现在2024年春节前和9月中旬。市场经历了相似的极度悲观-利好免疫-否极泰来的阶段，随着宏观政策、市场预期、风险偏好发生根本性变化后，之前的悲观情绪逐渐扭转。

行业角度看，31个申万一级行业中，2024年录得正收益的有21个，而2023年仅有10个行业录得正收益。整体表现最好的五个行业依次是银行、非银行金融、通信、家用电器和电子，他们分属红利类资产和科技成长股，这也正是过去一年中表现最好的两大板块。上半年，市场情绪和交投活跃度较差，红利股由于现金流回报稳定，安全边际厚，波动较低等特征，成为了机构的边际配置资金的避风港，表现出了较强的防御功能，表现较好。下半年，尤其是9月下旬以来，随着“一行一局一会”发布的一系列货币、房

地产、资产市场的组合政策，市场盈利预期、交投活跃度发生扭转，成交额的中枢自此大幅抬升。在这样的背景下，估值收敛到极致的科技成长股迎来了估值和盈利预期的大幅改善，短期弹性极大。随着全球人工智能产业的蓬勃发展，相关板块的科技成长股进入了新一轮的增长周期。

本产品业绩比较基准中包括沪深300，因此将更多地从沪深300成分股中挖掘优质个股，构建分散化组合。面对成长-价值风格的快速切换，以及风险偏好的变化，本基金坚持的定量化投资框架，具备长期纪律和规则约束，能提升投资过程的理性和客观程度。在行业均衡和个股分散的前提下，能持续、客观地捕捉市场的定价偏差，力图通过全市场范围内（而非集中在少数行业）的精选优质个股，获得波动可控的收益。与此同时，本基金管理人也针对不同的宏观环境、中观结构和微观特征，积极纳入新型的数据和信息，不断地完善投资框架，改进投资策略，提升模型的适应性和生命力，进而促进公募产品的高质量发展。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安沪深300增强A基金份额净值为1.3607元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.12%，同期业绩比较基准收益率为14.04%；截至报告期末汇安沪深300增强C基金份额净值为1.2398元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.67%，同期业绩比较基准收益率为14.04%。

#### 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，全球经济增速或将放缓，主要源于美欧等大型经济体的高基数和政策不确定性，以及流动性宽松带来的高通胀；叠加地缘摩擦不断，全球将面临着更加复杂的政治经济环境。有利的条件是，在国内财政政策与货币政策“双宽松”的带动下，全社会的融资成本降低，营商环境改善，市场的盈利预期和风险偏好有所提升，为整个宏观经济的修复提供支撑。

展望未来，随着海内外人工智能产业的飞速发展，以及通用大模型的成本降低，市场关注重点由算力转移到推理侧，AI应用迎来百花齐放的黄金发展期。从上游算力、推理对能源的刚需，到技术层面的推理应用，再到实体应用层面的超级智能体（AI Agent），整个产业链的上下游都出现了更为丰富的生态和扩展形式，各类全新的需求被挖掘、被发现、被创造，有了更具象和多样化的实现媒介。人工智能产业上承芯片、算力和数据中心的建设，下启各类应用软件的开发创新，产业协同效应显著。

其次，过去的一年国债利率快速下行，A股市场的优质资产愈发稀缺，持续稳定分红的高股息资产，配置价值日益凸显。随着国企改革逐渐进入深水区，市场愈发关注国有资产的保值增值、市值管理、股东回报提升和资源配置优化。自上而下的宏观政策，也从各个维度促进国企的高质量发展，力图为我国的宏观经济发展提供更稳健的支撑。

第三，过去几年内需消费相对疲软，2024年开始，各地陆续推动大规模设备更新和消费品以旧换新政策（广义的“家电补贴”）刺激，切实降低了广大消费者的实际购置成本，扩大了市场整体需求，一定程度上推动了整个上下游产业链的发展。此外，补贴政策对于智能化、节能环保的品类给予了更多的倾斜，有助于提升相应家电品类的产品更新换代和消费结构升级，对消费者信心也有显著的拉动作用。

上述这些行业或板块都具备比较优势，在现阶段的投资中都不容忽视。

#### 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，本基金管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理；全面加强风险控制，不断提高风险控制水平；有计划地开展监察稽核工作，推动公司内控体系和制度措施的落实，强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并通过实时监控、定期检查、专项检查等方式深入开展监察稽核工作，包括对基金投资运作、基金投资交易、基金销售与宣传、投资者适当性管理、客户服务、产品开发、信息披露、反洗钱工作、信息系统与信息安全和基金运营等方面进行监察稽核，及时发现上述业务开展中的相关问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金份额持有人的利益。

#### 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，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、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

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

#### 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇安沪深300指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安沪深300指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由汇安基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1162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	汇安沪深300指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇安沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“汇安沪深300指数增强基金”）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，公允反映了汇安沪深300指数增强基金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，我们独立于汇安沪深300指数增强基金，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	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇安沪深300指数增强基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司（以下简称“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</p>

	<p>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汇安沪深300指数增强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汇安沪深300指数增强基金、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汇安沪深300指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>（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</p>

	<p>恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对汇安沪深300指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇安沪深300指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、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。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张振波	金诗涛
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2025-03-27	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

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	44,581,864.93	17,733,145.33
结算备付金		2,506,740.80	365,682.55

存出保证金		1,619,462.74	46,203.65
交易性金融资产	7.4.7.2	213,852,071.10	194,644,647.83
其中：股票投资		213,852,071.10	194,644,647.83
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	-	-
应收清算款		-	2,127,655.51
应收股利		-	-
应收申购款		37,578.78	365,133.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		262,597,718.35	215,282,468.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		2024年12月31日	2023年12月31日
<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		6,128,401.04	1,050,084.39
应付赎回款		520,131.32	487,098.68
应付管理人报酬		202,845.80	178,495.80
应付托管费		20,284.60	17,849.58
应付销售服务费		47,578.03	46,208.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30,469.00	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	249,198.32	574,689.89
负债合计		7,198,908.11	2,354,426.57
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	198,976,351.45	187,681,610.07
未分配利润	7.4.7.8	56,422,458.79	25,246,431.58
净资产合计		255,398,810.24	212,928,041.65
负债和净资产总计		262,597,718.35	215,282,468.22

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额198,976,351.45份，其中汇安沪深300增强A基金份额净值1.3607元，份额总额72,057,717.24份；汇安沪深300增强C基金份额净值1.2398元，份额总额126,918,634.21份。

## 7.2 利润表

会计主体：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		28,943,909.43	-49,606,112.89
1.利息收入		104,300.55	68,959.60
其中：存款利息收入	7.4.7.9	92,495.74	68,959.60
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		11,804.81	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,383,117.52	-59,877,444.79
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,307,892.09	-63,916,985.82

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	5,825.16	26,578.57
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	960,273.30	-
股利收益	7.4.7.15	4,724,911.15	4,012,962.46
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	27,404,479.48	10,171,099.36
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	52,011.88	31,272.94
<b>减：二、营业总支出</b>		3,056,801.78	4,311,685.56
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	2,011,038.92	2,974,091.59
2.托管费	7.4.10.2.2	201,103.98	297,409.09
3.销售服务费	7.4.10.2.3	483,232.88	657,589.49
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		3,461.04	0.39
8.其他费用	7.4.7.18	357,964.96	382,595.00
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		25,887,107.65	-53,917,798.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		25,887,107.65	-53,917,798.45
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-

六、综合收益总额		25,887,107.65	-53,917,798.45
----------	--	---------------	----------------

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	187,681,610.07	25,246,431.58	212,928,041.65
二、本期期初净资产	187,681,610.07	25,246,431.58	212,928,041.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,294,741.38	31,176,027.21	42,470,768.59
（一）、综合收益总额	-	25,887,107.65	25,887,107.65
（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）	11,294,741.38	5,288,919.56	16,583,660.94
其中：1.基金申购款	105,336,783.89	23,744,840.33	129,081,624.22
2.基金赎回款	-94,042,042.51	-18,455,920.77	-112,497,963.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	198,976,351.45	56,422,458.79	255,398,810.24



项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	241,401,281.47	95,587,329.95	336,988,611.42
二、本期期初净资产	241,401,281.47	95,587,329.95	336,988,611.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,719,671.40	-70,340,898.37	-124,060,569.77
（一）、综合收益总额	-	-53,917,798.45	-53,917,798.45
（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）	-53,719,671.40	-16,423,099.92	-70,142,771.32
其中：1.基金申购款	48,862,460.59	15,227,419.53	64,089,880.12
2.基金赎回款	-102,582,131.99	-31,650,519.45	-134,232,651.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	187,681,610.07	25,246,431.58	212,928,041.65

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：

刘强

王嘉浩

江士

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇安沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇安丰泰混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于2018年7月3日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于2018年7月2日表决通过了《关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金转型的有关事项的议案》，同时根据《关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]737号)准予注册的批复，汇安丰泰混合基金于2018年7月3日实施转型。同日起，《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。原汇安丰泰混合基金A类基金份额转为本基金A类基金份额，原汇安丰泰混合基金C类基金份额转为本基金C类基金份额。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为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再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；在投资人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基金份额，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额的，称为C类基金份额。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安沪深300指数增强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、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转)、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分股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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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；权证、股指期货、国债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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2025年3月27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》、《汇安沪深300指数增强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2024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。

##### 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业务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业务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银行存款、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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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扣除按票面利率(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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为

基金份额进行再投资。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 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。

#### 7.4.4.13 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、债券投资和资产支持证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，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证指数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(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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[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]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。

(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。

(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	44,581,864.93	17,733,145.33
等于: 本金	44,576,543.80	17,731,259.91
加: 应计利息	5,321.13	1,885.42
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	44,581,864.93	17,733,145.33

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		205,005,772.53	-	213,852,071.10	8,846,298.57
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		205,005,772.53	-	213,852,071.10	8,846,298.57
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		212,803,828.74	-	194,644,647.83	-18,159,180.91
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		212,803,828.74	-	194,644,647.83	-18,159,180.91

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,295,280.00	-	-	-
--股指期货	10,295,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,295,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2503	IH2503	1.00	808,740.00	8,940.00
IF2502	IF2502	1.00	1,181,700.00	-18,300.00
IH2501	IH2501	2.00	1,614,960.00	27,480.00
IF2501	IF2501	2.00	2,363,280.00	1,080.00
IF2503	IF2503	4.00	4,725,600.00	379,800.00
合计				399,000.00

减：可抵销 期货暂收 款				399,000.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 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。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.5 其他资产

无。

##### 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	16.16	16.67
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	44,182.16	344,673.22
其中：交易所市场	44,182.16	344,673.22
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用-审计费	35,000.00	60,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	249,198.32	574,689.89

### 7.4.7.7 实收基金

#### 7.4.7.7.1 汇安沪深300增强A

金额单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,432,126.37	62,432,126.37
本期申购	26,781,674.19	26,781,674.19
本期赎回（以“-”号填列）	-17,156,083.32	-17,156,083.32
本期末	72,057,717.24	72,057,717.24

#### 7.4.7.7.2 汇安沪深300增强C

金额单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	125,249,483.70	125,249,483.70
本期申购	78,555,109.70	78,555,109.70
本期赎回（以“-”号填列）	-76,885,959.19	-76,885,959.19
本期末	126,918,634.21	126,918,634.21

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

#### 7.4.7.8.1 汇安沪深300增强A

单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,958,220.07	-2,290,753.11	12,667,466.96
本期期初	14,958,220.07	-2,290,753.11	12,667,466.96
本期利润	-98,594.93	10,421,269.59	10,322,674.66
本期基金份额交易产	2,169,344.36	830,443.46	2,999,787.82

生的变动数			
其中：基金申购款	5,820,026.02	1,980,859.30	7,800,885.32
基金赎回款	-3,650,681.66	-1,150,415.84	-4,801,097.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,028,969.50	8,960,959.94	25,989,929.44

#### 7.4.7.8.2 汇安沪深300增强C

单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,340,385.95	-3,761,421.33	12,578,964.62
本期期初	16,340,385.95	-3,761,421.33	12,578,964.62
本期利润	-1,418,776.90	16,983,209.89	15,564,432.99
本期基金份额交易产生的变动数	661,259.10	1,627,872.64	2,289,131.74
其中：基金申购款	8,589,779.52	7,354,175.49	15,943,955.01
基金赎回款	-7,928,520.42	-5,726,302.85	-13,654,823.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,582,868.15	14,849,661.20	30,432,529.35

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	81,987.58	62,730.06
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	5,125.76	5,415.01
其他	5,382.40	814.53
合计	92,495.74	68,959.60

**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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	429,468,742.44	586,080,847.95
减：卖出股票成本总额	433,086,534.24	648,688,334.46
减：交易费用	690,100.29	1,309,499.31
买卖股票差价收入	-4,307,892.09	-63,916,985.82

**7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入**

无。

**7.4.7.11 债券投资收益**

**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	4.21	91.15
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	5,820.95	26,487.42
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	5,825.16	26,578.57

**7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元



项目	本期 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	49,827.38	134,917.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	44,000.00	108,200.00
减：应计利息总额	4.44	225.09
减：交易费用	1.99	5.40
买卖债券差价收入	5,820.95	26,487.42

**7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**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。

**7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

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。

**7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

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**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
期货投资	960,273.30	-

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,724,911.15	4,012,962.46
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	4,724,911.15	4,012,962.46

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	27,005,479.48	10,171,099.36
——股票投资	27,005,479.48	10,193,366.92
——债券投资	-	-22,267.56
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	399,000.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	399,000.00	-
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	27,404,479.48	10,171,099.36

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	51,526.90	31,258.82
转换费收入	484.98	14.12
合计	52,011.88	31,272.94

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年 12月31日	2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	35,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,964.96	2,595.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	357,964.96	382,595.00

#### 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
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

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

无。

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,011,038.92	2,974,091.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	743,498.46	967,166.42
应支付基金管理人的净管理费	1,267,540.46	2,006,925.17

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	201,103.98	297,409.09

注：支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

### 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 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	合计
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	9,495.58	9,495.58
汇安基金管理有限责任公司	0.00	94,199.66	94,199.66
合计	0.00	103,695.24	103,695.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	合计
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	11,141.99	11,141.99
汇安基金管理有限责任公司	0.00	178,104.41	178,104.41
合计	0.00	189,246.40	189,246.40

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0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。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 × 0.40% / 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**

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**

无。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	44,581,864.93	81,987.58	17,733,145.33	62,730.06

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

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--固定净值型货币市场基金之外的基金

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	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688605	先锋精科	2024-12-04	1-6个月（含）	科创板打新限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	1-6个月（含）	科创板打新限售	17.58	33.06	843	14,819.94	27,869.58	-
688449	联芸科技	2024-11-20	1-6个月（含）	科创板打新限售	11.25	29.44	874	9,832.50	25,730.56	-
688750	金天钛业	2024-11-12	1-6个月（含）	科创板打新限售	7.16	15.44	1,440	10,310.40	22,233.60	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内（含）	新股未上市	12.30	12.30	1,674	20,590.20	20,590.20	-
688615	合合信息	2024-09-1	1-6个月（含）	科创板打	55.18	165.78	116	6,400.88	19,230.48	-



		9		新限售						
688721	龙图光罩	2024-07-30	1-6个月(含)	科创板打新限售	18.50	56.85	251	4,643.50	14,269.35	-
688710	益诺思	2024-08-27	1-6个月(含)	科创板打新限售	19.06	33.58	296	5,641.76	9,939.68	-
603395	红四方	2024-11-19	1-6个月(含)	新股锁定	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603194	中力股份	2024-12-17	1-6个月(含)	新股锁定	20.32	28.13	171	3,474.72	4,810.23	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	1-6个月(含)	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603205	健尔康	2024-10-29	1-6个月(含)	新股锁定	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603391	力聚热能	2024-07-24	1-6个月(含)	新股锁定	40.00	41.35	62	2,480.00	2,563.70	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1-6个月(含)	新股锁定	12.30	12.30	186	2,287.80	2,287.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1-6个月(含)	新股锁定	18.65	22.61	87	1,622.55	1,967.07	-
603310	巍华新材	2024-08-07	1-6个月(含)	新股锁定	17.39	17.95	98	1,704.22	1,759.10	-

注：

1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，

各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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，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上海浦东发展银行股份有限公司，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2024年12月31日，本基金无债券投资或资产支持证券投资(2023年12月31日：同)。

#### 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2024年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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上市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%。于2024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为0.08%。

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2024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银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 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	44,581,864.93	-	-	-	44,581,864.93
结算备付金	2,506,740.80	-	-	-	2,506,740.80
存出保证金	1,619,462.74	-	-	-	1,619,462.74
交易性金融资	-	-	-	213,852,071.10	213,852,071.10

产					
应收申 购款	-	-	-	37,578.78	37,578.78
资产总 计	48,708,068.47	-	-	213,889,649.88	262,597,718.35
负债					
应付清 算款	-	-	-	6,128,401.04	6,128,401.04
应付赎 回款	-	-	-	520,131.32	520,131.32
应付管 理人报 酬	-	-	-	202,845.80	202,845.80
应付托 管费	-	-	-	20,284.60	20,284.60
应付销 售服务 费	-	-	-	47,578.03	47,578.03
应交税 费	-	-	-	30,469.00	30,469.00
其他负 债	-	-	-	249,198.32	249,198.32
负债总 计	-	-	-	7,198,908.11	7,198,908.11
利率敏 感度缺 口	48,708,068.47	-	-	206,690,741.77	255,398,810.24
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	17,733,145.33	-	-	-	17,733,145.33
结算备付金	365,682.55	-	-	-	365,682.55
存出保证金	46,203.65	-	-	-	46,203.65
交易性金融资产	-	-	-	194,644,647.83	194,644,647.83
应收清算款	-	-	-	2,127,655.51	2,127,655.51
应收申购款	-	-	-	365,133.35	365,133.35
资产总计	18,145,031.53	-	-	197,137,436.69	215,282,468.22
负债					
应付清算款	-	-	-	1,050,084.39	1,050,084.39
应付赎回款	-	-	-	487,098.68	487,098.68
应付管理人报酬	-	-	-	178,495.80	178,495.80
应付托管费	-	-	-	17,849.58	17,849.58
应付销售服务费	-	-	-	46,208.23	46,208.23
其他负债	-	-	-	574,689.89	574,689.89
负债总计	-	-	-	2,354,426.57	2,354,426.57

利率敏感度缺口	18,145,031.53	-	-	194,783,010.12	212,928,041.65
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年12月31日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2023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(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。

本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制。

#### 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	213,852,071.10	83.73	194,644,647.83	91.41
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	213,852,071.10	83.73	194,644,647.83	91.41

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他变量保持不变		
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
	沪深300指数上升5%	11,447,682.58	9,168,921.41
	沪深300指数下降5%	-11,447,682.58	-9,168,921.41

#### 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	213,645,696.03	193,892,832.50
第二层次	22,878.00	-
第三层次	183,497.07	751,815.33
合计	213,852,071.10	194,644,647.83

#### 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	751,815.33	751,815.33
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	211,788.84	211,788.84
转出第三层次	-	662,635.42	662,635.42
当期利得或损失总额	-	-117,471.68	-117,471.68
其中：计入损益的利得或损失	-	-117,471.68	-117,471.68
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	183,497.07	183,497.07
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	-	108,571.72	108,571.72
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,541,195.79	1,541,195.79
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	944,551.78	944,551.78
转出第三层次	-	2,300,051.09	2,300,051.09
当期利得或损失总额	-	566,118.85	566,118.85
其中：计入损益的利得或损失	-	566,118.85	566,118.85
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	751,815.33	751,815.33
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	-	74,556.83	74,556.83

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
限售股票	183,497.07	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%~49.648%	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
限售股票	751,815.33	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%~21.9.88%	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**

于2024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资产(2023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**

截至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	213,852,071.10	81.44
	其中：股票	213,852,071.10	81.44
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	47,088,605.73	17.93
8	其他各项资产	1,657,041.52	0.63
9	合计	262,597,718.35	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,200,559.00	0.86
B	采矿业	13,119,282.00	5.14
C	制造业	120,968,182.06	47.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,841,644.00	3.07
E	建筑业	3,615,201.90	1.42
F	批发和零售业	1,603,120.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	5,868,291.39	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,238,658.00	2.83
J	金融业	43,197,852.40	16.91
K	房地产业	1,327,054.00	0.52
L	租赁和商务服务业	2,280,654.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	1,050,676.00	0.41
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	306,075.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	210,617,249.75	82.47

**8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	93,660.00	0.04
C	制造业	2,648,862.63	1.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	93,632.00	0.04
E	建筑业	147,486.00	0.06
F	批发和零售业	196,280.00	0.08
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	44,961.04	0.02
J	金融业	-	-
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	9,939.68	0.00
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	3,234,821.35	1.27

### 8.2.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	7,300	11,125,200.00	4.36
2	300750	宁德时代	25,500	6,783,000.00	2.66
3	601318	中国平安	112,900	5,944,185.00	2.33
4	000333	美的集团	64,500	4,851,690.00	1.90
5	601601	中国太保	131,600	4,484,928.00	1.76
6	600036	招商银行	103,900	4,083,270.00	1.60
7	600183	生益科技	155,800	3,746,990.00	1.47
8	600900	长江电力	115,100	3,401,205.00	1.33
9	601166	兴业银行	169,100	3,239,956.00	1.27
10	688041	海光信息	20,984	3,143,193.36	1.23
11	000858	五粮液	22,400	3,136,896.00	1.23
12	601138	工业富联	131,300	2,822,950.00	1.11
13	603501	韦尔股份	26,000	2,714,660.00	1.06
14	300308	中际旭创	21,600	2,667,816.00	1.04
15	600030	中信证券	82,500	2,406,525.00	0.94
16	600276	恒瑞医药	51,600	2,368,440.00	0.93
17	601899	紫金矿业	144,900	2,190,888.00	0.86
18	603993	洛阳钼业	307,700	2,046,205.00	0.80
19	002001	新和成	91,000	1,999,270.00	0.78

20	601688	华泰证券	112,900	1,985,911.00	0.78
21	601919	中远海控	128,100	1,985,550.00	0.78
22	002938	鹏鼎控股	53,600	1,955,328.00	0.77
23	002594	比亚迪	6,900	1,950,354.00	0.76
24	000725	京东方 A	438,500	1,925,015.00	0.75
25	601225	陕西煤业	81,400	1,893,364.00	0.74
26	300059	东方财富	72,920	1,882,794.40	0.74
27	601877	正泰电器	78,700	1,842,367.00	0.72
28	300760	迈瑞医疗	7,000	1,785,000.00	0.70
29	688008	澜起科技	25,637	1,740,752.30	0.68
30	601319	中国人保	226,300	1,724,406.00	0.68
31	601336	新华保险	33,100	1,645,070.00	0.64
32	605499	东鹏饮料	6,400	1,590,528.00	0.62
33	601088	中国神华	36,200	1,573,976.00	0.62
34	600809	山西汾酒	8,300	1,528,943.00	0.60
35	002371	北方华创	3,900	1,524,900.00	0.60
36	601689	拓普集团	30,900	1,514,100.00	0.59
37	600938	中国海油	51,100	1,507,961.00	0.59
38	688012	中微公司	7,900	1,494,364.00	0.59
39	605117	德业股份	17,300	1,467,040.00	0.57
40	300433	蓝思科技	66,100	1,447,590.00	0.57
41	600690	海尔智家	50,500	1,437,735.00	0.56
42	601169	北京银行	233,600	1,436,640.00	0.56
43	601633	长城汽车	54,500	1,434,985.00	0.56
44	601766	中国中车	169,200	1,417,896.00	0.56
45	601328	交通银行	180,000	1,398,600.00	0.55
46	000651	格力电器	30,600	1,390,770.00	0.54
47	000938	紫光股份	49,500	1,377,585.00	0.54
48	601607	上海医药	65,300	1,371,300.00	0.54
49	300498	温氏股份	80,900	1,335,659.00	0.52
50	600660	福耀玻璃	21,000	1,310,400.00	0.51



51	601857	中国石油	146,200	1,307,028.00	0.51
52	600941	中国移动	10,900	1,287,944.00	0.50
53	601668	中国建筑	213,801	1,282,806.00	0.50
54	002027	分众传媒	181,800	1,278,054.00	0.50
55	000786	北新建材	40,900	1,239,679.00	0.49
56	601211	国泰君安	65,700	1,225,305.00	0.48
57	000568	泸州老窖	9,300	1,164,360.00	0.46
58	002475	立讯精密	28,500	1,161,660.00	0.45
59	601229	上海银行	124,100	1,135,515.00	0.44
60	300124	汇川技术	19,300	1,130,594.00	0.44
61	300274	阳光电源	15,300	1,129,599.00	0.44
62	600989	宝丰能源	66,800	1,124,912.00	0.44
63	600050	中国联通	210,500	1,117,755.00	0.44
64	688111	金山办公	3,800	1,088,282.00	0.43
65	002142	宁波银行	43,900	1,067,209.00	0.42
66	000977	浪潮信息	20,500	1,063,540.00	0.42
67	603288	海天味业	22,500	1,032,750.00	0.40
68	601816	京沪高铁	164,900	1,015,784.00	0.40
69	000596	古井贡酒	5,800	1,005,140.00	0.39
70	688981	中芯国际	10,610	1,003,918.20	0.39
71	603259	药明康德	17,700	974,208.00	0.38
72	600025	华能水电	102,300	972,873.00	0.38
73	600426	华鲁恒升	45,000	972,450.00	0.38
74	601989	中国重工	198,700	955,747.00	0.37
75	688036	传音控股	10,000	950,000.00	0.37
76	601628	中国人寿	22,500	943,200.00	0.37
77	600795	国电电力	203,000	929,740.00	0.36
78	600926	杭州银行	63,500	927,735.00	0.36
79	601998	中信银行	132,400	924,152.00	0.36
80	300628	亿联网络	23,880	921,768.00	0.36
81	601985	中国核电	87,500	912,625.00	0.36

82	002352	顺丰控股	22,500	906,750.00	0.36
83	600150	中国船舶	24,800	891,808.00	0.35
84	600887	伊利股份	29,100	878,238.00	0.34
85	002714	牧原股份	22,500	864,900.00	0.34
86	601988	中国银行	154,200	849,642.00	0.33
87	601800	中国交建	79,882	834,766.90	0.33
88	600031	三一重工	50,400	830,592.00	0.33
89	000063	中兴通讯	20,300	820,120.00	0.32
90	002916	深南电路	6,500	812,500.00	0.32
91	600436	片仔癀	3,700	793,650.00	0.31
92	601888	中国中免	11,700	784,017.00	0.31
93	001979	招商蛇口	75,800	776,192.00	0.30
94	300502	新易盛	6,600	762,828.00	0.30
95	002241	歌尔股份	28,600	738,166.00	0.29
96	002230	科大讯飞	15,200	734,464.00	0.29
97	601600	中国铝业	99,700	732,795.00	0.29
98	601898	中煤能源	60,100	732,018.00	0.29
99	600104	上汽集团	35,100	728,676.00	0.29
100	000975	山金国际	46,600	716,242.00	0.28
101	600893	航发动力	17,000	704,650.00	0.28
102	002648	卫星化学	37,100	697,109.00	0.27
103	600019	宝钢股份	92,700	648,900.00	0.25
104	603019	中科曙光	8,500	614,720.00	0.24
105	688271	联影医疗	4,683	591,931.20	0.23
106	600309	万华化学	8,200	585,070.00	0.23
107	603195	公牛集团	8,200	575,968.00	0.23
108	300999	金龙鱼	17,200	560,892.00	0.22
109	600958	东方证券	53,100	560,736.00	0.22
110	000895	双汇发展	20,300	526,988.00	0.21
111	000538	云南白药	8,500	509,575.00	0.20
112	600406	国电南瑞	20,100	506,922.00	0.20

113	601127	赛力斯	3,700	493,543.00	0.19
114	002311	海大集团	10,000	490,500.00	0.19
115	300033	同花顺	1,700	488,750.00	0.19
116	603986	兆易创新	4,500	480,600.00	0.19
117	600048	保利发展	53,300	472,238.00	0.18
118	600066	宇通客车	17,900	472,202.00	0.18
119	601136	首创证券	20,600	453,200.00	0.18
120	601390	中国中铁	68,200	435,798.00	0.17
121	600999	招商证券	22,700	434,932.00	0.17
122	601995	中金公司	12,900	434,601.00	0.17
123	601021	春秋航空	7,517	433,505.39	0.17
124	300442	润泽科技	8,300	431,268.00	0.17
125	002463	沪电股份	10,700	424,255.00	0.17
126	300418	昆仑万维	10,900	419,432.00	0.16
127	000425	徐工机械	52,000	412,360.00	0.16
128	601186	中国铁建	44,100	404,397.00	0.16
129	600760	中航沈飞	7,800	395,616.00	0.15
130	688256	寒武纪	600	394,800.00	0.15
131	002028	思源电气	5,400	392,580.00	0.15
132	601066	中信建投	15,100	388,825.00	0.15
133	600584	长电科技	9,500	388,170.00	0.15
134	301269	华大九天	3,100	375,410.00	0.15
135	002920	德赛西威	3,400	374,374.00	0.15
136	002179	中航光电	9,500	373,350.00	0.15
137	600886	国投电力	22,100	367,302.00	0.14
138	000166	申万宏源	68,400	365,940.00	0.14
139	000807	云铝股份	25,900	350,427.00	0.14
140	601728	中国电信	47,700	344,394.00	0.13
141	600111	北方稀土	16,100	341,642.00	0.13
142	003816	中国广核	82,100	339,073.00	0.13
143	600482	中国动力	13,800	337,686.00	0.13

144	600919	江苏银行	34,200	335,844.00	0.13
145	002050	三花智控	14,200	333,842.00	0.13
146	600600	青岛啤酒	4,100	331,772.00	0.13
147	601788	光大证券	18,000	325,980.00	0.13
148	000776	广发证券	20,000	324,200.00	0.13
149	600160	巨化股份	13,400	323,208.00	0.13
150	000408	藏格矿业	11,500	318,895.00	0.12
151	000792	盐湖股份	19,300	317,678.00	0.12
152	002422	科伦药业	10,500	314,265.00	0.12
153	300394	天孚通信	3,400	310,624.00	0.12
154	000338	潍柴动力	22,600	309,620.00	0.12
155	300015	爱尔眼科	23,100	306,075.00	0.12
156	601100	恒立液压	5,700	300,789.00	0.12
157	001965	招商公路	21,400	298,530.00	0.12
158	300661	圣邦股份	3,600	294,408.00	0.12
159	603369	今世缘	6,500	293,995.00	0.12
160	688126	沪硅产业	15,610	293,780.20	0.12
161	600674	川投能源	15,900	274,275.00	0.11
162	601006	大秦铁路	40,000	271,200.00	0.11
163	300832	新产业	3,800	269,230.00	0.11
164	601117	中国化学	32,400	268,596.00	0.11
165	600547	山东黄金	11,700	264,771.00	0.10
166	000999	华润三九	5,900	261,606.00	0.10
167	300014	亿纬锂能	5,500	257,070.00	0.10
168	600460	士兰微	9,700	252,394.00	0.10
169	600026	中远海能	21,700	251,720.00	0.10
170	300408	三环集团	6,400	246,464.00	0.10
171	002555	三七互娱	15,400	240,856.00	0.09
172	300450	先导智能	11,900	238,238.00	0.09
173	600489	中金黄金	19,500	234,585.00	0.09
174	000963	华东医药	6,700	231,820.00	0.09

175	000708	中信特钢	20,300	231,623.00	0.09
176	600585	海螺水泥	9,700	230,666.00	0.09
177	601059	信达证券	15,200	227,696.00	0.09
178	002459	晶澳科技	16,000	220,000.00	0.09
179	603296	华勤技术	3,100	219,945.00	0.09
180	600346	恒力石化	14,300	219,505.00	0.09
181	601398	工商银行	31,600	218,672.00	0.09
182	600415	小商品城	16,300	218,583.00	0.09
183	600028	中国石化	32,700	218,436.00	0.09
184	600089	特变电工	17,000	216,580.00	0.08
185	600161	天坛生物	10,400	213,200.00	0.08
186	603799	华友钴业	7,100	207,746.00	0.08
187	601881	中国银河	13,500	205,605.00	0.08
188	002601	龙佰集团	11,600	204,972.00	0.08
189	600741	华域汽车	11,600	204,276.00	0.08
190	601878	浙商证券	16,500	201,960.00	0.08
191	000157	中联重科	27,900	201,717.00	0.08
192	002049	紫光国微	3,000	193,110.00	0.08
193	688506	百利天恒	1,000	191,730.00	0.08
194	000001	平安银行	16,000	187,200.00	0.07
195	600372	中航机载	15,000	184,950.00	0.07
196	002007	华兰生物	10,800	181,980.00	0.07
197	600188	兖矿能源	12,700	179,959.00	0.07
198	600845	宝信软件	6,000	175,560.00	0.07
199	002460	赣锋锂业	5,000	175,050.00	0.07
200	688396	华润微	3,700	174,603.00	0.07
201	600803	新奥股份	8,000	173,440.00	0.07
202	688472	阿特斯	13,700	172,072.00	0.07
203	600233	圆通速递	11,900	168,861.00	0.07
204	601872	招商轮船	26,100	167,301.00	0.07
205	603833	欧派家居	2,400	165,456.00	0.06

206	600018	上港集团	26,300	160,956.00	0.06
207	600027	华电国际	27,900	156,519.00	0.06
208	601838	成都银行	9,000	153,990.00	0.06
209	601618	中国中冶	45,800	151,140.00	0.06
210	600875	东方电气	9,300	147,777.00	0.06
211	601658	邮储银行	25,600	145,408.00	0.06
212	600085	同仁堂	3,500	142,065.00	0.06
213	600029	南方航空	21,600	140,184.00	0.05
214	600332	白云山	4,900	139,258.00	0.05
215	688169	石头科技	600	131,574.00	0.05
216	600061	国投资本	17,400	130,848.00	0.05
217	601669	中国电建	23,300	127,218.00	0.05
218	002236	大华股份	7,600	121,600.00	0.05
219	000617	中油资本	17,300	119,197.00	0.05
220	600905	三峡能源	27,200	118,864.00	0.05
221	000983	山西焦煤	14,200	117,008.00	0.05
222	300782	卓胜微	1,300	116,610.00	0.05
223	601799	星宇股份	800	106,784.00	0.04
224	688187	时代电气	2,150	103,028.00	0.04
225	600011	华能国际	15,200	102,904.00	0.04
226	688009	中国通号	16,180	101,286.80	0.04
227	601939	建设银行	11,400	100,206.00	0.04
228	600023	浙能电力	16,400	92,824.00	0.04
229	601868	中国能建	36,800	84,272.00	0.03
230	601699	潞安环能	5,600	80,416.00	0.03
231	600196	复星医药	3,200	79,520.00	0.03
232	600515	海南机场	20,800	78,624.00	0.03
233	300347	泰格医药	1,400	76,468.00	0.03
234	300979	华利集团	900	70,785.00	0.03
235	000768	中航西飞	2,400	67,776.00	0.03
236	000625	长安汽车	4,700	62,792.00	0.02

237	600570	恒生电子	2,200	61,578.00	0.02
238	300316	晶盛机电	1,900	60,610.00	0.02
239	002304	洋河股份	700	58,471.00	0.02
240	601901	方正证券	7,000	58,310.00	0.02
241	601808	中海油服	3,700	56,425.00	0.02
242	300896	爱美客	300	54,750.00	0.02
243	601238	广汽集团	5,200	48,568.00	0.02
244	002271	东方雨虹	3,700	48,026.00	0.02
245	300413	芒果超媒	1,700	45,713.00	0.02
246	601111	中国国航	5,300	41,923.00	0.02
247	002415	海康威视	1,100	33,770.00	0.01
248	603260	合盛硅业	500	27,780.00	0.01
249	600745	闻泰科技	700	27,146.00	0.01
250	600039	四川路桥	3,600	26,208.00	0.01
251	600377	宁沪高速	1,700	26,027.00	0.01
252	688082	盛美上海	200	20,000.00	0.01
253	000661	长春高新	200	19,888.00	0.01
254	002180	纳思达	600	16,902.00	0.01
255	601377	兴业证券	2,600	16,276.00	0.01
256	601236	红塔证券	1,700	14,433.00	0.01
257	601698	中国卫通	700	14,280.00	0.01

### 8.3.2 期末积极投资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	688120	华海清科	3,990	650,330.10	0.25
2	600872	中炬高新	19,800	435,996.00	0.17
3	603129	春风动力	1,600	251,312.00	0.10
4	000034	神州数码	5,600	196,280.00	0.08

5	688072	拓荆科技	1,254	192,702.18	0.08
6	300346	南大光电	4,300	165,937.00	0.06
7	002389	航天彩虹	8,900	160,645.00	0.06
8	600771	广誉远	7,600	143,336.00	0.06
9	002396	星网锐捷	5,600	106,344.00	0.04
10	002145	中核钛白	23,600	100,064.00	0.04
11	600667	太极实业	14,100	97,572.00	0.04
12	600988	赤峰黄金	6,000	93,660.00	0.04
13	000690	宝新能源	20,900	93,632.00	0.04
14	300457	赢合科技	4,800	91,872.00	0.04
15	002151	北斗星通	3,400	90,236.00	0.04
16	000547	航天发展	11,900	86,989.00	0.03
17	603929	亚翔集成	1,800	49,914.00	0.02
18	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.02
19	688726	拉普拉斯	843	27,869.58	0.01
20	688449	联芸科技	874	25,730.56	0.01
21	603072	天和磁材	1,860	22,878.00	0.01
22	688750	金天钛业	1,440	22,233.60	0.01
23	002292	奥飞娱乐	2,500	21,625.00	0.01
24	688615	合合信息	116	19,230.48	0.01
25	688721	龙图光罩	251	14,269.35	0.01
26	688710	益诺思	296	9,939.68	0.00
27	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
28	603194	中力股份	171	4,810.23	0.00
29	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
30	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
31	603391	力聚热能	62	2,563.70	0.00
32	603285	键邦股份	87	1,967.07	0.00
33	603310	巍华新材	98	1,759.10	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	601318	中国平安	6,037,949.00	2.84
2	600426	华鲁恒升	4,801,082.00	2.25
3	603501	韦尔股份	4,625,093.00	2.17
4	603993	洛阳钼业	4,571,712.00	2.15
5	688012	中微公司	4,413,162.33	2.07
6	000157	中联重科	4,099,322.00	1.93
7	601166	兴业银行	4,067,497.00	1.91
8	688008	澜起科技	3,979,288.27	1.87
9	600989	宝丰能源	3,966,495.00	1.86
10	000338	潍柴动力	3,686,765.00	1.73
11	601800	中国交建	3,398,652.64	1.60
12	600406	国电南瑞	3,314,861.00	1.56
13	000538	云南白药	3,311,074.20	1.56
14	600183	生益科技	3,278,371.00	1.54
15	300308	中际旭创	3,243,123.00	1.52
16	601088	中国神华	3,161,303.00	1.48
17	600660	福耀玻璃	3,002,273.00	1.41
18	601766	中国中车	2,938,419.00	1.38
19	000786	北新建材	2,902,578.00	1.36
20	600887	伊利股份	2,852,917.00	1.34

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

**8.4.2 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	000338	潍柴动力	5,180,380.00	2.43
2	688012	中微公司	4,954,628.27	2.33
3	000538	云南白药	4,870,996.00	2.29
4	688036	传音控股	4,606,905.98	2.16
5	600036	招商银行	4,544,383.00	2.13
6	601998	中信银行	3,925,566.00	1.84
7	300760	迈瑞医疗	3,884,455.00	1.82
8	601899	紫金矿业	3,775,884.00	1.77
9	000157	中联重科	3,755,230.00	1.76
10	600887	伊利股份	3,702,741.00	1.74
11	600023	浙能电力	3,460,310.00	1.63
12	600362	江西铜业	3,456,287.00	1.62
13	601766	中国中车	3,352,823.00	1.57
14	600426	华鲁恒升	3,345,924.00	1.57
15	300433	蓝思科技	3,258,884.00	1.53
16	601728	中国电信	3,177,599.00	1.49
17	688008	澜起科技	3,164,420.02	1.49
18	600519	贵州茅台	3,057,176.00	1.44
19	601800	中国交建	3,019,718.00	1.42
20	600406	国电南瑞	2,964,088.00	1.39

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

#### 8.4.3 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	425,288,478.03
卖出股票收入（成交）总额	429,468,742.44

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

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

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。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货仅为占比低的辅助投资手段，并严格遵循基金合同和套保要求。投资股指期货时以套期保值为目的，在投资组合管理中谨慎持有少量流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提升组合的投资效率和流动性，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 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受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行、中国太保、兴业银行在报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚。

基于对上述主体发行的相关证券的投资决策流程均符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期内没有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 基金投资的前十名股票没有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	1,619,462.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,578.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,657,041.52

**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**

**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

**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，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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占 总 份 额 比 例	持有份额	占 总 份 额 比 例
汇安 沪深3 00增 强A	8,9 17	8,080.94	15,382,062.81	21.3 5%	56,675,654.43	78.65%
汇安 沪深3 00增 强C	15, 762	8,052.19	48,006,553.00	37.8 2%	78,912,081.21	62.18%
合计	24, 357	8,169.16	63,388,615.81	31.8 6%	135,587,735.64	68.14%

**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	汇安沪深300增 强A	10.76	0.0000%
	汇安沪深300增 强C	85.16	0.0001%
	合计	95.92	0.0000%

**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	汇安沪深300增强A	0~10
	汇安沪深300增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	汇安沪深300增强A	0
	汇安沪深300增强C	0

	合计	0
--	----	---

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

无

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
基金合同生效日(2018年07月03日)基金份额总额	453,804.07	2,522,567.55
本报告期期初基金份额总额	62,432,126.37	125,249,483.70
本报告期基金总申购份额	26,781,674.19	78,555,109.70
减：本报告期基金总赎回份额	17,156,083.32	76,885,959.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	72,057,717.24	126,918,634.21

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**§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**

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期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**

本报告期内无涉及本基金管理人、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**

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金的管理人于2024年9月14日发布《汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》，改聘容诚会计师事务所（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容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用35,000.00元。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

**11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金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**

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

**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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	217,260,531.47	25.47%	76,049.11	18.08%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	574,173,901.04	67.31%	333,170.96	79.20%	-
湘财	2	-	-	-	-	-

证券						
中信建投证券	2	61,566,148.06	7.22%	11,446.57	2.72%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- 1、综合实力较强、市场信誉良好；
- 2、财务状况良好，经营状况稳健；
- 3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；
- 5、具有佣金费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- 6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

(2) 选择程序

- 1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- 2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内新增交易单元:长江证券1个、国投证券1个,退租交易单元:东北证券2个。

2、自2024年7月1日起，基金管理人旗下公募基金执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的相关规定。

**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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证成交总额的	成交金额	占当期基金成交总额的



		比例		额的 比例		比例		比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	49,827.38	100.00%	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	152,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇安沪深300指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-01-20
2	汇安基金管理有限责任公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-01-26
3	汇安沪深300指数增强型证券投资基金2023年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-03-30
4	汇安沪深300指数增强型证券投资基金（2024年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-04-12
5	汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-04-12
6	汇安沪深300指数增强型证	规定报刊和/或公司网站	2024-04-20

	券投资基金2024年第1季度报告		
7	汇安基金管理有限责任公司关于系统维护的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-04-29
8	汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-06-19
9	汇安沪深300指数增强型证券投资基金2024年第2季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-07-19
10	汇安沪深300指数增强型证券投资基金2024年中期报告	规定报刊和/或公司网站	2024-08-31
11	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-09-14
12	汇安基金管理有限责任公司关于华南分公司营业场所变更的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
13	汇安沪深300指数增强型证券投资基金（2024年第2号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
14	汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
15	汇安沪深300指数增强型证券投资基金2024年第3季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-10-25
16	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-11-19

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- (3) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同
- (4) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金托管协议
- (5) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (7) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (8) 中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

二〇二五年三月三十一日