

# 安联中国精选混合型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：安联基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 27 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 9 月 3 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>15</b>
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44

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 .....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
13.1 备查文件目录 .....	62
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安联中国精选混合型证券投资基金	
基金简称	安联中国精选混合	
基金主代码	021981	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 09 月 03 日	
基金管理人	安联基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	128,832,124.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安联中国精选混合 A	安联中国精选混合 C
下属分级基金的交易代码	021981	021982
报告期末下属分级基金的份额总额	97,257,965.04 份	31,574,159.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和中长期稳定的资产增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、国家政策、市场因素等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，根据各类资产的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将依据对宏观经济政策、行业长期发展空间、行业景气度、行业竞争格局和行业估值比较的研究，结合产业政策变化与行业格局变化等事件，挖掘和配置具有投资机会的行业。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>6、国债期货投资策略</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债新综合指数全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与境内证券投资基</p>

	金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还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	安联基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	管江
	联系电话	021-38067000
	电子邮箱	customerservice@allianzgi.com.cn
客户服务电话	021-38917777	95566
传真	021-58598281	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 1108 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	沈良	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.allianzgi.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 期 25 楼
注册登记机构	安联基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

## § 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 9 月 3 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	
	安联中国精选混合 A	安联中国精选混合 C
本期已实现收益	44,063,539.17	22,082,871.79
本期利润	39,453,563.89	21,374,802.98
加权平均基金份额本期利润	0.2596	0.3015
本期加权平均净值利润率	21.00%	24.42%
本期基金份额净值增长率	18.20%	18.05%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
期末可供分配利润	17,705,071.94	5,699,158.42

期末可供分配基金份额利润	0.1820	0.1805
期末基金资产净值	114,963,036.98	37,273,317.63
期末基金份额净值	1.1820	1.1805
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	
基金份额累计净值增长率	18.20%	18.05%

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

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

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”指报告期最后一日，即 2024 年 12 月 31 日。

4、本基金合同于 2024 年 09 月 03 日生效，截止本报告期末，本基金成立未满一年。

## 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

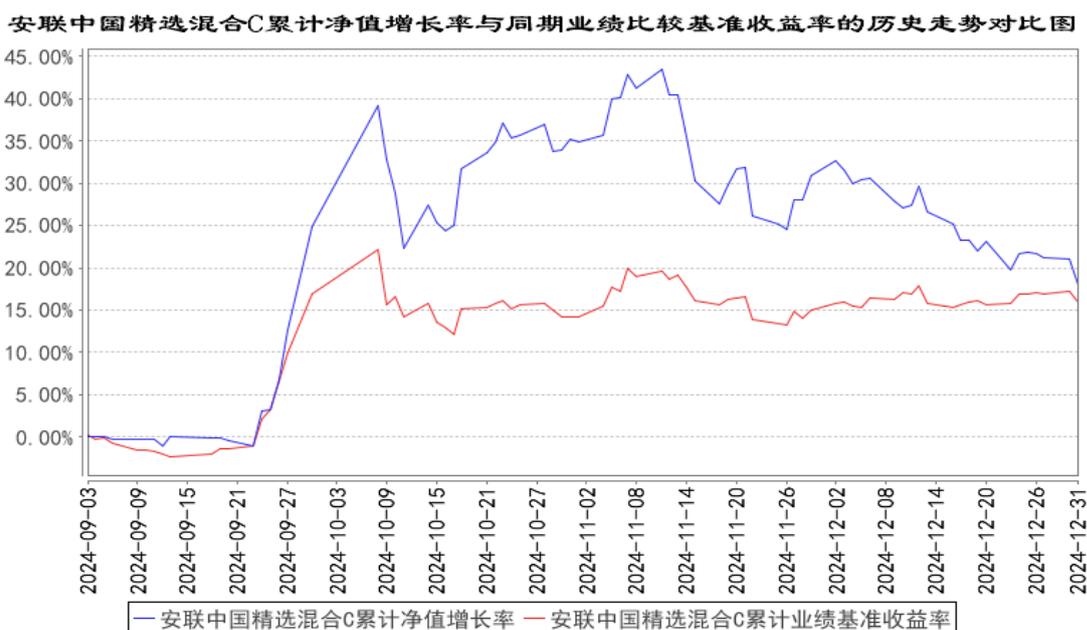
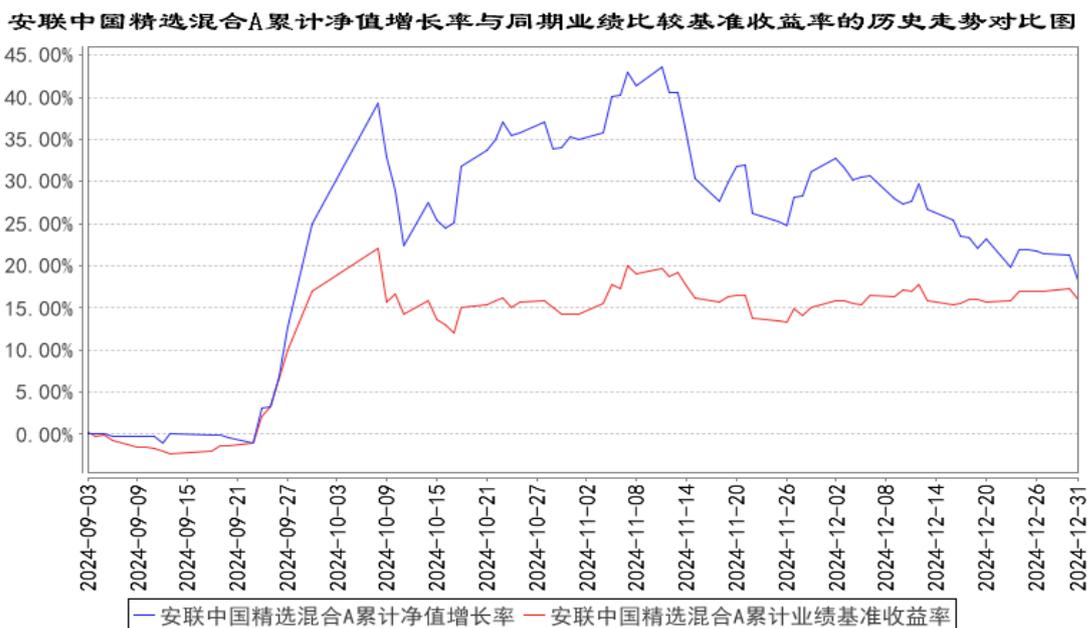
安联中国精选混合 A

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	-5.37%	2.52%	-0.83%	1.30%	-4.54%	1.22%
自基金合同生效起至今	18.20%	2.68%	15.94%	1.48%	2.26%	1.20%

安联中国精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.46%	2.52%	-0.83%	1.30%	-4.63%	1.22%
自基金合同生效起至今	18.05%	2.68%	15.94%	1.48%	2.11%	1.20%

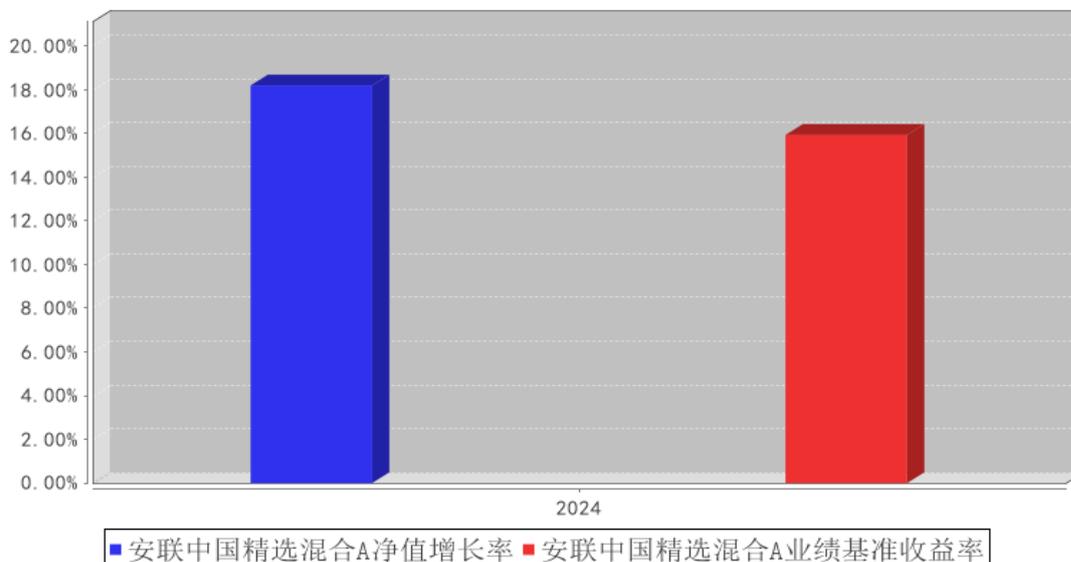
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



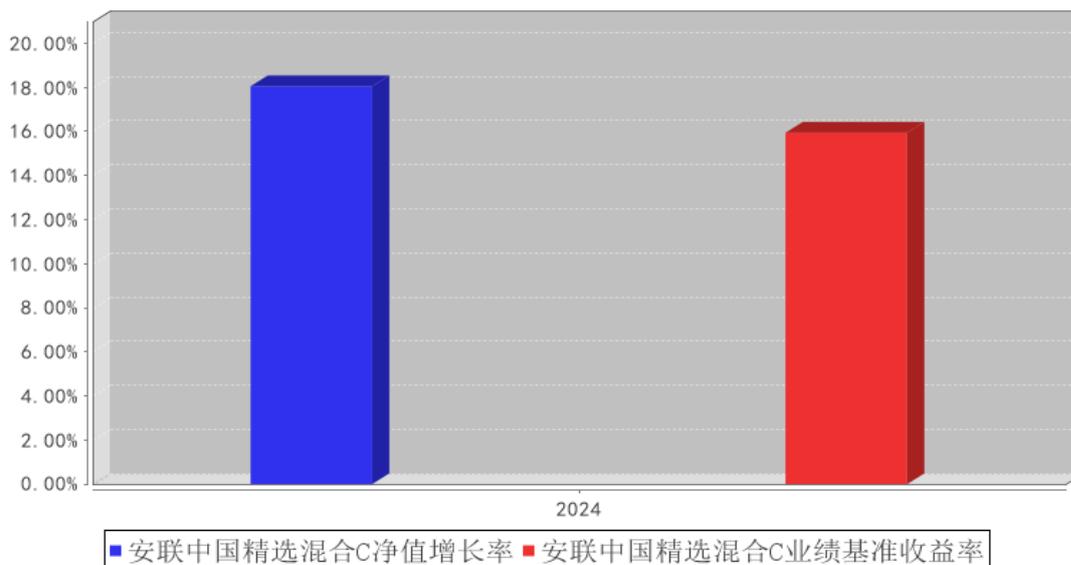
注：本基金合同于 2024 年 9 月 3 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；按照基金合同约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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

安联中国精选混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安联中国精选混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2024 年 9 月 3 日，合同生效当年按实际存续期（2024 年 9 月 3 日至 2024 年 12 月 31 日）计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2024年09月03日（基金合同生效日）至2024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

安联基金管理有限公司于 2023 年 8 月 23 日经中国证券监督管理委员会《关于核准设立安联基金管理有限公司的批复》（证监许可【2023】1888 号）批准设立，由安联投资有限公司（Allianz Global Investors GmbH）全资持有。截至报告期末，公司共管理 1 只公开募集证券投资基金：安联中国精选混合型证券投资基金。

#### 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		
程彧	本基金的基金经理、研究部总经理	2024 年 9 月 3 日	-	18 年	程彧先生，研究部总经理，特许金融分析师（CFA），上海复旦大学国际经济专业学士，加拿大英属哥伦比亚大学国际工商管理硕士。于 2023 年 3 月加入安联投资，2024 年 9 月起担任安联中国精选混合型证券投资基金基金经理。程彧先生曾任毕马威华振会计师事务所助理审计经理，摩根士丹利房地产基金投资经理，汇丰晋信基金管理有限公司国际业务及战略伙伴部副总监、国际业务部总监、海外投资部总监、基金经理等职位，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司基金公司筹备组成员。

注：1、基金经理的任职日期及离任日期指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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投资基金法》等有关法律法规的规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在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

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《安联基

金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制公平交易执行。本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制要求总体执行情况良好，所管理投资组合不存在非公平交易或利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合不存在参与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的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

## 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

2024 年，A 股市场经历了较大波动，最终沪深 300 指数全年录得近 15% 的上涨。市场波动背后的主要影响因素包括，宏观经济增长与企业盈利增长的挑战和地缘政治风险的扰动。但是，我们也欣喜地看到，在全球科技变革发展背景下的中国经济加速转型和中国资本市场走向高质量发展背景下的上市公司治理改善，均获得了市场的积极认可。因此，从市场风格来看，红利资产与优质成长资产均有较好表现。从全年行业表现来看，大金融、家电、通信等行业涨幅领先，而医药、消费(包括食品饮料、消费者服务等)、农林牧渔等行业表现落后。

在基金的投资运作方面，我们在 9 月基金成立之初就完成了快速建仓。在基金成立之后，我们做了仓位的动态调整，并且在年末保持了高仓位。在全球科技变革发展、中国经济深入转型、国内资本市场高质量发展，国债利率下行的大背景下，我们围绕高股息资产以及优质成长资产做了重点配置。

### 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 1.1820 元，本报告期内净值增长率 18.20%，同期业绩比较基准收益率 15.94%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.1805 元，本报告期内净值增长率 18.05%，同期业绩比较基准收益率 15.94%。

## 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 年全年，我们仍然看好 A 股市场在企业盈利增长和政策组合拳的支持下延续震荡向上的态势。值得注意的是，虽然中国宏观经济增长仍然面临挑战，但经济转型正在加速、资本市

场也在不断强化上市公司治理与股东回报，因此中国股票有望获得系统性的估值修复。当然，市场上涨的过程不可避免地将伴随波动，短期宏观经济增长压力、地缘政治风险、甚至对于经济政策的过高预期都可能成为短期扰动因素。

从大类资产战略配置的角度，我们认为当前 A 股相对于人民币债券的吸引力更大，因此我们将总体维持对股票的超配，但将根据市场情况动态调整超配幅度。在风格/策略方面，全年我们将继续重点配置高股息资产与优质成长资产(但会在不同阶段有所侧重)，亦将阶段性重点配置企业盈利有望超预期的资产。在行业方面，全年我们主要看好高股息资产相关的银行、电信运营商、上游资源品等行业，优质成长资产中分布相对较多的 TMT、新型机械设备、新消费(尤其是服务消费)、新材料和国防军工等行业。

#### 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相关法律法规，持续加强内部监察稽核工作，增强自我约束能力，有效防范风险，促使公司业务规范、持续、稳定发展。

公司制定了一系列内控制度，建立了有效运行的合规管理机制并持续进行优化。公司及时跟踪法律法规更新与监管动态，完善各项内部管理制度和业务流程。开展形式多样的合规培训，助力员工深入理解各类法律法规及监管要求，营造全员合规的经营环境。

公司建立了架构清晰、系统全面、切实可行的风险管理体系，尽力保障公司发展战略和经营目标的顺利实现，维护投资人、公司股东及公司的合法权益，保证基金财产和公司财产的安全完整。

公司定期和不定期地开展内部检查工作，对公司业务开展过程中的遵规守法情况以及公司内部控制制度的实施和落实情况进行监督。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安联中国精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 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	毕马威华振审字第 2501743 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	安联中国精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的安联中国精选混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相

	<p>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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间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（以下简称“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，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人安联基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 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。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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</p>

	<p>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) 评价该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) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	虞京京 朱伊俐
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2025年3月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安联中国精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日
资产：		

货币资金	7.4.7.1	4,331,492.32
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	148,787,483.76
其中：股票投资		144,051,004.03
基金投资		-
债券投资		4,736,479.73
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		-
应收股利		-
应收申购款		613,669.87
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		153,732,645.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>
<b>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		513,466.76
应付赎回款		615,925.15
应付管理人报酬		195,759.04
应付托管费		32,626.49
应付销售服务费		17,683.79
应付投资顾问费		-
应交税费		315.28
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	120,514.83
负债合计		1,496,291.34
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	128,832,124.25
未分配利润	7.4.7.8	23,404,230.36
净资产合计		152,236,354.61
负债和净资产总计		153,732,645.95

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 128,832,124.25 份，其中 A 类基金份额净值 1.1820 元，基金份额 97,257,965.04 份；C 类基金份额净值 1.1805 元，基金份额 31,574,159.21

份。

2、本基金基金合同于 2024 年 09 月 03 日生效，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：安联中国精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 9 月 3 日（基金合同 生效日）至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		62,326,327.49
1. 利息收入		67,981.89
其中：存款利息收入	7.4.7.9	9,775.02
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		58,206.87
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		67,328,576.77
其中：股票投资收益	7.4.7.10	66,856,599.56
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	118,307.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	353,669.49
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-5,318,044.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	247,812.92
<b>减：二、营业总支出</b>		1,497,960.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,080,222.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	180,037.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	114,706.18
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		174.61

8. 其他费用	7.4.7.18	122,820.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,828,366.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,828,366.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		60,828,366.87

注：本基金基金合同于 2024 年 09 月 03 日生效，无上年度可比期间数据。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：安联中国精选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	250,100,285.38	-	250,100,285.38
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-121,268,161.13	23,404,230.36	-97,863,930.77
（一）、综合收益总额	-	60,828,366.87	60,828,366.87
（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）	-121,268,161.13	-37,424,136.51	-158,692,297.64
其中：1. 基金申购款	4,112,894.04	1,141,110.40	5,254,004.44
2. 基金赎回款	-125,381,055.17	-38,565,246.91	-163,946,302.08
（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	128,832,124.25	23,404,230.36	152,236,354.61

注：本基金基金合同于 2024 年 09 月 03 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>沈良</u>	<u>罗瑞宏</u>	<u>龚伟婷</u>
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

安联中国精选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[2024]1102号《关于准予安联中国精选混合型证券投资基金注册的批复》注册，由安联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《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 250,049,174.34 元。经向中国证监会备案，《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 9 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 250,100,285.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,111.04 份基金份额。本基金的基金管理人为安联基金管理有限公司（以下简称“安联基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》和《安联中国精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用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。在投资人认购/申购时收取认购/申购费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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》及其配套规则和《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券），衍生品（包括股指期货、国债期货），资产支持证券，货币市场工具，同业存单，债券回购，银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）

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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债新综合指数全价（总值）指数收益率×25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、自 2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分

类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

### 7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

#### - 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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、赎回和分红再投资引起的实收基金份额变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入

未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《安联中国精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对各类基金份额选择不同的分红方式，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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。同一类别每一基金份额享有同等分配权；由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。法律法规或监管机关另有规定的，从其规

定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人会在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 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。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

## 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税 [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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《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》、中投信 [2021] 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部、税务总局、中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税 [2014] 81 号《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 [2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税

务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、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。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 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
活期存款	2,149,719.52
等于：本金	2,149,581.08
加：应计利息	138.44
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	2,181,772.80
等于：本金	2,181,464.63
加：应计利息	308.17
减：坏账准备	-
合计	4,331,492.32

注：其他存款本期末余额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 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	149,381,215.09	-	144,051,004.03	-5,330,211.06	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,696,293.03	28,019.73	4,736,479.73	12,166.97
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,696,293.03	28,019.73	4,736,479.73	12,166.97
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	154,077,508.12	28,019.73	148,787,483.76	-5,318,044.09	

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	514.83
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	-
应付利息	-
预提费用-审计费	45,000.00
预提费用-信息披露费	75,000.00
合计	120,514.83

### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

#### 安联中国精选混合 A

项目	本期 2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	167,767,436.47	167,767,436.47
本期申购	2,829,475.07	2,829,475.07
本期赎回（以“-”号填列）	-73,338,946.50	-73,338,946.50
本期末	97,257,965.04	97,257,965.04

#### 安联中国精选混合 C

项目	本期 2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	82,332,848.91	82,332,848.91

本期申购	1,283,418.97	1,283,418.97
本期赎回(以“-”号填列)	-52,042,108.67	-52,042,108.67
本期末	31,574,159.21	31,574,159.21

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额（如适用）。

2、本基金合同于 2024 年 09 月 03 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 250,100,285.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,111.04 份基金份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 安联中国精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	44,063,539.17	-4,609,975.28	39,453,563.89
本期基金份额交易产生的变动数	-20,160,217.47	-1,588,274.48	-21,748,491.95
其中：基金申购款	810,612.74	-16,990.20	793,622.54
基金赎回款	-20,970,830.21	-1,571,284.28	-22,542,114.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,903,321.70	-6,198,249.76	17,705,071.94

##### 安联中国精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,082,871.79	-708,068.81	21,374,802.98
本期基金份额交易产生的变动数	-14,375,542.21	-1,300,102.35	-15,675,644.56
其中：基金申购款	358,088.56	-10,600.70	347,487.86
基金赎回款	-14,733,630.77	-1,289,501.65	-16,023,132.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,707,329.58	-2,008,171.16	5,699,158.42

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,955.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,148.84
结算备付金利息收入	-
其他	670.84
合计	9,775.02

注：1、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产生的利息收入。

2、其他为认购款利息收入。

#### 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 2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年 12月31日
卖出股票成交总额	1,601,397,670.45
减：卖出股票成本总额	1,531,661,588.07
减：交易费用	2,879,482.82
买卖股票差价收入	66,856,599.56

#### 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9月3日（基金合同生效日）至2024年12 月31日
债券投资收益——利息收入	74,344.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43,962.99
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	118,307.72

##### 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9月3日（基金合同生效日）至2024年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	121,391,597.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	120,512,232.97
减：应计利息总额	811,404.42
减：交易费用	23,997.04
买卖债券差价收入	43,962.99

##### 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**

本基金本报告期内无债券投资收益—申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 衍生工具收益****7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	353,669.49
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	353,669.49

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,318,044.09
股票投资	-5,330,211.06
债券投资	12,166.97
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	-5,318,044.09

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年9月3日（基金合同生效日）至2024

	年 12 月 31 日
基金赎回费收入	247,812.92
合计	247,812.92

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00
信息披露费	75,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,575.32
开户费	400.00
证券组合费	844.79
合计	122,820.11

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
安联基金	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
安联投资有限公司	基金管理人的股东
安联环球投资亚太有限公司（以下简称“安联环球投资亚太”）	与基金管理人存在其他重大利害关系的关联方

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,080,222.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	375,768.66
应支付基金管理人的净管理费	704,453.93

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年9月3日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	180,037.13

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期

获得销售服务费的各关联方名称	2024 年 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安联中国精选混合 A	安联中国精选混合 C	合计
中国银行	-	50,044.26	50,044.26
合计	-	50,044.26	50,044.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2024 年 09 月 03 日，无上年度同期对比数据。

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

份额单位：份

安联中国精选混合 A

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)

安联环球投资亚太	60,012,485.00	61.70
----------	---------------	-------

注：1、本基金合同生效日为 2024 年 09 月 03 日，无上年度同期对比数据。

2、本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资安联中国精选混合 C。

#### 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 9 月 3 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,149,719.52	2,955.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内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（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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证券出借业务的证券。

## 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

本基金管理人制定了政策和程序来识别、分析和管理基金在日常经营活动中涉及的各类风险，并设定适当的风险限额和内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控各类风险。本基金管理人建立了由董事会及其下设的风险控制与审计委员会、监事、管理层、风险管理委员会、督察长、法务部、合规部、风险管理部以及各业务部门共同组成的全面风险管理架构体系，各部门和人员根据公司制度规定履行各自的风险管理职责，形成合作、制衡的风险管理机制。

### 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于信用良好的银行，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	4,736,479.73
合计	4,736,479.73

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

基金管理人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。基金管理人在本基金合同中设计了巨额赎回条款，约定对巨额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。

报告期内，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，所持有的大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力较强。此外，基金管理人通过对本基金的流动性指标进行持续的监测和分析，并建立流动性风险内部管控流程，确保本基金保持较好的流动性。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,331,492.32	-	-	-	4,331,492.32
交易性金融资产	4,736,479.73	-	-	-144,051,004.03	148,787,483.76
应收申购款	-	-	-	613,669.87	613,669.87
资产总计	9,067,972.05	-	-	-144,664,673.90	153,732,645.95
负债					
应付清算款	-	-	-	513,466.76	513,466.76
应付赎回款	-	-	-	615,925.15	615,925.15
应付管理人报酬	-	-	-	195,759.04	195,759.04
应付托管费	-	-	-	32,626.49	32,626.49
应付销售服务费	-	-	-	17,683.79	17,683.79
应交税费	-	-	-	315.28	315.28
其他负债	-	-	-	120,514.83	120,514.83
负债总计	-	-	-	1,496,291.34	1,496,291.34
利率敏感度缺口	9,067,972.05	-	-	-143,168,382.56	152,236,354.61

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占资产净值的比例为 3.11%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，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 2024年12月31日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	25,502,099.80	-	25,502,099.80
资产合计	-	25,502,099.80	-	25,502,099.80
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	-	25,502,099.80	-	25,502,099.80

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的外币资产占基金资产净值的比例为 16.75%，因此外币汇率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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证券，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，同时运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	144,051,004.03	94.62
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,736,479.73	3.11
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	148,787,483.76	97.73

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、基金的市场价格风险决定于基金相对沪深 300 的贝塔系数，以及沪深 300 指数的变动 2、除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	8,369,709.92
	沪深 300 指数下降 5%	-8,369,709.92

## 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；  
第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；  
第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 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
第一层次	144,051,004.03
第二层次	4,736,479.73
第三层次	-
合计	148,787,483.76

## 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可转换债券等，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,本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

于本报告期间,本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

#### 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

本基金本报告期内无第三层次公允价值余额及变动情况。

##### 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

本基金本报告期内无使用重要不可观察输入值计量的第三层次公允价值。

#### 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,本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 日,本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	144,051,004.03	93.70
	其中:股票	144,051,004.03	93.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,736,479.73	3.08
	其中:债券	4,736,479.73	3.08
	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	4,331,492.32	2.82

8	其他各项资产	613,669.87	0.40
9	合计	153,732,645.95	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 25,502,099.80 元，占期末基金资产净值比例为 16.75%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,260,816.00	2.80
C	制造业	74,801,730.11	49.14
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	1,891,576.00	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,950,245.12	5.88
J	金融业	18,704,835.00	12.29
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	6,206,952.00	4.08
N	水利、环境和公共设施管理业	3,732,750.00	2.45
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	118,548,904.23	77.87

### 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（%）
原材料	4,530,595.14	2.98
非日常生活消费品	6,766,185.34	4.44
日常消费品	970,374.17	0.64
能源	5,980,644.13	3.93
金融	1,650,018.07	1.08
医疗保健	2,433,633.12	1.60
通讯业务	3,170,649.83	2.08

合计	25,502,099.80	16.75
----	---------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688503	聚和材料	261,189	11,568,060.81	7.60
2	02899	紫金矿业	346,000	4,530,595.14	2.98
2	601899	紫金矿业	281,800	4,260,816.00	2.80
3	600600	青岛啤酒	75,900	6,141,828.00	4.03
4	600036	招商银行	145,600	5,722,080.00	3.76
5	00780	同程旅行	310,800	5,238,200.82	3.44
6	601336	新华保险	69,500	3,454,150.00	2.27
6	01336	新华保险	75,500	1,650,018.07	1.08
7	002085	万丰奥威	253,400	4,801,930.00	3.15
8	601077	渝农商行	792,900	4,797,045.00	3.15
9	601825	沪农商行	556,000	4,731,560.00	3.11
10	688981	中芯国际	49,340	4,668,550.80	3.07
11	00883	中国海洋石油	263,000	4,656,647.70	3.06
12	603199	九华旅游	110,600	3,732,750.00	2.45
13	002956	西麦食品	211,000	3,517,370.00	2.31
14	300750	宁德时代	13,100	3,484,600.00	2.29
15	300395	菲利华	90,400	3,399,944.00	2.23
16	300383	光环新网	228,800	3,338,192.00	2.19
17	001696	宗申动力	132,000	3,286,800.00	2.16
18	301091	深城交	65,700	3,134,547.00	2.06
19	300284	苏交科	302,700	3,072,405.00	2.02
20	00941	中国移动	33,000	2,340,843.91	1.54
20	600941	中国移动	6,000	708,960.00	0.47
21	688631	莱斯信息	33,568	2,923,437.12	1.92
22	300502	新易盛	23,900	2,762,362.00	1.81
23	002648	卫星化学	143,200	2,690,728.00	1.77
24	09995	荣昌生物	182,500	2,433,633.12	1.60
25	688559	海目星	69,052	2,375,388.80	1.56
26	000858	五粮液	14,800	2,072,592.00	1.36
27	600536	中国软件	42,400	1,979,656.00	1.30
28	688502	茂莱光学	9,737	1,961,031.80	1.29
29	600760	中航沈飞	38,400	1,947,648.00	1.28
30	002436	兴森科技	170,800	1,897,588.00	1.25
31	601021	春秋航空	32,800	1,891,576.00	1.24
32	600132	重庆啤酒	29,300	1,846,486.00	1.21
33	002508	老板电器	81,700	1,750,831.00	1.15

34	000521	长虹美菱	203,700	1,662,192.00	1.09
35	688122	西部超导	37,693	1,614,014.26	1.06
36	000768	中航西飞	55,600	1,570,144.00	1.03
37	300762	上海瀚讯	74,400	1,564,632.00	1.03
38	600893	航发动力	37,300	1,546,085.00	1.02
39	02020	安踏体育	21,000	1,513,936.49	0.99
40	300775	三角防务	60,400	1,505,772.00	0.99
41	300476	胜宏科技	32,300	1,359,507.00	0.89
42	00857	中国石油股份	234,000	1,323,996.43	0.87
43	688297	中无人机	28,463	1,146,489.64	0.75
44	600316	洪都航空	33,800	1,085,656.00	0.71
45	00291	华润啤酒	41,500	970,374.17	0.64
46	00728	中国电信	184,000	829,805.92	0.55
47	603556	海兴电力	12,000	443,880.00	0.29
48	300567	精测电子	6,400	411,520.00	0.27
49	688726	拉普拉斯	8,127	365,715.00	0.24
50	000400	许继电气	12,800	352,384.00	0.23
51	03690	美团-W	100	14,048.03	0.01

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688503	聚和材料	41,631,868.88	27.35
2	300308	中际旭创	24,637,673.00	16.18
3	00728	中国电信	23,394,964.88	15.37
4	002085	万丰奥威	21,035,169.00	13.82
5	300502	新易盛	20,709,777.00	13.60
6	001696	宗申动力	19,404,270.90	12.75
7	00941	中国移动	19,022,629.48	12.50
8	000400	许继电气	18,559,826.59	12.19
9	300394	天孚通信	18,529,741.40	12.17
10	600036	招商银行	17,773,825.00	11.68
11	300476	胜宏科技	15,781,165.00	10.37
12	688012	中微公司	14,680,837.55	9.64
13	600536	中国软件	14,073,329.80	9.24
14	688776	国光电气	14,015,337.80	9.21
15	688498	源杰科技	14,011,939.13	9.20
16	688256	寒武纪	13,947,308.47	9.16
17	301091	深城交	13,814,668.30	9.07
18	300395	菲利华	13,790,552.00	9.06

19	601825	沪农商行	13,465,640.00	8.85
20	03800	协鑫科技	13,387,301.39	8.79
21	06990	科伦博泰生物-B	13,315,788.89	8.75
22	688631	莱斯信息	13,313,359.60	8.75
23	688047	龙芯中科	13,009,938.73	8.55
24	688726	拉普拉斯	12,856,574.63	8.45
25	603256	宏和科技	12,655,995.00	8.31
26	002463	沪电股份	12,600,578.00	8.28
27	300212	易华录	12,497,393.00	8.21
28	688522	纳睿雷达	11,807,142.87	7.76
29	688559	海目星	11,232,034.30	7.38
30	002156	通富微电	11,071,650.91	7.27
31	002508	老板电器	10,902,190.00	7.16
32	300760	迈瑞医疗	10,863,090.37	7.14
33	002843	泰嘉股份	10,678,162.00	7.01
34	688629	华丰科技	10,675,075.48	7.01
35	000560	我爱我家	10,603,610.00	6.97
36	600602	云赛智联	10,430,527.00	6.85
37	02359	药明康德	10,398,340.76	6.83
38	300567	精测电子	10,358,597.00	6.80
39	02128	中国联塑	10,246,022.45	6.73
40	301155	海力风电	10,230,721.00	6.72
41	002966	苏州银行	10,148,486.00	6.67
42	000001	平安银行	10,130,982.00	6.65
43	300181	佐力药业	10,065,045.00	6.61
44	000099	中信海直	10,051,552.00	6.60
45	601166	兴业银行	9,931,644.00	6.52
46	600919	江苏银行	9,837,810.00	6.46
47	002142	宁波银行	9,724,064.74	6.39
48	000651	格力电器	9,619,425.00	6.32
49	000333	美的集团	9,599,112.00	6.31
50	002035	华帝股份	9,505,480.00	6.24
51	300558	贝达药业	9,343,414.00	6.14
52	688502	茂莱光学	9,098,069.92	5.98
53	688339	亿华通	8,905,648.26	5.85
54	688120	华海清科	8,547,866.55	5.61
55	03908	中金公司	8,490,010.47	5.58
56	601077	渝农商行	8,471,701.00	5.56
57	300785	值得买	8,470,946.50	5.56
58	03690	美团-W	8,445,814.02	5.55
59	002241	歌尔股份	8,430,397.60	5.54
60	300633	开立医疗	8,393,714.00	5.51
61	01658	邮储银行	8,298,098.18	5.45

62	300894	火星人	8,106,050.00	5.32
63	000066	中国长城	8,065,594.00	5.30
64	300762	上海瀚讯	8,063,856.00	5.30
65	002916	深南电路	7,911,746.00	5.20
66	605598	上海港湾	7,878,516.60	5.18
67	600316	洪都航空	7,655,795.00	5.03
68	603099	长白山	7,610,458.00	5.00
69	603228	景旺电子	7,521,157.00	4.94
70	601138	工业富联	7,377,883.00	4.85
71	300418	昆仑万维	7,364,704.30	4.84
72	600183	生益科技	7,359,180.00	4.83
73	002230	科大讯飞	7,357,678.00	4.83
74	601555	东吴证券	7,351,728.07	4.83
75	300624	万兴科技	7,346,416.97	4.83
76	600391	航发科技	7,341,006.00	4.82
77	00354	中国软件国际	7,333,225.65	4.82
78	601995	中金公司	7,233,474.00	4.75
79	603083	剑桥科技	7,228,620.00	4.75
80	688041	海光信息	7,068,654.67	4.64
81	01024	快手-W	7,063,683.95	4.64
82	601669	中国电建	7,063,409.00	4.64
83	603259	药明康德	7,036,101.00	4.62
84	688072	拓荆科技	7,034,756.60	4.62
85	601668	中国建筑	7,026,569.00	4.62
86	002941	新疆交建	6,872,362.00	4.51
87	601611	中国核建	6,751,479.00	4.43
88	300274	阳光电源	6,583,160.86	4.32
89	688627	精智达	6,557,615.71	4.31
90	600588	用友网络	6,536,973.00	4.29
91	09969	诺诚健华	6,515,056.40	4.28
92	00175	吉利汽车	6,510,773.36	4.28
93	600941	中国移动	6,460,563.00	4.24
94	000521	长虹美菱	6,324,943.00	4.15
95	09995	荣昌生物	6,256,479.46	4.11
96	03606	福耀玻璃	6,255,641.13	4.11
97	001270	铖昌科技	6,116,734.10	4.02
98	002409	雅克科技	5,993,667.00	3.94
99	01951	锦欣生殖	5,884,793.91	3.87
100	600600	青岛啤酒	5,812,936.00	3.82
101	002041	登海种业	5,777,483.00	3.80
102	00780	同程旅行	5,749,055.99	3.78
103	000998	隆平高科	5,709,729.00	3.75
104	002371	北方华创	5,700,436.00	3.74

105	000568	泸州老窖	5,694,325.68	3.74
106	300827	上能电气	5,689,652.00	3.74
107	002292	奥飞娱乐	5,684,497.00	3.73
108	688153	唯捷创芯	5,678,811.62	3.73
109	601881	中国银河	5,670,486.00	3.72
110	03968	招商银行	5,630,636.02	3.70
111	688027	国盾量子	5,630,210.00	3.70
112	300284	苏交科	5,623,118.00	3.69
113	000858	五粮液	5,594,882.00	3.68
114	601688	华泰证券	5,557,192.00	3.65
115	603199	九华旅游	5,453,790.00	3.58
116	000713	丰乐种业	5,442,069.00	3.57
117	002149	西部材料	5,428,520.00	3.57
118	605077	华康股份	5,313,793.96	3.49
119	300654	世纪天鸿	5,280,592.00	3.47
120	688270	臻镭科技	5,207,173.53	3.42
121	002956	西麦食品	5,159,868.40	3.39
122	300750	宁德时代	5,101,784.00	3.35
123	002444	巨星科技	5,010,519.96	3.29
124	002475	立讯精密	4,840,089.00	3.18
125	688981	中芯国际	4,753,880.44	3.12
126	601186	中国铁建	4,737,094.00	3.11
127	000733	振华科技	4,685,965.70	3.08
128	00762	中国联通	4,673,947.90	3.07
129	02899	紫金矿业	4,649,772.00	3.05
130	600820	隧道股份	4,633,715.00	3.04
131	601899	紫金矿业	4,626,693.00	3.04
132	300346	南大光电	4,605,301.82	3.03
133	00883	中国海洋石油	4,580,592.35	3.01
134	002920	德赛西威	4,513,587.40	2.96
135	300662	科锐国际	4,493,733.00	2.95
136	300033	同花顺	4,490,867.00	2.95
137	301061	匠心家居	4,487,938.00	2.95
138	300525	博思软件	4,456,045.80	2.93
139	601162	天风证券	4,411,616.00	2.90
140	601377	兴业证券	4,251,944.00	2.79
141	00300	美的集团	4,243,507.64	2.79
142	688220	翱捷科技	4,190,172.18	2.75
143	00981	中芯国际	4,179,783.50	2.75
144	601179	中国西电	4,136,061.00	2.72
145	601800	中国交建	4,121,631.00	2.71
146	688331	荣昌生物	4,072,293.71	2.67
147	600893	航发动力	4,033,232.00	2.65

148	03328	交通银行	3,979,960.42	2.61
149	300100	双林股份	3,959,255.00	2.60
150	600559	老白干酒	3,867,495.00	2.54
151	688326	经纬恒润	3,781,088.00	2.48
152	601066	中信建投	3,743,804.00	2.46
153	300628	亿联网络	3,728,326.00	2.45
154	300260	新莱应材	3,689,594.60	2.42
155	600958	东方证券	3,683,548.00	2.42
156	300782	卓胜微	3,654,502.00	2.40
157	601336	新华保险	3,646,956.00	2.40
158	688692	达梦数据	3,639,881.86	2.39
159	605117	德业股份	3,626,855.00	2.38
160	300316	晶盛机电	3,624,361.00	2.38
161	002120	韵达股份	3,611,367.00	2.37
162	000032	深桑达 A	3,605,107.00	2.37
163	300430	诚益通	3,593,447.00	2.36
164	603596	伯特利	3,575,299.00	2.35
165	300783	三只松鼠	3,525,935.00	2.32
166	688798	艾为电子	3,519,098.33	2.31
167	300383	光环新网	3,457,146.00	2.27
168	000063	中兴通讯	3,448,567.00	2.27
169	002025	航天电器	3,402,725.00	2.24
170	600282	南钢股份	3,376,692.00	2.22
171	000776	广发证券	3,356,598.00	2.20
172	002869	金溢科技	3,353,695.00	2.20
173	603357	设计总院	3,313,762.00	2.18
174	00268	金蝶国际	3,254,505.80	2.14
175	688048	长光华芯	3,251,980.41	2.14
176	688082	盛美上海	3,247,500.44	2.13
177	688489	三未信安	3,241,601.45	2.13
178	002468	申通快递	3,213,884.00	2.11
179	601528	瑞丰银行	3,192,119.50	2.10
180	002385	大北农	3,172,959.00	2.08
181	002837	英维克	3,086,499.70	2.03
182	603977	国泰集团	3,046,222.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688503	聚和材料	34,651,599.13	22.76
2	300308	中际旭创	28,537,678.20	18.75
3	00728	中国电信	22,378,487.38	14.70

4	001696	宗申动力	20,576,745.00	13.52
5	300476	胜宏科技	18,257,907.50	11.99
6	688498	源杰科技	18,131,792.85	11.91
7	000400	许继电气	18,119,326.00	11.90
8	002085	万丰奥威	17,853,796.00	11.73
9	300394	天孚通信	17,603,246.00	11.56
10	300502	新易盛	17,277,712.00	11.35
11	688256	寒武纪	16,490,623.56	10.83
12	00941	中国移动	16,436,625.46	10.80
13	300212	易华录	16,354,681.32	10.74
14	688012	中微公司	15,331,192.91	10.07
15	688776	国光电气	14,687,344.99	9.65
16	002463	沪电股份	14,490,079.30	9.52
17	603256	宏和科技	13,948,411.00	9.16
18	688047	龙芯中科	13,815,975.16	9.08
19	688631	莱斯信息	13,359,405.47	8.78
20	06990	科伦博泰生物-B	13,160,049.20	8.64
21	301091	深城交	12,604,161.50	8.28
22	600536	中国软件	12,147,495.28	7.98
23	03800	协鑫科技	12,060,744.15	7.92
24	600036	招商银行	12,058,072.00	7.92
25	688522	纳睿雷达	11,976,188.27	7.87
26	000560	我爱我家	11,470,697.90	7.53
27	002156	通富微电	11,464,908.45	7.53
28	301155	海力风电	11,224,317.00	7.37
29	688726	拉普拉斯	11,154,798.48	7.33
30	300624	万兴科技	11,108,715.26	7.30
31	600602	云赛智联	11,029,477.00	7.24
32	000099	中信海直	11,016,840.00	7.24
33	300418	昆仑万维	10,791,419.00	7.09
34	002843	泰嘉股份	10,658,395.12	7.00
35	300760	迈瑞医疗	10,585,813.00	6.95
36	000001	平安银行	9,957,456.00	6.54
37	002035	华帝股份	9,915,252.00	6.51
38	300181	佐力药业	9,900,931.00	6.50
39	300558	贝达药业	9,785,541.00	6.43
40	002142	宁波银行	9,711,414.00	6.38
41	600919	江苏银行	9,669,188.00	6.35
42	002966	苏州银行	9,637,569.80	6.33
43	02359	药明康德	9,624,456.88	6.32
44	688629	华丰科技	9,558,746.25	6.28
45	000333	美的集团	9,556,515.00	6.28
46	02128	中国联塑	9,528,061.08	6.26

47	601166	兴业银行	9,424,972.00	6.19
48	002230	科大讯飞	9,362,636.50	6.15
49	300567	精测电子	9,321,898.00	6.12
50	601138	工业富联	9,320,790.00	6.12
51	300395	菲利华	8,914,122.00	5.86
52	000651	格力电器	8,888,900.00	5.84
53	03690	美团-W	8,689,800.33	5.71
54	002508	老板电器	8,664,135.00	5.69
55	601825	沪农商行	8,548,368.00	5.62
56	300785	值得买	8,502,236.00	5.58
57	603228	景旺电子	8,497,503.72	5.58
58	002241	歌尔股份	8,363,552.00	5.49
59	000066	中国长城	8,283,227.00	5.44
60	688120	华海清科	8,268,007.93	5.43
61	300633	开立医疗	8,035,504.00	5.28
62	688339	亿华通	8,024,114.29	5.27
63	00354	中国软件国际	7,992,443.58	5.25
64	600183	生益科技	7,969,770.00	5.24
65	002916	深南电路	7,957,881.00	5.23
66	03908	中金公司	7,954,218.36	5.22
67	01658	邮储银行	7,906,382.42	5.19
68	09969	诺诚健华	7,889,194.44	5.18
69	605598	上海港湾	7,845,755.40	5.15
70	600316	洪都航空	7,754,962.00	5.09
71	688559	海目星	7,715,303.03	5.07
72	300894	火星人	7,637,233.00	5.02
73	01024	快手-W	7,635,349.84	5.02
74	002941	新疆交建	7,607,874.00	5.00
75	600391	航发科技	7,355,285.00	4.83
76	601555	东吴证券	7,318,608.00	4.81
77	603099	长白山	7,121,238.00	4.68
78	600588	用友网络	7,117,923.00	4.68
79	601995	中金公司	7,111,570.00	4.67
80	00175	吉利汽车	7,090,228.00	4.66
81	601611	中国核建	6,923,190.00	4.55
82	601669	中国电建	6,889,742.00	4.53
83	688627	精智达	6,870,673.58	4.51
84	601668	中国建筑	6,832,010.00	4.49
85	688072	拓荆科技	6,789,807.56	4.46
86	002409	雅克科技	6,785,535.00	4.46
87	603083	剑桥科技	6,724,693.00	4.42
88	688502	茂莱光学	6,685,520.64	4.39
89	03606	福耀玻璃	6,637,546.61	4.36

90	603259	药明康德	6,618,011.00	4.35
91	688041	海光信息	6,606,761.07	4.34
92	300762	上海瀚讯	6,420,149.00	4.22
93	300274	阳光电源	6,349,061.00	4.17
94	001270	铖昌科技	5,981,535.88	3.93
95	688027	国盾量子	5,973,001.09	3.92
96	300525	博思软件	5,911,469.00	3.88
97	000998	隆平高科	5,854,704.98	3.85
98	002041	登海种业	5,777,494.00	3.80
99	03968	招商银行	5,741,434.72	3.77
100	600941	中国移动	5,651,013.00	3.71
101	000713	丰乐种业	5,648,434.00	3.71
102	002371	北方华创	5,545,851.00	3.64
103	601881	中国银河	5,538,874.00	3.64
104	002149	西部材料	5,480,073.00	3.60
105	601688	华泰证券	5,428,812.00	3.57
106	300827	上能电气	5,385,586.71	3.54
107	002920	德赛西威	5,351,790.00	3.52
108	300782	卓胜微	5,321,884.00	3.50
109	002444	巨星科技	5,251,346.00	3.45
110	000568	泸州老窖	5,230,941.05	3.44
111	688798	艾为电子	5,155,808.95	3.39
112	000733	振华科技	5,034,916.00	3.31
113	688331	荣昌生物	5,020,865.53	3.30
114	605077	华康股份	4,981,871.00	3.27
115	000521	长虹美菱	4,958,816.00	3.26
116	09995	荣昌生物	4,898,418.08	3.22
117	00762	中国联通	4,872,459.11	3.20
118	688270	臻镭科技	4,790,249.56	3.15
119	002837	英维克	4,780,301.69	3.14
120	688326	经纬恒润	4,745,033.52	3.12
121	601186	中国铁建	4,744,110.00	3.12
122	002292	奥飞娱乐	4,724,210.00	3.10
123	300654	世纪天鸿	4,711,513.00	3.09
124	688153	唯捷创芯	4,599,674.62	3.02
125	600820	隧道股份	4,528,638.00	2.97
126	002475	立讯精密	4,522,692.00	2.97
127	002120	韵达股份	4,481,336.00	2.94
128	00268	金蝶国际	4,407,726.10	2.90
129	300346	南大光电	4,395,927.00	2.89
130	601800	中国交建	4,367,716.00	2.87
131	00981	中芯国际	4,350,194.09	2.86
132	603596	伯特利	4,334,233.00	2.85

133	300870	欧陆通	4,229,192.00	2.78
134	300662	科锐国际	4,205,470.00	2.76
135	601377	兴业证券	4,200,894.00	2.76
136	01951	锦欣生殖	4,195,049.38	2.76
137	300033	同花顺	4,155,861.00	2.73
138	301061	匠心家居	4,138,900.00	2.72
139	601179	中国西电	4,101,441.00	2.69
140	300100	双林股份	4,071,415.00	2.67
141	300783	三只松鼠	3,992,772.00	2.62
142	03328	交通银行	3,949,367.76	2.59
143	00300	美的集团	3,947,052.45	2.59
144	600559	老白干酒	3,804,767.00	2.50
145	002385	大北农	3,754,972.00	2.47
146	601066	中信建投	3,747,194.00	2.46
147	688220	翱捷科技	3,739,018.51	2.46
148	601077	渝农商行	3,721,668.00	2.44
149	601162	天风证券	3,719,263.00	2.44
150	688692	达梦数据	3,707,236.91	2.44
151	00921	海信家电	3,668,626.22	2.41
152	300628	亿联网络	3,657,073.00	2.40
153	605117	德业股份	3,575,809.00	2.35
154	002869	金溢科技	3,571,267.00	2.35
155	600958	东方证券	3,564,863.00	2.34
156	300316	晶盛机电	3,548,538.00	2.33
157	000032	深桑达 A	3,544,710.00	2.33
158	00867	康哲药业	3,526,156.14	2.32
159	300036	超图软件	3,524,192.00	2.31
160	06088	FITHONTENG	3,484,319.46	2.29
161	603357	设计总院	3,477,972.00	2.28
162	688489	三未信安	3,469,713.88	2.28
163	603067	振华股份	3,443,418.24	2.26
164	300260	新莱应材	3,343,041.00	2.20
165	000776	广发证券	3,342,374.00	2.20
166	000063	中兴通讯	3,323,313.00	2.18
167	603885	吉祥航空	3,294,276.00	2.16
168	002025	航天电器	3,249,707.00	2.13
169	600282	南钢股份	3,238,208.00	2.13
170	601528	瑞丰银行	3,219,310.80	2.11
171	688083	中望软件	3,207,631.15	2.11
172	688312	燕麦科技	3,178,430.93	2.09
173	002468	申通快递	3,171,027.00	2.08
174	600660	福耀玻璃	3,135,810.00	2.06
175	002222	福晶科技	3,120,317.00	2.05

176	688048	长光华芯	3,113,916.13	2.05
177	000877	天山股份	3,112,476.00	2.04
178	000858	五粮液	3,058,356.00	2.01
179	688082	盛美上海	3,050,278.74	2.00

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	1,681,042,803.16
卖出股票收入（成交）总额	1,601,397,670.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,736,479.73	3.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,736,479.73	3.11

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019749	24 国债 15	47,000	4,736,479.73	3.11

#### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与国债期货的投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未发生国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；浙江万丰奥威汽轮股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会浙江监管局、深圳证券交易所的处罚；新华人寿保险股份有限公司在报告编制日一年内曾受到中国人民银行北京市分行的处罚；上海农村商业银行股份有限公司在报告编制日一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序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期没有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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	613,669.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	613,669.87
---	----	------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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 (%)
安联中国精选混合 A	605	160,756.97	64,198,620.23	66.01	33,059,344.81	33.99
安联中国精选混合 C	571	55,296.25	10,000,450.00	31.67	21,573,709.21	68.33
合计	1,130	114,010.73	74,199,070.23	57.59	54,633,054.02	42.41

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	安联中国精选混合 A	7,780,399.32	7.9998
	安联中国精选混合 C	2,895,542.67	9.1706

	合计	10,675,941.99	8.2867
--	----	---------------	--------

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	安联中国精选混合 A	>100
	安联中国精选混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	安联中国精选混合 A	>100
	安联中国精选混合 C	-
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安联中国精选混合 A	安联中国精选混合 C
基金合同生效日 (2024 年 09 月 03 日) 基金份额总额	167,767,436.47	82,332,848.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,829,475.07	1,283,418.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	73,338,946.50	52,042,108.67
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	97,257,965.04	31,574,159.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额（如适用）。

## § 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，本基金无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人主要发生如下变更：

2024 年 5 月 20 日起，Khalil Soubra 担任股东监事。

2024 年 10 月 8 日，顾文女士离任督察长，沈良先生代为履行督察长职务。

2024 年 12 月 12 日起，段婧女士新任财务负责人，沈良先生不再兼任财务负责人职务。

2024 年 12 月 27 日起，管江女士新任督察长，沈良先生不再代为履行督察长职务。

本报告期内，基金托管人主要发生如下变更：

经中国银行研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本基金本报告期应支付给该事务所审计费用为 45,000.00 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

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	3	3,282,440,473.61	100.00	1,498,635.40	100.00	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，可免于执行该规定中“第五条 一家基金管理人通过一家证券公司进行交易的年交易佣金总

额，不得超过其当年所有基金证券交易佣金总额的百分之十五。”

2、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。

3、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(%)
东方证券	239,970,927.84	100.00	509,333,000.00	100.00	-	-

### 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	安联中国精选混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
2	安联中国精选混合型证券投资基金（安联中国精选混合 A）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
3	安联中国精选混合型证券投资基金（安联中国精选混合 C）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
4	安联中国精选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
5	安联中国精选混合型证券投资基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
6	安联中国精选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
7	安联中国精选混合型证券投资基金基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
8	安联基金管理有限公司关于个人投资者开户证件类型说明的公告	中国证监会规定媒介	2024年8月7日
9	安联基金管理有限公司关于拟任基金经理认购安联中国精选混合型证券投资基金的公告	中国证监会规定媒介	2024年8月12日
10	安联中国精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2024年9月4日

11	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 10 日
12	安联中国精选混合型证券投资基金（安联中国精选混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 11 月 29 日
13	安联中国精选混合型证券投资基金（安联中国精选混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 11 月 29 日
14	安联中国精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2024 年 11 月 29 日
15	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 13 日
16	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 27 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240903 - 20241231	60,012,48 5.00	-	-	60,012,485.00	46.58
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过总份额 20%的情形，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</li> <li>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，从而导致流动性风险；</li> <li>3、当个别投资者大额赎回，触发巨额赎回条款时，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</li> <li>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足基金合同约定，可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</li> </ol>							

注：1、份额占比精度处理方式四舍五入。

2、报告期末持有基金情况份额占比的计算中，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）。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室。

### 13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安联基金管理有限公司。

咨询电话：021-38917777。

公司网址：[www.allianzgi.com.cn](http://www.allianzgi.com.cn)。

公司办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室。

安联基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日