

东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式 证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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
§ 5 托管人报告	13
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	14
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58

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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	63
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	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
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	66
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方红智逸沪港深定开混合
基金主代码	004278
基金运作方式	契约型、发起式、定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2017 年 4 月 14 日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	831,671,326.72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期安全的基础上，为基金份额持有人获取稳定的投资收益，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以 36 个月为一个运作周期，以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择，运用封闭期无流动性需求的优势，同时，充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排，在股票的配置上，以时间换空间，采用低风险投资策略，为本基金获得更高的低风险收益；在债券配置上，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×30%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临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		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周陶	张姗
	联系电话	021-53952888	400-61-95555
	电子邮箱	service@dfham.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	400-61-95555
传真		021-63326381	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销	深圳市深南大道 7088 号招商银

	大厦 7 层-11 层	行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	杨斌	缪建民

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.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

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)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威 大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任 公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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
本期已实现收益	-1,767,954.28	-45,211,336.07	23,314,733.44
本期利润	89,469,307.24	-67,073,010.04	-184,420,196.57
加权平均基金份额本期利润	0.0938	-0.0466	-0.0841
本期加权平均净值利润率	7.24%	-3.48%	-6.17%
本期基金份额净值增长率	7.62%	-4.61%	-5.05%
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	243,537,277.17	322,578,459.76	663,186,944.82
期末可供分配基金份额利润	0.2928	0.2811	0.3323

期末基金资产净值	1,146,665,532.33	1,470,181,133.62	2,680,603,954.18
期末基金份额净值	1.3787	1.2811	1.3430
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	37.87%	28.11%	34.30%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

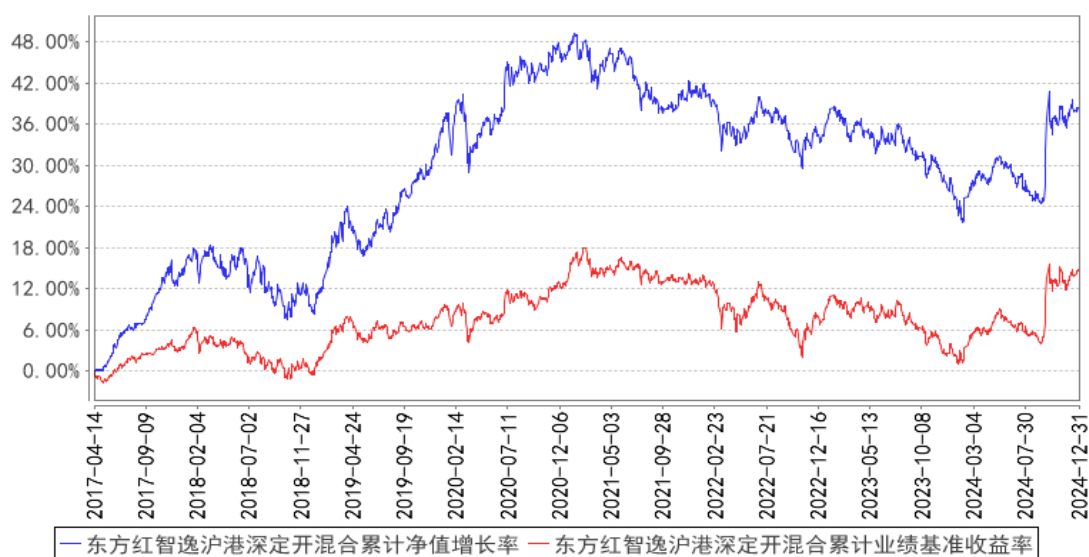
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.76%	0.75%	0.67%	0.61%	0.09%	0.14%
过去六个月	7.48%	0.72%	7.40%	0.58%	0.08%	0.14%
过去一年	7.62%	0.59%	9.95%	0.48%	-2.33%	0.11%
过去三年	-2.53%	0.48%	0.86%	0.45%	-3.39%	0.03%
过去五年	2.52%	0.50%	5.27%	0.42%	-2.75%	0.08%
自基金合同生效起至今	37.87%	0.51%	14.32%	0.38%	23.55%	0.13%

注：自基金成立至 2022 年 4 月 19 日，本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%；自 2022 年 4 月 20 日起，本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*60%+沪深 300 指数收益率*30%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)*10%。本基金每个交易日对业绩比较基准根据设定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

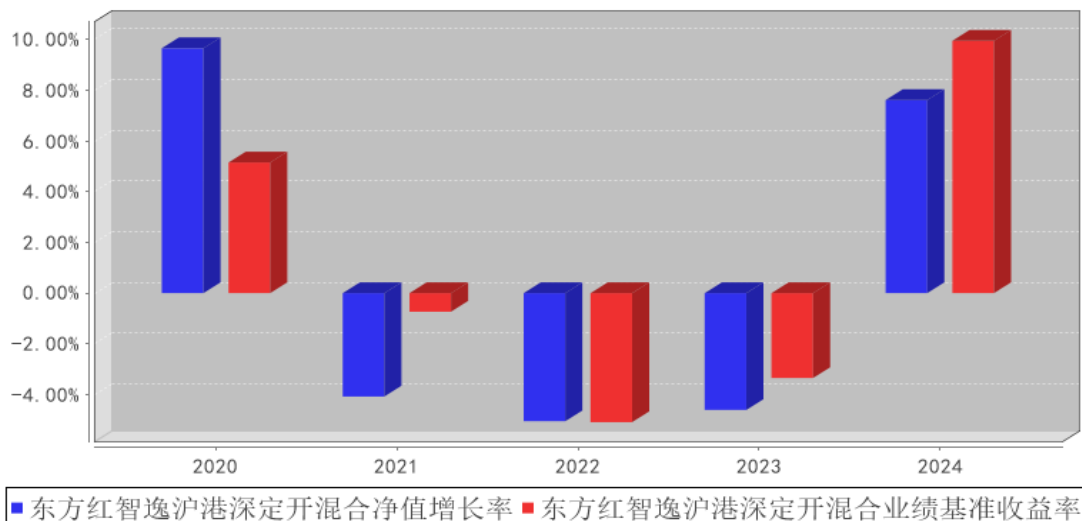
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红智逸沪港深定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

东方红智逸沪港深定开混合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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国

证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2024 年 12 月 31 日，公司共管理公募基金 111 只，产品类型涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、指数型基金、货币型基金和 FOF 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		
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部 总 经 理、基金 经理	2017 年 4 月 28 日	-	17 年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、基金经理，2015 年 07 月至今任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至 2023 年 04 月任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至 2022 年 11 月任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至 2017 年 09 月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2015 年 10 月至 2021 年 12 月任东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（原东方红纯债债券型发起式证券投资基金）基金经理、2015 年 11 月至 2024 年 03 月任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2015 年 11 月至今任东方红信用债债券型证券投资基金基金经理、2016 年 05 月至今任东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 05 月至 2017 年 08 月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2016 年 06 月至 2017 年 08 月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2016 年 09 月至今任东方红价值精选混合型证券投资基金基金经理、2016 年 11 月至 2021 年 12 月任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 04 月至今任东方红智逸

					沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2018 年 11 月任东方红货币市场基金基金经理、2023 年 03 月至今任东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 09 月至今任东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。江苏大学经济学硕士。曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理。具备证券投资基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统内的公平交易模块进行交易执行和分配，风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，

对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。报告期内未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为指数投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，2024 年整体呈现先抑后扬的走势，市场波动较大。经历前期对于基本面数据以及政策预期的较大悲观情绪后，市场于 9 月 24 日一揽子货币政策组合拳推出后迎来了风险偏好的大幅提振，开启了快速上涨的行情。整体来看，全年上证指数上涨 12.67%，沪深 300 上涨 14.68%，创业板指上涨 13.23%，中证 500 上涨 5.46%，中证 800 上涨 12.2%，中证 1000 上涨 1.2%。从行业来看，银行、非银、通信、家电涨幅超 25%，而医药生物、农林牧渔、美容护理、食品饮料等跌幅超 8%。本产品 2024 年操作上相比年初增加了股票资产的配置比例，结构上更关注处于周期底部、估值低位且经营预期稳健的个股，关注龙头企业的价值重估。

转债方面，2024 年转债指数上涨 6.08%，但过程更为波折。5 月下旬受权益市场走弱及对小市值标的的风险不确定性担忧的影响，中证转债指数开启了持续下跌。其中低价转债更是出现了较

大波动，为近年来罕见。转债估值震荡偏弱，市场处于低位。9 月 24 日权益市场开启大幅上涨行情后，转债也跟随修复，但在正股急涨背景下转债估值修复偏慢，未来仍有回升空间。本产品操作上相比年初增加了转债的配置比例。

债券方面，2024 年市场持续强势，一直处于对基本面以及稳增长政策预期较弱、对资金宽松预期较强的状态中。期间市场虽受到央行买卖国债、稳增长政策预期变化等因素的影响有所波动，但宽松的货币政策带来了债券收益率大幅下行。全年来看，十年国债收益率从年初 2.56% 下行至 1.68%，三十年国债从年初 2.83% 下行至年底 1.91%。信用债也跟随下行，信用利差也进一步压缩，3 年 AAA 从 2.71% 下行至 1.74%，其与 3 年国开债的利差从年初 37BP 压缩至 31BP。本产品在债券配置上精选个券，同时适时调整了组合久期和杠杆，获取了相对稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.3787 元，份额累计净值为 1.3787 元。本报告期基金份额净值增长率为 7.62%，同期业绩比较基准收益率为 9.95%。

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，政策推动及内外需交替作用下经济或延续平稳。一方面货币政策仍有望继续发力；另一方面，发债节奏有望前置，消费品“以旧换新”等政策也将接续发力，叠加美国加征关税预期下的抢出口效应，经济复苏的预期或持续。后期虽有出口退坡带来边际走弱的可能，但财政或继续发力，地产或止跌回稳、内需支撑或增强。且前期市场对于特朗普上台后的关税措施已有所定价，虽然长期看关税仍然是压制因素，但短期若政策推进好于预期，则市场情绪也将有所修复。因此我仍然看好 2025 年权益市场的表现，中枢或延续震荡上行的走势。未来更关注受益于政策红利的方向，关注受益于财政政策落地的低位顺周期品种，关注优质消费公司的重估，继续关注受益于“新质生产力”发展方向的行业。

转债方面，在 2025 年权益市场震荡偏乐观的预期下，转债的配置价格仍然值得重视，估值或有进一步修复的空间。关注转债的交易机会，在权益强势阶段或存在估值快速兑现的止盈机会，而市场震荡阶段则存在增加配置的可能。本产品后续仍然会对市场保持密切跟踪，关注市场变化，适时精选一些优质转债进行配置。

债券方面，短期看配置方向上基本面尚不构成债市的风险，交易维度上则需要重视低利率环境下市场波动加剧。市场对于宽松货币政策预期较满，未来仍然需要关注央行对于汇率的态度以及美联储降息放缓的可能。本产品操作上一方面维持基础配置仓位，另一方面把握市场波动中的交易机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规稽核部和风险管理部根据职责分工开展，2024 年开展了如下主要工作：

在合规管理履职方面：（1）切实履行日常合规管理职责，包括合规审查、合规检查与稽核、合规咨询、合规宣导与培训、合规报告、监管沟通与配合；（2）强化落实员工执业行为管理，包括进一步加强员工投资行为管理，持续强化执业行为监测，完善即时通讯工具管控，优化新员工入职合规审查与新任投资人员上岗前谈话机制；（3）稳步跟进各类法律事务；（4）促进公司产品转型、业务推进。

在风险管理履职方面：（1）切实履行日常风险管理职责，做到事前、事中、事后风险管理，按时完成内外部各类定期风控报告及数据报送，并对公司风控指标进行持续监测；（2）结合公司业务发展动态，开展多维度专项分析；（3）关注行业趋势变化，全力支持新业务开展。

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，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501344 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	东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金（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，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 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 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	该基金管理人上海东方证券资产管理有限公司（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。 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。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。

	(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。 (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。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
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	张楠	倪益
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

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
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	3,516,650.48	2,105,377.75
结算备付金		18,186,109.98	50,734,656.47
存出保证金		47,055.29	68,867.13
交易性金融资产	7.4.7.2	1,085,027,966.95	1,879,979,468.55
其中：股票投资		347,468,636.96	502,020,293.22
基金投资		-	-
债券投资		737,559,329.99	1,357,808,736.97
资产支持证券投资		-	20,150,438.36
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	41,003,021.90	-
债权投资	7.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,639,155.33	51,148,155.74
应收股利		63,964.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,149,483,924.73	1,984,036,525.64
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	460,710,873.28
应付清算款		1,416,368.36	51,322,628.45
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		972,662.06	1,243,469.93
应付托管费		194,532.42	248,693.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,698.56	53,890.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	212,131.00	275,835.38
负债合计		2,818,392.40	513,855,392.02
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	831,671,326.72	1,147,602,673.86
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	314,994,205.61	322,578,459.76
净资产合计		1,146,665,532.33	1,470,181,133.62
负债和净资产总计		1,149,483,924.73	1,984,036,525.64

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3787 元，基金份额总额 831,671,326.72 份。

7.2 利润表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		109,052,722.53	-30,860,843.89
1. 利息收入		844,571.98	1,082,505.34
其中：存款利息收入	7.4.7.13	439,057.96	808,391.96
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		405,514.02	274,113.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		16,967,831.52	-10,500,228.35
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-28,796,329.10	-79,910,687.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	38,727,336.39	58,715,571.61
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	91,701.64	160,438.36
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	6,945,122.59	10,534,449.17
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	7.4.7.20	91,237,261.52	-21,861,673.97
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.21	3,057.51	418,553.09
减：二、营业总支出		19,583,415.29	36,212,166.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	12,401,921.29	19,456,793.55
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,480,384.34	3,891,358.74
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,433,761.79	12,498,726.67
其中：卖出回购金融 资产支出		4,433,761.79	12,498,726.67

6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		31,820.35	84,428.83
8. 其他费用	7.4.7.23	235,527.52	280,858.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		89,469,307.24	-67,073,010.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		89,469,307.24	-67,073,010.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		89,469,307.24	-67,073,010.04

7.3 净资产变动表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,147,602,673.86	322,578,459.76	1,470,181,133.62
二、本期期初净资产	1,147,602,673.86	322,578,459.76	1,470,181,133.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-315,931,347.14	-7,584,254.15	-323,515,601.29
（一）、综合收益总额	-	89,469,307.24	89,469,307.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-315,931,347.14	-97,053,561.39	-412,984,908.53
其中：1. 基金申购款	151,992.67	47,061.31	199,053.98
2. 基金赎回款	-316,083,339.81	-97,100,622.70	-413,183,962.51
（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	831,671,326.72	314,994,205.61	1,146,665,532.33
项目	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,996,041,211.49	684,562,742.69	2,680,603,954.18
二、本期期初净资产	1,996,041,211.49	684,562,742.69	2,680,603,954.18
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-848,438,537.63	-361,984,282.93	-1,210,422,820.56
(一)、综合收益总额	-	-67,073,010.04	-67,073,010.04
(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)	-848,438,537.63	-294,911,272.89	-1,143,349,810.52
其中:1.基金申购款	695,542.66	242,208.10	937,750.76
2.基金赎回款	-849,134,080.29	-295,153,480.99	-1,144,287,561.28
(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	1,147,602,673.86	322,578,459.76	1,470,181,133.62

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>张锋</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</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

东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金（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[2016]3116号《关于核准东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金。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 1,482,513,396.24 元。业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普

华永道中天验字（2017）第 435 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,482,644,340.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 130,943.79 份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以 36 个月为一个运作周期，每个运作周期以封闭期和期间开放期相交替的方式运作，共包含 3 个封闭期和 2 个期间开放期。在每个运作周期中，第一期间开放期的首日为该运作周期首日的 12 个月后的月度对日，第二个期间开放期的首日为该运作周期首日的 24 个月后的月度对日，本基金的每个期间开放期为 5 至 10 个工作日。在每个运作周期结束后第一个工作日起进入到期开放期。本基金每个到期开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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及存托凭证（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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）。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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 50%，但在每个期间开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、到期开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间，基金投资不受前述比例限制；本基金投资于股票、存托凭证的比例不高于基金资产的 50%（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的 0-50%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-50%）。在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。在封闭期，本基金不受前述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×30%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日至 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，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、资产支持证券投资、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。

7.4.4.4 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）金融工具的后续计量

-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，参考类似金融工具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。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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、资产支持证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和托管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

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

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或减值。

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 号文《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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,516,650.48	2,105,377.75
等于: 本金	3,513,068.35	2,104,240.88
加: 应计利息	3,582.13	1,136.87
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	3,516,650.48	2,105,377.75

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		350,467,000.51	-	347,468,636.96	-2,998,363.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	408,127,854.10	3,560,492.48	419,017,273.18	7,328,926.60
	银行间市场	310,469,634.59	2,596,056.81	318,542,056.81	5,476,365.41
	合计	718,597,488.69	6,156,549.29	737,559,329.99	12,805,292.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,069,064,489.20	6,156,549.29	1,085,027,966.95	9,806,928.46
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		582,924,928.96	-	502,020,293.22	-80,904,635.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,104,793,263.95	11,217,638.42	1,114,964,861.94	-1,046,040.43
	银行间市场	240,288,656.89	2,024,875.03	242,843,875.03	530,343.11
	合计	1,345,081,920.84	13,242,513.45	1,357,808,736.97	-515,697.32
资产支持证券		20,000,000.00	160,438.36	20,150,438.36	-10,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,948,006,849.80	13,402,951.81	1,879,979,468.55	-

				81,430,333.06
--	--	--	--	---------------

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-345.89	-
银行间市场	41,003,367.79	-
合计	41,003,021.90	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	37,131.00	55,835.38
其中：交易所市场	30,024.14	48,085.95
银行间市场	7,106.86	7,749.43
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	220,000.00
合计	212,131.00	275,835.38

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,147,602,673.86	1,147,602,673.86
本期申购	151,992.67	151,992.67
本期赎回（以“-”号填列）	-316,083,339.81	-316,083,339.81
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	831,671,326.72	831,671,326.72

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	328,870,157.11	-6,291,697.35	322,578,459.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	328,870,157.11	-6,291,697.35	322,578,459.76
本期利润	-1,767,954.28	91,237,261.52	89,469,307.24
本期基金份额交易产生的变动数	-83,564,925.66	-13,488,635.73	-97,053,561.39
其中：基金申购款	40,295.13	6,766.18	47,061.31
基金赎回款	-83,605,220.79	-13,495,401.91	-97,100,622.70

本期已分配利润	-	-	-
本期末	243, 537, 277. 17	71, 456, 928. 44	314, 994, 205. 61

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	46, 502. 08	59, 027. 28
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	391, 456. 68	747, 149. 71
其他	1, 099. 20	2, 214. 97
合计	439, 057. 96	808, 391. 96

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-28, 796, 329. 10	-79, 910, 687. 49
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-28, 796, 329. 10	-79, 910, 687. 49

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	558, 159, 557. 13	899, 122, 926. 90
减：卖出股票成本总额	585, 847, 843. 78	976, 793, 948. 62
减：交易费用	1, 108, 042. 45	2, 239, 665. 77

买卖股票差价收入	-28,796,329.10	-79,910,687.49
----------	----------------	----------------

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	23,770,518.20	45,972,632.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,956,818.19	12,742,938.72
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	38,727,336.39	58,715,571.61

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,315,835,087.01	2,397,696,394.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,274,554,825.28	2,349,898,801.07
减：应计利息总额	26,276,411.22	35,026,097.53
减：交易费用	47,032.32	28,557.37
买卖债券差价收入	14,956,818.19	12,742,938.72

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	91,701.64	160,438.36
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	91,701.64	160,438.36

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	20,252,140.00	-
减：卖出资产支持证券成本总额	20,000,000.00	-
减：应计利息总额	252,140.00	-
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	0.00	-

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,945,122.59	10,534,449.17
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	6,945,122.59	10,534,449.17

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	91,237,261.52	-21,861,673.97
股票投资	77,906,272.19	-21,420,601.04
债券投资	13,320,989.33	-431,072.93
资产支持证券投资	10,000.00	-10,000.00
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	91,237,261.52	-21,861,673.97

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,057.51	410,755.39
基金转换费收入	-	7,797.70
合计	3,057.51	418,553.09

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	330.76	970.21
证券组合费	5,787.36	9,908.72
银行费用	17,209.40	12,779.43
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	235,527.52	280,858.36

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东方证券	765,291,580.04	84.26	954,309,245.14	66.47

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
东方证券	1,037,210,567.41	78.79	925,902,854.30	83.85

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券 回购 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 (%)
东方证券	47,125,850,000.00	99.55	104,032,330,000.00	98.90

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

东方证券	461,254.38	82.16	30,024.14	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	704,343.89	66.90	15,204.40	31.62

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,401,921.29	19,456,793.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,882,355.59	9,296,103.29
应支付基金管理人的净管理费	6,519,565.70	10,160,690.26

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1\%\div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,480,384.34	3,891,358.74

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，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

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

7.4.10.4 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2017 年 4 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,004,586.95	10,004,586.95
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,004,586.95	10,004,586.95
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.2029%	0.8718%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	3,516,650.48	46,502.08	2,105,377.75	59,027.28

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：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

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
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股锁定	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-

		日								
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股锁定	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股锁定	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股锁定	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股锁定	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股锁定	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
603310	魏华新材	2024年8月7日	6个月	新股锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024年7月24日	6个月	新股锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688449	联芸科	2024年11月20日	6个月	新股锁定	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-

	技	日								
688605	先锋精科	2024年12月4日	6个月	新股锁定	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024年9月19日	6个月	新股锁定	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	6个月	新股锁定	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024年10月22日	6个月	新股锁定	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024年11月12日	6个月	新股锁定	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：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

注：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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

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同责任，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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,191,232.33	-
合计	30,191,232.33	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	20,150,438.36
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	20,150,438.36

注：该评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,800,691.84	19,931,548.26
合计	29,800,691.84	19,931,548.26

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	525,489,244.01	1,087,070,858.49
AAA 以下	59,765,847.25	53,344,322.83

未评级	92,312,314.56	197,462,007.39
合计	677,567,405.82	1,337,877,188.71

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无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

注：本基金本报告期末及上年度末无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于开放日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于开放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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《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，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，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)。

本基金所持证券主要在证券交易所或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，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4 年	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

12月31日							
资产							
货币资金	3,516,650.48	-	-	-	-	-	3,516,650.48
结算备付金	18,186,109.98	-	-	-	-	-	18,186,109.98
存出保证金	47,055.29	-	-	-	-	-	47,055.29
交易性金融资产	20,459,387.40	30,627,881.10	294,846,527.02	302,553,002.18	89,072,532.29	347,468,636.96	1,085,027,966.95
买入返售金融资产	41,003,021.90	-	-	-	-	-	41,003,021.90
应收股利	-	-	-	-	-	63,964.80	63,964.80
应收清算款	-	-	-	-	-	1,639,155.33	1,639,155.33
资	83,212,225.	30,627,881	294,846,527	302,553,002	89,072,532	349,171,757	1,149,483,924

产总计	05	.10	.02	.18	.29	.09	.73
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	972,662.06	972,662.06
应付托管费	-	-	-	-	-	194,532.42	194,532.42
应付清算款	-	-	-	-	-	1,416,368.36	1,416,368.36
应交税费	-	-	-	-	-	22,698.56	22,698.56
其他负债	-	-	-	-	-	212,131.00	212,131.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,818,392.40	2,818,392.40
利率敏感度缺口	83,212,225.05	30,627,881.10	294,846,527.02	302,553,002.18	89,072,532.29	346,353,364.69	1,146,665,532.33
上年度末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日							
资产							
货币资金	2,105,377.75	-	-	-	-	-	2,105,377.75
结算备付金	50,734,656.47	-	-	-	-	-	50,734,656.47
存出保证金	68,867.13	-	-	-	-	-	68,867.13
交易性金融资产	-	40,955,059.97	633,251,763.86	678,689,343.53	25,063,007.97	502,020,293.22	1,879,979,468.55
应收清算款	-	-	-	-	-	51,148,155.74	51,148,155.74
资产总计	52,908,901.35	40,955,059.97	633,251,763.86	678,689,343.53	25,063,007.97	553,168,448.96	1,984,036,525.64
负债							
应付管理	-	-	-	-	-	1,243,469.93	1,243,469.93

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	248,693.99	248,693.99
应付 清 算 款	-	-	-	-	-	51,322,628.45	51,322,628.45
卖出 回 购 金 融 资 产 款	460,710,873.28	-	-	-	-	-	460,710,873.28
应 交 税 费	-	-	-	-	-	53,890.99	53,890.99
其 他 负 债	-	-	-	-	-	275,835.38	275,835.38
负 债 总 计	460,710,873.28	-	-	-	-	53,144,518.74	513,855,392.02
利 率 敏 感 度 缺 口	- 407,801,971.93	- 40,955,059.97	- 633,251,763.86	- 678,689,343.53	- 25,063,007.97	- 500,023,930.22	- 1,470,181,133.62

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	7,827,357.11	5,710,970.23
	2. 市场利率上升 25 个基点	-7,530,740.51	-5,648,015.76

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。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			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	123,054,978.50	-	123,054,978.50
资产合计	-	123,054,978.50	-	123,054,978.50
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	-	123,054,978.50	-	123,054,978.50
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	84,095,311.80	-	84,095,311.80
资产合计	-	84,095,311.80	-	84,095,311.80
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	-	84,095,311.80	-	84,095,311.80

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1、港币相对人民币升值 5%	6,152,748.93	4,204,765.59
	2、港币相对人民币贬值 5%	-6,152,748.93	-4,204,765.59

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

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	347,468,636.96	30.30	502,020,293.22	34.15

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	347,468,636.96	30.30	502,020,293.22	34.15

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	15,507,885.06	28,106,261.24
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-15,507,885.06	-28,106,261.24

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
---------------	-------------------------	--------------------------

第一层次	511,743,377.52	744,151,701.38
第二层次	572,852,498.46	1,134,990,743.77
第三层次	432,090.97	837,023.40
合计	1,085,027,966.95	1,879,979,468.55

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 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	837,023.40	837,023.40
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,041,651.15	1,041,651.15
转出第三层次	-	1,710,538.50	1,710,538.50
当期利得或损失总额	-	263,954.92	263,954.92
其中：计入损益的利得或损失	-	263,954.92	263,954.92
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	432,090.97	432,090.97
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	-	257,077.87	257,077.87
	上年度可比期间		

项目	2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,296,384.89	2,296,384.89
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,899,392.99	1,899,392.99
转出第三层次	-	4,625,269.40	4,625,269.40
当期利得或损失总额	-	1,266,514.92	1,266,514.92
其中：计入损益的利得或损失	-	1,266,514.92	1,266,514.92
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	837,023.40	837,023.40
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	-	100,339.21	100,339.21

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	432,090.97	平均价格亚式期权模型	该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率	0.2665~4.7081	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	837,023.40	平均价格亚式期权模型	该流通受限股票在剩余限售期内的股价预期年化波动率	0.1855~2.1775	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	347,468,636.96	30.23
	其中：股票	347,468,636.96	30.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	737,559,329.99	64.16
	其中：债券	737,559,329.99	64.16
	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	41,003,021.90	3.57
	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	21,702,760.46	1.89
8	其他各项资产	1,750,175.42	0.15
9	合计	1,149,483,924.73	100.00

注：1、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 123,054,978.50 元人民币，占期末基金资产净值比例 10.73%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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	4,759,776.00	0.42
C	制造业	154,585,080.11	13.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	3,092,760.00	0.27
F	批发和零售业	2,251,329.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,082,423.55	2.80
J	金融业	21,621,677.00	1.89
K	房地产业	5,988,748.00	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	224,413,658.46	19.57

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（%）
10 能源	-	-
15 原材料	2,662,605.00	0.23
20 工业	9,910,424.50	0.86
25 可选消费	41,692,523.00	3.64
30 主要消费	18,272,022.00	1.59
35 医药卫生	6,542,700.00	0.57
40 金融	8,893,004.00	0.78
45 信息技术	6,698,940.00	0.58
50 通信服务	28,382,760.00	2.48
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	123,054,978.50	10.73

注：以上分类采用中证行业分类标准。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	73,500	28,382,760.00	2.48
2	002475	立讯精密	675,550	27,535,418.00	2.40
3	300750	宁德时代	64,080	17,045,280.00	1.49
4	688111	金山办公	52,539	15,046,644.21	1.31
5	300274	阳光电源	182,260	13,456,255.80	1.17

6	600030	中信证券	385,700	11,250,869.00	0.98
7	600276	恒瑞医药	240,200	11,025,180.00	0.96
8	002028	思源电气	139,200	10,119,840.00	0.88
9	600941	中国移动	82,200	9,712,752.00	0.85
10	600887	伊利股份	311,300	9,395,034.00	0.82
11	03908	中金公司	749,200	8,893,004.00	0.78
12	600690	海尔智家	303,100	8,629,257.00	0.75
13	002415	海康威视	277,300	8,513,110.00	0.74
14	03800	协鑫科技	8,096,000	8,096,000.00	0.71
15	09988	阿里巴巴-W	105,400	8,043,074.00	0.70
16	02020	安踏体育	110,000	7,929,900.00	0.69
17	600600	青岛啤酒	45,300	3,665,676.00	0.32
17	00168	青岛啤酒股份	64,000	3,366,400.00	0.29
18	600519	贵州茅台	4,500	6,858,000.00	0.60
19	00992	联想集团	718,000	6,698,940.00	0.58
20	600426	华鲁恒升	300,800	6,500,288.00	0.57
21	02015	理想汽车-W	74,300	6,464,100.00	0.56
22	00291	华润啤酒	273,000	6,382,740.00	0.56
23	601318	中国平安	116,000	6,107,400.00	0.53
24	688120	华海清科	36,786	5,995,750.14	0.52
25	002223	鱼跃医疗	152,300	5,557,427.00	0.48
26	688099	晶晨股份	77,621	5,331,010.28	0.46
27	06862	海底捞	361,000	5,313,920.00	0.46
28	03690	美团-W	37,300	5,239,904.00	0.46
29	601899	紫金矿业	314,800	4,759,776.00	0.42
30	02333	长城汽车	362,500	4,585,625.00	0.40
31	601658	邮储银行	750,600	4,263,408.00	0.37
32	00175	吉利汽车	300,000	4,116,000.00	0.36
33	600048	保利发展	447,800	3,967,508.00	0.35
34	002493	荣盛石化	422,200	3,820,910.00	0.33
35	06618	京东健康	143,800	3,741,676.00	0.33
36	02319	蒙牛乳业	229,000	3,723,540.00	0.32
37	02367	巨子生物	78,200	3,613,622.00	0.32
38	002078	太阳纸业	235,900	3,507,833.00	0.31
39	603606	东方电缆	63,500	3,336,925.00	0.29
40	601390	中国中铁	484,000	3,092,760.00	0.27
41	06160	百济神州	27,700	2,801,024.00	0.24
42	01378	中国宏桥	244,500	2,662,605.00	0.23
43	002138	顺络电子	82,800	2,606,544.00	0.23
44	603939	益丰药房	93,300	2,251,329.00	0.20
45	002351	漫步者	129,100	2,130,150.00	0.19
46	601155	新城控股	169,000	2,021,240.00	0.18
47	301153	中科江南	68,100	1,902,714.00	0.17

48	02057	中通快递-W	12,950	1,814,424.50	0.16
49	688212	澳华内镜	44,987	1,807,577.66	0.16
50	688169	石头科技	7,660	1,679,761.40	0.15
51	00220	统一企业中国	164,000	1,185,720.00	0.10
52	002064	华峰化学	133,000	1,087,940.00	0.09
53	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
54	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
55	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
56	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
57	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
58	001391	国货航	4,686	31,864.80	0.00
59	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
60	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
61	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
62	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
63	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
64	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
65	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
66	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
67	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
68	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
69	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
70	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
71	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
72	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
73	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00

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	600941	中国移动	11,617,353.00	0.79
2	02015	理想汽车-W	11,225,892.49	0.76
3	02333	长城汽车	10,896,946.62	0.74
4	002223	鱼跃医疗	10,794,624.00	0.73
5	300274	阳光电源	10,439,892.60	0.71
6	603606	东方电缆	10,288,184.00	0.70
7	03800	协鑫科技	10,145,746.58	0.69
8	09988	阿里巴巴-W	8,989,068.85	0.61
9	601658	邮储银行	8,917,422.00	0.61
10	00700	腾讯控股	8,115,563.98	0.55

11	002475	立讯精密	7,449,365.00	0.51
12	600872	中炬高新	7,405,403.00	0.50
13	02367	巨子生物	7,383,730.73	0.50
14	00992	联想集团	7,335,123.41	0.50
15	600276	恒瑞医药	6,756,745.80	0.46
16	01801	信达生物	6,560,515.67	0.45
17	002078	太阳纸业	6,545,480.66	0.45
18	02020	安踏体育	6,522,358.56	0.44
19	601689	拓普集团	6,326,812.00	0.43
20	03690	美团-W	5,897,383.24	0.40

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601658	邮储银行	20,394,090.00	1.39
2	02020	安踏体育	20,219,011.41	1.38
3	002475	立讯精密	18,003,849.40	1.22
4	300604	长川科技	17,804,268.66	1.21
5	00700	腾讯控股	17,465,757.24	1.19
6	600048	保利发展	16,926,372.00	1.15
7	300750	宁德时代	16,211,387.00	1.10
8	600030	中信证券	15,174,092.00	1.03
9	300122	智飞生物	14,367,415.57	0.98
10	300033	同花顺	12,502,445.00	0.85
11	600519	贵州茅台	11,777,616.00	0.80
12	600276	恒瑞医药	10,260,026.44	0.70
13	603596	伯特利	10,210,572.60	0.69
14	002555	三七互娱	10,185,888.00	0.69
15	688012	中微公司	10,144,899.66	0.69
16	02628	中国人寿	9,962,542.72	0.68
17	002916	深南电路	9,218,509.00	0.63
18	603606	东方电缆	9,118,382.00	0.62
19	01801	信达生物	9,103,839.15	0.62
20	688111	金山办公	8,741,306.44	0.59

注：“本期累计卖出金额”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	353,389,915.33
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	558,159,557.13
--------------	----------------

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	71,235,310.18	6.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	329,203,087.12	28.71
	其中：政策性金融债	10,564,783.56	0.92
4	企业债券	101,909,956.17	8.89
5	企业短期融资券	30,191,232.33	2.63
6	中期票据	10,512,220.82	0.92
7	可转债（可交换债）	164,706,831.53	14.36
8	同业存单	29,800,691.84	2.60
9	其他	-	-
10	合计	737,559,329.99	64.32

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	185792	22 京投 02	800,000	81,450,568.77	7.10
2	092280065	22 工行二级 资本债 03A	500,000	52,181,865.75	4.55
3	242400020	24 交行永续 债 01BC	500,000	51,292,589.04	4.47
4	185821	22 光证 G1	500,000	50,908,794.52	4.44
5	115884	23 中证 17	500,000	50,628,802.74	4.42

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的

超额收益。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

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发行主体中，交通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，兴业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福建监管局的处罚，中信证券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的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	47,055.29
2	应收清算款	1,639,155.33
3	应收股利	63,964.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,750,175.42

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	42,624,748.20	3.72
2	110059	浦发转债	19,619,975.34	1.71
3	110085	通 22 转债	11,057,898.63	0.96
4	118031	天 23 转债	10,260,287.67	0.89
5	113043	财通转债	9,296,515.07	0.81
6	110079	杭银转债	8,012,689.42	0.70
7	110073	国投转债	6,638,314.44	0.58
8	127089	晶澳转债	5,987,585.06	0.52
9	118038	金宏转债	5,924,205.48	0.52
10	127076	中宠转 2	5,821,880.06	0.51
11	113065	齐鲁转债	5,723,866.30	0.50
12	118042	奥维转债	4,755,672.55	0.41
13	123226	中富转债	2,691,141.29	0.23
14	113069	博 23 转债	2,334,380.90	0.20
15	123160	泰福转债	2,299,363.54	0.20
16	113549	白电转债	1,728,133.81	0.15
17	127049	希望转 2	1,567,921.15	0.14
18	127099	盛航转债	1,387,464.36	0.12
19	113685	升 24 转债	1,277,786.39	0.11
20	113631	皖天转债	1,222,831.00	0.11
21	113584	家悦转债	1,171,484.93	0.10
22	113654	永 02 转债	1,110,787.67	0.10
23	123235	亿田转债	1,077,108.26	0.09
24	127060	湘佳转债	1,050,963.08	0.09
25	123228	震裕转债	950,857.30	0.08
26	113684	湘泵转债	844,298.87	0.07
27	113048	晶科转债	807,130.15	0.07
28	123221	力诺转债	762,897.26	0.07
29	118046	诺泰转债	729,938.20	0.06
30	111019	宏柏转债	694,161.21	0.06
31	127037	银轮转债	419,296.13	0.04
32	127032	苏行转债	399,055.73	0.03
33	127103	东南转债	379,474.75	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中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，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

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 (%)
10,851	76,644.67	24,517,248.94	2.95	807,154,077.78	97.05

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	84,881.21	0.01

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,004,586.95	1.20	10,004,586.95	1.20	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,004,586.95	1.20	10,004,586.95	1.20	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 4 月 14 日）	1,482,644,340.03
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	1,147,602,673.86
本报告期基金总申购份额	151,992.67
减：本报告期基金总赎回份额	316,083,339.81
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	831,671,326.72

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未发生基金份额持有人大会决议事项。

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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期，为本基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自 2024 年起为本基金提供审计服务，本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 55,000.00 元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内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

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	5	765,291,580.04	84.26	461,254.38	82.16	—
华泰证券	1	31,626,637.74	3.48	22,714.61	4.05	—
广发证券	2	23,411,230.91	2.58	17,228.09	3.07	—
西部证券	1	14,334,916.74	1.58	10,549.16	1.88	—
海通证券	2	10,305,774.27	1.13	7,268.60	1.29	—
民生证券	1	8,931,486.24	0.98	6,120.36	1.09	—
方正证券	1	8,477,910.16	0.93	4,095.82	0.73	—
兴业证券	2	7,999,956.35	0.88	5,887.14	1.05	—
中信建投证券	1	7,833,734.50	0.86	5,764.84	1.03	—
申万宏源	1	6,820,333.17	0.75	5,019.20	0.89	—
国泰君安	1	6,385,816.09	0.70	4,699.49	0.84	—
东吴证券	1	4,879,375.44	0.54	3,590.25	0.64	—
华创证券	2	4,655,947.50	0.51	2,029.59	0.36	—
西南证券	1	4,299,816.05	0.47	3,164.25	0.56	—
天风证券	1	3,011,546.58	0.33	2,023.89	0.36	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
高盛中国证券	1	—	—	—	—	—

光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

（1）选择标准

证券公司财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力和交易服务能力；针对除被动股票型基金外的其余基金将研究服务能力纳入考量。

（2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同证券公司进行综合评价和选择，与其签订交易单元租用协议。

2、本基金租用的证券公司交易单元变更情况：新增国联证券交易单元 2 个、减少中泰证券交易单元 2 个，减少宏信证券交易单元 1 个。

3、上表的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《上海东方证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	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 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
东方证 券	1,037,210, 567.41	78.79	47,125,850,0 00.00	99.55	—	—
华泰证 券	104,670,15 5.26	7.95	—	—	—	—
广发证 券	—	—	—	—	—	—
西部证 券	—	—	—	—	—	—
海通证 券	21,612,634 .18	1.64	—	—	—	—
民生证 券	32,190,799 .18	2.45	133,000,000. 00	0.28	—	—
方正证 券	20,163,197 .26	1.53	20,000,000.0 0	0.04	—	—
兴业证 券	43,680,982 .58	3.32	17,000,000.0 0	0.04	—	—
中信建 投证券	19,912,273 .48	1.51	24,300,000.0 0	0.05	—	—
申万宏 源	1,400,833. 26	0.11	6,500,000.00	0.01	—	—
国泰君 安	7,568,037. 46	0.57	11,000,000.0 0	0.02	—	—
东吴证 券	967,597.89	0.07	—	—	—	—
华创证 券	—	—	—	—	—	—
西南证 券	1,060,000. 00	0.08	—	—	—	—
天风证 券	25,938,203 .57	1.97	—	—	—	—
财通证 券	—	—	—	—	—	—
长江证 券	—	—	—	—	—	—
东方财 富证券	—	—	—	—	—	—
高盛中 国证券	—	—	—	—	—	—
光大证 券	—	—	—	—	—	—
国金证	—	—	—	—	—	—

券						
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华兴证 券	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 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	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 5 日
2	东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 日
3	东方红智逸沪港深定期开放混合型	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 日

	发起式证券投资基金招募说明书 (更新)(2024 年第 1 号)		
4	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金 2023 年第 4 季 度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于 旗下部分基金在直销平台调整赎回 数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 28 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于 旗下部分基金 2024 年非港股通交 易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 26 日
7	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金 2023 年年度报 告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
8	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金 2024 年第 1 季 度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
9	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金期间开放期 (2024 年 5 月 17 至 2024 年 5 月 30 日) 开放申购、赎回及转换业务的 公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 8 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于 旗下部分基金 2024 年非港股通交 易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 13 日
11	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 29 日
12	上海东方证券资产管理有限公司关于 旗下部分基金修改托管协议的公 告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 29 日
13	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金招募说明书 (更新)(2024 年第 2 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 3 日
14	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金基金产品资料 概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 日
15	上海东方证券资产管理有限公司关于 旗下部分基金 2024 年非港股通交 易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 27 日
16	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金 2024 年第 2 季 度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 7 月 19 日
17	东方红智逸沪港深定期开放混合型 发起式证券投资基金 2024 年中期报	中国证监会规定媒介	2024 年 8 月 30 日

	告		
18	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日申购、赎回、转换和定期定额投资业务申请不予确认的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 9 月 6 日
19	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 9 月 13 日
20	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 19 日
21	东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 10 月 25 日
22	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 12 月 24 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,亦可通过公司网站查阅,公司网址为:
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2025 年 3 月 31 日