

华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54

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	55
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§ 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	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	67
§ 10	开放式基金份额变动	67
§ 11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8	其他重大事件	73
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
§ 13	备查文件目录	75
13.1	备查文件目录	75
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安幸福生活混合型证券投资基金	
基金简称	华安幸福生活混合	
基金主代码	005136	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 10 月 26 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	229,674,783.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C
下属分级基金的交易代码	005136	014990
报告期末下属分级基金的份额总额	227,247,312.32 份	2,427,471.09 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨牧云	王小飞
	联系电话	021-38969999	021-60637103
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637228
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼	北京市西城区金融大街 25 号

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C
本期已实现收益	166,691,739.44	866,434.06	19,767,998.53	276,916.35	131,117,175.85	122,359.61
本期利润	282,477,163.91	906,500.93	24,661,129.23	1,770,543.11	114,772,165.86	118,153.39
加权平均基金份额本期利润	1.0117	0.9901	0.0691	-0.3974	-0.2915	-0.2922
本期加权平均净值利润率	46.80%	40.51%	3.63%	-20.80%	-14.33%	-14.37%
本期基金份额净值增长率	56.70%	55.77%	4.41%	3.80%	-14.86%	-15.37%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	期末可供分配利润	280,910,476.58	2,862,312.79	185,835,520.61	378,560.99	192,403,356.16
期末可供分配基金份额利润	1.2361	1.1791	0.5821	0.5514	0.5261	0.5074
期末基金资产净值	662,058,983.39	6,918,554.13	593,519,426.64	1,256,151.58	651,218,614.41	617,596.28
期末基金份额净值	2.9134	2.8501	1.8592	1.8297	1.7806	1.7628
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	基金份额累计净值增长率	191.34%	34.00%	85.92%	-13.98%	78.06%

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

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

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

4、本基金 2022 年 05 月 10 日起新增 C 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安幸福生活混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.40%	1.74%	0.07%	0.81%	3.33%	0.93%
过去六个月	49.47%	1.77%	15.36%	0.76%	34.11%	1.01%
过去一年	56.70%	1.66%	16.27%	0.81%	40.43%	0.85%
过去三年	39.30%	1.49%	19.06%	0.89%	20.24%	0.60%

过去五年	14.93%	1.57%	-1.27%	0.91%	16.20%	0.66%
自基金合同生效起至今	191.34%	1.48%	17.75%	0.97%	173.59%	0.51%

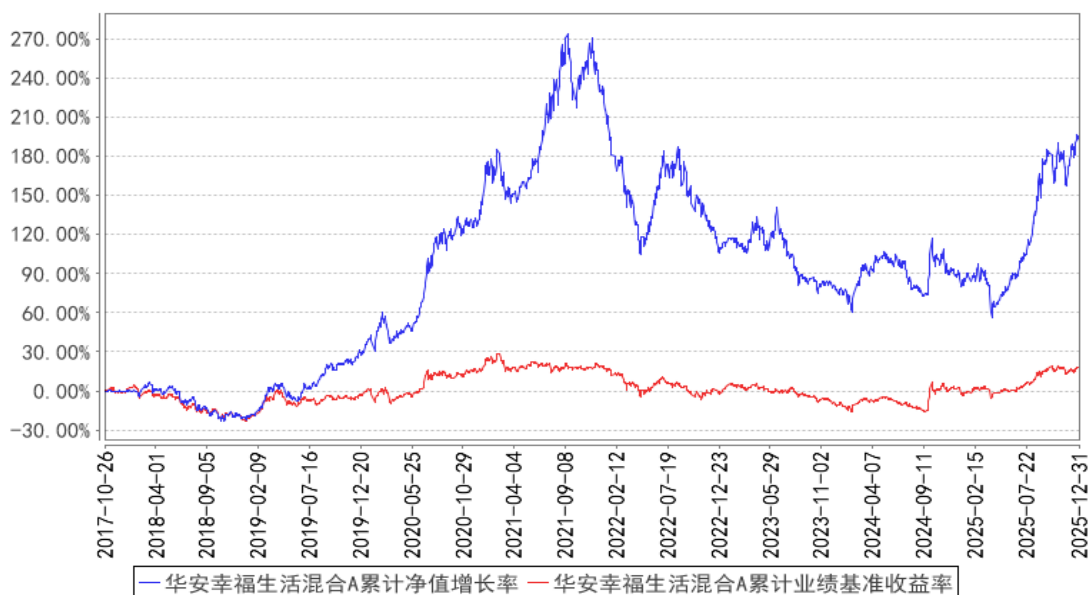
华安幸福生活混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.24%	1.74%	0.07%	0.81%	3.17%	0.93%
过去六个月	49.02%	1.77%	15.36%	0.76%	33.66%	1.01%
过去一年	55.77%	1.66%	16.27%	0.81%	39.50%	0.85%
过去三年	36.83%	1.49%	19.06%	0.89%	17.77%	0.60%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	34.00%	1.50%	19.05%	0.88%	14.95%	0.62%

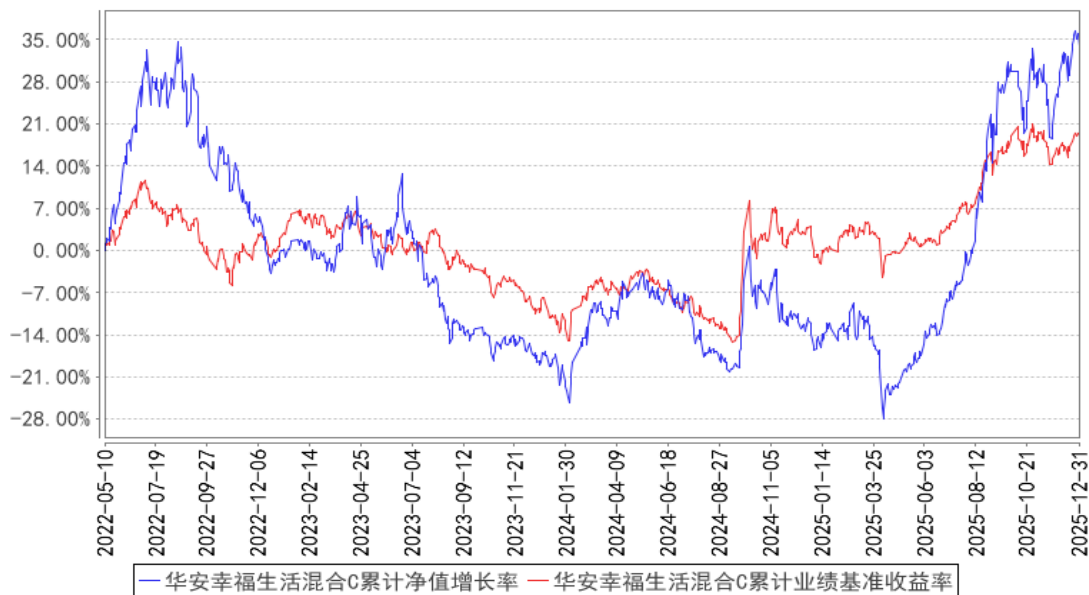
注：本基金 2022 年 5 月 10 日起新增 C 类基金份额。

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

华安幸福生活混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



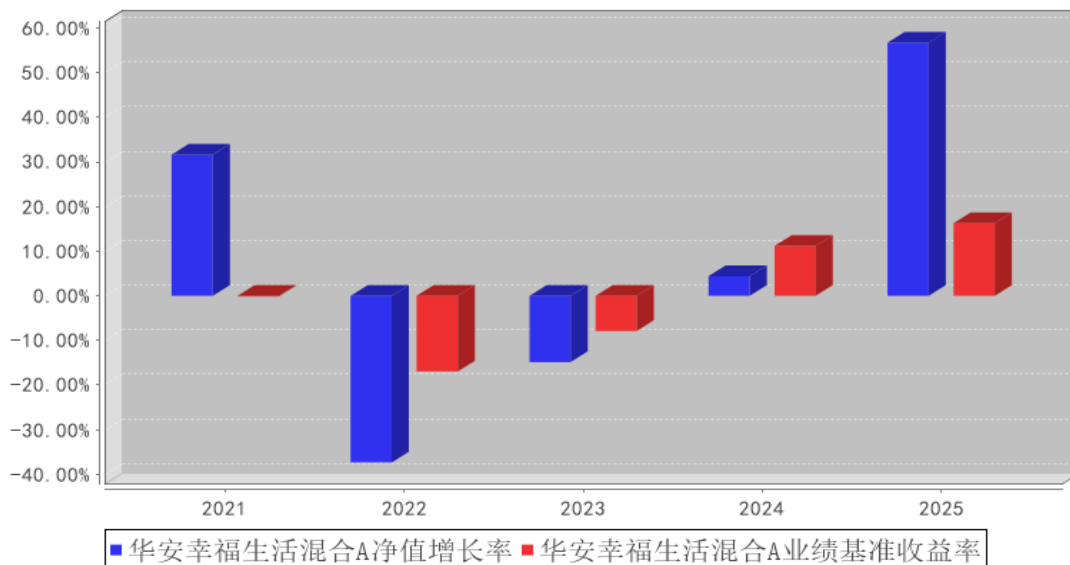
华安幸福生活混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



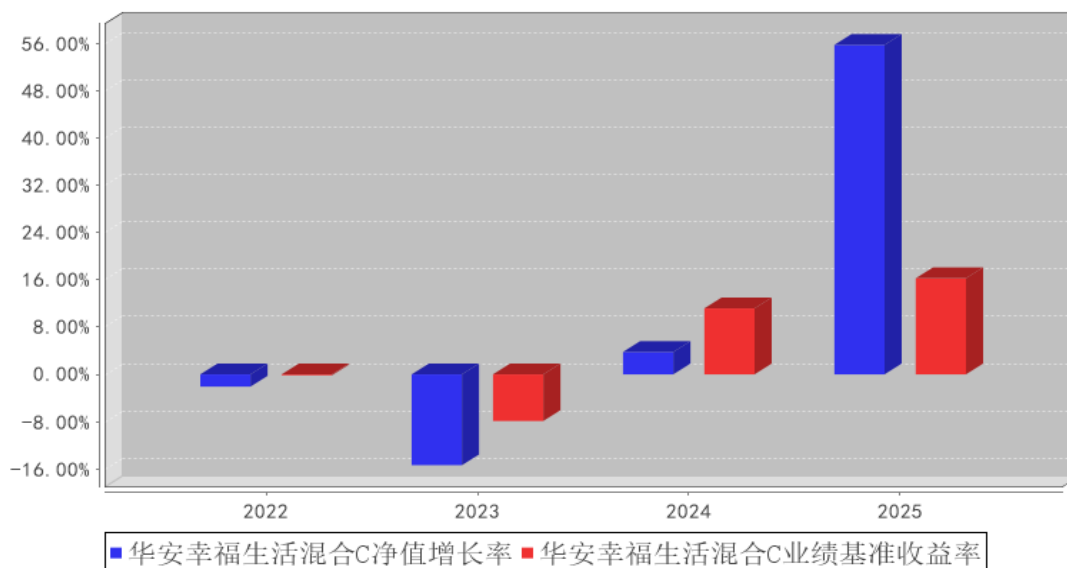
注：华安幸福生活混合型证券投资基金自 2022 年 5 月 10 日起新增 C 类基金份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安幸福生活混合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



华安幸福生活混合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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本1.5亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海国际集团投资有限公司、国泰君安投资管理股份有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和上海锦江国际投资管理有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至2025年12月31日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金ETF、华安沪港深外延增长灵活配置混合、华安美元收益等293只证券投资基金，管理资产规模达到8,141.24亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔涛	本基金的基金经理	2021年1月11日	-	13年	硕士研究生，13年基金行业从业经验，曾任国海富兰克林基金管理有限公司研究

					<p>员、汇添富基金管理股份有限公司行业分析师。2017 年 12 月加入华安基金，历任投资研究部研究员、基金投资部基金经理助理。2021 年 1 月起担任华安幸福生活混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起，同时担任华安动力领航混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，

根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为2次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年，市场先抑后扬，在经历了美国发起的关税战后走出上行趋势。我们在本年度的投资运作主要是布局了高景气的海外算力产业链、游戏、海外风电、两轮车等行业。大部分投资方向都取得了正收益及超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，本基金A类份额净值为2.9134元，C类份额净值为2.8501元，本报告期A类份额净值增长率为56.70%，同期业绩比较基准增长率为16.27%，C类份额净值增长率为55.77%，同期业绩比较基准增长率为16.27%。

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2026年，全球宏观经济、地缘政治等仍有不确定性因素。发达国家经济体尤其是美国的债务水平较高，其经济增长水平需要通过较为激进的财政政策维持。中国的经济总体平稳，部分产业有结构性亮点。在不确定的环境中，我们的投资布局主要集中在景气度较高的行业。

首要关注的仍然是 AI 产业。美国继续加大 AI 基础设施的投入，以四大云厂商为首的企业预计 2026 年在 AI 领域的资本开支保持高增长。从算力芯片到通信网络到存储芯片再到电力能源，都将保持旺盛的需求，部分环节甚至出现了供不应求的情况。半导体产业链的存储芯片、设备等细分环节都将受益于 AI 的快速发展。

在 AI 产业链以外，我们重点关注出海相关的方向。包括海外风电、两轮车、电力设备、机械设备等。海外风电需求旺盛，部分环节竞争格局良好。欧洲两轮车行业的中国品牌市占率仍然不高，空间较大。电力设备伴随着本轮需求的高景气，国内企业得以进入欧美发达国家的供应链。机械设备主要看好一带一路等国家的拓展。

除此以外，资源品也是我们重点关注的方向。黄金、白银价格维持高位，铜、铝、钨等品种供给增长缓慢，镍、钴、稀土等品种受到相关国家政策限制，导致供应紧张。总之，相关有色品种在供给大规模扩张前，价格有望保持高位。

综上，我们看好的投资方向集中在 AI、出海、有色等方向，将积极寻找相关投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

公司定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估、内部控制评价，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平有效提升，保障公司稳健经营。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P01175 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华安幸福生活混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了华安幸福生活混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安幸福生活混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华安幸福生活混合型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也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</p>

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安幸福生活混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华安幸福生活混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华安幸福生活混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华安幸福生活混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安幸福生活混合型证券投资基金不能持续经营。</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>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪芳	冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安幸福生活混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	61,199,057.53	78,505,608.59
结算备付金		2,516,942.98	2,740,603.28
存出保证金		331,721.43	286,107.37
交易性金融资产	7.4.7.2	616,514,675.68	507,029,434.33
其中：股票投资		616,514,675.68	507,029,434.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	14,056,410.35
应收股利		-	-
应收申购款		125,479.70	36,622.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		680,687,877.32	602,654,786.42
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,980,718.28	3,884,765.16
应付赎回款		1,933,852.41	1,657,423.93
应付管理人报酬		691,534.47	628,632.92
应付托管费		115,255.73	104,772.14
应付销售服务费		2,980.65	1,925.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,985,998.26	1,601,688.54
负债合计		11,710,339.80	7,879,208.20
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	229,674,783.41	319,927,537.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	439,302,754.11	274,848,040.78
净资产合计		668,977,537.52	594,775,578.22
负债和净资产总计		680,687,877.32	602,654,786.42

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 229,674,783.41 份，其中 A 类基金份额净值 2.9134 元，基金份额总额 227,247,312.32 份；C 类基金份额净值 2.8501 元，基金份额总额 2,427,471.09 份。

7.2 利润表

会计主体：华安幸福生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		292,077,779.23	32,763,612.25
1. 利息收入		224,270.92	294,436.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	224,270.92	294,436.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		175,957,340.87	29,393,176.45
其中：股票投资收益	7.4.7.10	168,183,081.48	13,267,621.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	520,319.19	60,305.01
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收	7.4.7.13	-	-
益			
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,253,940.20	16,065,250.38
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	7.4.7.16	115,825,491.34	2,845,671.24
（损失以“-”号填			
列）			
4. 汇兑收益（损失以		-	-
“-”号填列）			
5. 其他收入（损失以	7.4.7.17	70,676.10	230,328.41
“-”号填列）			
减：二、营业总支出		8,694,114.39	9,873,026.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,270,998.05	8,250,231.88
其中：暂估管理人报		-	-
酬			
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,211,833.04	1,375,038.59
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	13,426.08	49,711.69
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融		-	-
资产支出			
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.63	0.19
8. 其他费用	7.4.7.19	197,856.59	198,043.78
三、利润总额（亏损		283,383,664.84	22,890,586.12
总额以“-”号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损		283,383,664.84	22,890,586.12
以“-”号填列）			
五、其他综合收益的		-	-
税后净额			
六、综合收益总额		283,383,664.84	22,890,586.12

7.3 净资产变动表

会计主体：华安幸福生活混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	319,927,537.44	-	274,848,040.78	594,775,578.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	319,927,537.44	-	274,848,040.78	594,775,578.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,252,754.03	-	164,454,713.33	74,201,959.30
(一)、综合收益总额	-	-	283,383,664.84	283,383,664.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-90,252,754.03	-	118,928,951.51	-209,181,705.54
其中：1. 基金申购款	22,570,168.46	-	34,114,757.83	56,684,926.29
2. 基金赎回款	-	-	-	-
	112,822,922.49		153,043,709.34	-265,866,631.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	229,674,783.41	-	439,302,754.11	668,977,537.52
项目	上年度可比期间			

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	366,085,278.24	-	285,750,932.45	651,836,210.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	366,085,278.24	-	285,750,932.45	651,836,210.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,157,740.80	-	-10,902,891.67	-57,060,632.47
(一)、综合收益总额	-	-	22,890,586.12	22,890,586.12
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-46,157,740.80	-	-33,793,477.79	-79,951,218.59
其中：1. 基金申购款	63,406,098.90	-	62,270,323.48	125,676,422.38
2. 基金赎回款	-	-	-96,063,801.27	-205,627,640.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	319,927,537.44	-	274,848,040.78	594,775,578.22

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：

徐勇

任志浩

童欣

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

华安幸福生活混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1535号《关于准予华安幸福生活混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2017年10月26日生效,首次设立募集为3,844,867,784.03份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%;投资于本基金界定的“幸福生活”相关的证券的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,本基金的投资范围相应调整。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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

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

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同

资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

(2) 投资收益

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

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

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

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

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

(3) 公允价值变动收益

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

(4) 信用减值损失

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

(5) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现

金流量折现法等估值技术进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复缴纳增值税;取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息红利所得,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,解禁后取得的股息红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5)对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税;自 2023 年 8 月 28 日起,出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	61,199,057.53	78,505,608.59
等于: 本金	61,193,313.65	78,496,364.35
加: 应计利息	5,743.88	9,244.24
定期存款	-	-
等于: 本金	-	-
加: 应计利息	-	-

其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	61,199,057.53	78,505,608.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	493,730,213.94	-	616,514,675.68	122,784,461.74
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	493,730,213.94	-	616,514,675.68	122,784,461.74
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	500,070,463.93	-	507,029,434.33	6,958,970.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	500,070,463.93	-	507,029,434.33	6,958,970.40

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,308.32	134.28
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,824,689.94	1,441,554.26
其中：交易所市场	1,824,689.94	1,441,554.26
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	1,985,998.26	1,601,688.54

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华安幸福生活混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,241,009.23	319,241,009.23
本期申购	19,604,357.06	19,604,357.06
本期赎回（以“-”号填列）	-111,598,053.97	-111,598,053.97
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	227,247,312.32	227,247,312.32

华安幸福生活混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	686,528.21	686,528.21
本期申购	2,965,811.40	2,965,811.40
本期赎回(以“-”号填列)	-1,224,868.52	-1,224,868.52
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	2,427,471.09	2,427,471.09

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

华安幸福生活混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	185,835,520.61	88,442,896.80	274,278,417.41
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	185,835,520.61	88,442,896.80	274,278,417.41
本期利润	166,691,739.44	115,785,424.47	282,477,163.91
本期基金份额交易产生的变动数	-71,616,783.47	-50,327,126.78	-121,943,910.25
其中：基金申购款	18,100,295.41	11,675,514.63	29,775,810.04
基金赎回款	-89,717,078.88	-62,002,641.41	-151,719,720.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	280,910,476.58	153,901,194.49	434,811,671.07

华安幸福生活混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	378,560.99	191,062.38	569,623.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	378,560.99	191,062.38	569,623.37
本期利润	866,434.06	40,066.87	906,500.93
本期基金份额交易产生的变动数	1,617,317.74	1,397,641.00	3,014,958.74
其中：基金申购款	2,458,461.29	1,880,486.50	4,338,947.79
基金赎回款	-841,143.55	-482,845.50	-1,323,989.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,862,312.79	1,628,770.25	4,491,083.04

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	214,959.90	263,911.93
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	8,067.83	27,442.75
其他	1,243.19	3,081.47
合计	224,270.92	294,436.15

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	168,183,081.48	13,267,621.06
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	168,183,081.48	13,267,621.06

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	3,633,463,032.21	2,883,877,168.86
减：卖出股票成本总额	3,459,779,458.00	2,865,008,388.71
减：交易费用	5,500,492.73	5,601,159.09
买卖股票差价收入	168,183,081.48	13,267,621.06

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
债券投资收益——利息收入	178.71	57.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	520,140.48	60,247.11
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	520,319.19	60,305.01

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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1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	1,927,800.89	505,054.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,407,400.00	444,700.00
减：应计利息总额	183.93	87.12
减：交易费用	76.48	20.36
买卖债券差价收入	520,140.48	60,247.11

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,253,940.20	16,065,250.38
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	7,253,940.20	16,065,250.38

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
1. 交易性金融资产	115,825,491.34	2,845,671.24
股票投资	115,825,491.34	2,845,671.24
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	115,825,491.34	2,845,671.24

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	66,090.11	221,352.66

基金转换费收入	4,585.99	8,975.75
合计	70,676.10	230,328.41

7.4.7.18 信用减值损失

无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	640.00	646.93
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,216.59	1,396.85
合计	197,856.59	198,043.78

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：1、经中国证监会于2025年1月17日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即2025年3月14日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。

根据国泰海通证券股份有限公司于2025年4月4日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成

公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

2、本公司股东“上海上国投资产管理有限公司”自 2025 年 8 月 26 日起更名为“上海国际集团投资有限公司”。

3、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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国泰海通证券股份有限公司	156,250,987.82	2.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	352,482,942.02	4.98	1,029,436,497.89	18.18

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国泰海通证券股份有限公司	1,407,400.00	42.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	432,140.38	76.21

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰海通证券股 份有限公司	71,223.72	2.21	-	-
国泰君安证券股 份有限公司	160,695.71	4.98	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安证券股 份有限公司	726,516.70	19.14	225,037.29	15.61

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,270,998.05	8,250,231.88
其中：应支付销售机构的客户维 护费	3,093,201.80	3,447,444.22
应支付基金管理人的净管理费	4,177,796.25	4,802,787.66

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,211,833.04	1,375,038.59

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	198.76	198.76
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	198.76	198.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	170.81	170.81
中国建设银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	170.81	170.81

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按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华安幸福生活混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 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 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
国泰君安 投资管理 股份有限 公司	-	-	10,206,242.86	3.19

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	61,199,057.53	214,959.90	78,505,608.59	263,911.93

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	001221	悍高集团	网下申购	1,594	24,595.42
国泰海通证券股份有限公司	301656	联合动力	网下申购	12,879	160,729.92
国泰海通证券股份有限公司	688729	屹唐股份	网下申购	22,227	187,818.15
国泰海通证券股份有限公司	688765	禾元生物	网下申购	5,300	154,018.00
国泰君安证券股份有限公司	688545	兴福电子	网下申购	9,940	116,099.20
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	601033	永兴股份	网下申购	7,740	125,388.00
国泰君安证券股份有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安证券股份有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
国泰君安证券股份有限公司	301607	富特科技	网下申购	2,567	35,938.00
国泰君安证券股份有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,872	74,672.00
国泰君安证券股份有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
国泰君安证券股份有限公司	301571	国科天成	网下申购	3,499	38,978.86
国泰君安证券股份有限公司	301556	托普云农	网下申购	2,663	38,613.50
国泰君安证券股份有限公司	603194	中力股份	网下申购	2,904	59,009.28

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股限售	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股限售	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股限售	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股限售	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025 年 9 月 18 日	6 个月	新股限售	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股限售	12.48	25.46	3,864	48,222.72	98,377.44	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股限售	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股限售	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-

603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股限售	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股限售	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股限售	8.45	24.28	2,223	18,784.35	53,974.44	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股限售	17.78	25.11	465	8,267.70	11,676.15	-
688765	禾元生物	2025年10月16日	6个月	新股限售	29.06	52.62	2,385	69,308.10	125,498.70	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月	新股限售	83.06	117.19	400	33,224.00	46,876.00	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股限售	114.28	416.02	2,215	253,130.20	921,484.30	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股限售	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股限售	104.66	399.40	1,664	174,154.24	664,601.60	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新股限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股限售	85.09	203.31	184	15,656.56	37,409.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、审计委员会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式

借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因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的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对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	61,199,057.53	-	-	-	61,199,057.53
结算备付金	2,516,942.98	-	-	-	2,516,942.98

存出保证金	331,721.43	-	-	-	331,721.43
交易性金融资产	-	-	-	-616,514,675.68	616,514,675.68
应收申购款	-	-	-	125,479.70	125,479.70
资产总计	64,047,721.94	-	-	-616,640,155.38	680,687,877.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,933,852.41	1,933,852.41
应付管理人报酬	-	-	-	691,534.47	691,534.47
应付托管费	-	-	-	115,255.73	115,255.73
应付清算款	-	-	-	6,980,718.28	6,980,718.28
应付销售服务费	-	-	-	2,980.65	2,980.65
其他负债	-	-	-	1,985,998.26	1,985,998.26
负债总计	-	-	-	11,710,339.80	11,710,339.80
利率敏感度缺口	64,047,721.94	-	-	-604,929,815.58	668,977,537.52
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	78,505,608.59	-	-	-	78,505,608.59
结算备付金	2,740,603.28	-	-	-	2,740,603.28
存出保证金	286,107.37	-	-	-	286,107.37
交易性金融资产	-	-	-	-507,029,434.33	507,029,434.33
应收申购款	-	-	-	36,622.50	36,622.50
应收清算款	-	-	-	14,056,410.35	14,056,410.35
资产总计	81,532,319.24	-	-	-521,122,467.18	602,654,786.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,657,423.93	1,657,423.93
应付管理人报酬	-	-	-	628,632.92	628,632.92
应付托管费	-	-	-	104,772.14	104,772.14
应付清算款	-	-	-	3,884,765.16	3,884,765.16
应付销售服务费	-	-	-	1,925.51	1,925.51
其他负债	-	-	-	1,601,688.54	1,601,688.54
负债总计	-	-	-	7,879,208.20	7,879,208.20
利率敏感度缺口	81,532,319.24	-	-	-513,243,258.98	594,775,578.22

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 60-95%；投资于本基金界定的“幸福生活”相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	616,514,675.68	92.16	507,029,434.33	85.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	616,514,675.68	92.16	507,029,434.33	85.25

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	54,127,474.71	33,060,525.02
业绩比较基准下降5%	-54,127,474.71	-33,060,525.02	

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	614,334,055.52	506,475,724.47
第二层次	-	27,736.50
第三层次	2,180,620.16	525,973.36
合计	616,514,675.68	507,029,434.33

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值

列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025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	-	525,973.36	525,973.36
当期购买	-	800,052.61	800,052.61
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,855,752.30	2,855,752.30
当期利得或损失总额	-	3,710,346.49	3,710,346.49
其中：计入损益的利得或损失	-	3,710,346.49	3,710,346.49
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,180,620.16	2,180,620.16
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	-	1,462,302.27	1,462,302.27
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,565,960.57	1,565,960.57
当期购买	-	461,997.74	461,997.74
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,986,100.37	3,986,100.37
当期利得或损失总额	-	2,484,115.42	2,484,115.42
其中：计入损益的利得或损失	-	2,484,115.42	2,484,115.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	525,973.36	525,973.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	315,142.62	315,142.62

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资(2024 年 12 月 31 日：同)。于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资(2024 年度：同)。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	2,180,620.16	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%~303.23%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	525,973.36	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%~574.44%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	616,514,675.68	90.57
	其中：股票	616,514,675.68	90.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	63,716,000.51	9.36
8	其他各项资产	457,201.13	0.07
9	合计	680,687,877.32	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,159,234.92	0.92
C	制造业	567,218,537.73	84.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	753,057.00	0.11
E	建筑业	612,181.55	0.09
F	批发和零售业	309,866.91	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,542,491.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	19,816,927.23	2.96

	务业		
J	金融业	17,533,627.59	2.62
K	房地产业	757,630.00	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,028,404.75	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	11,808.00	0.00
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	214,353.00	0.03
S	综合	556,556.00	0.08
	合计	616,514,675.68	92.16

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	102,100	62,281,000.00	9.31
2	300502	新易盛	120,620	51,972,745.60	7.77
3	002487	大金重工	950,100	49,338,693.00	7.38
4	300604	长川科技	385,100	39,014,481.00	5.83
5	300850	新强联	769,200	31,821,804.00	4.76
6	002028	思源电气	200,700	31,026,213.00	4.64
7	600183	生益科技	401,800	28,692,538.00	4.29
8	605196	华通线缆	805,586	27,986,057.64	4.18
9	002371	北方华创	58,790	26,989,313.20	4.03
10	000807	云铝股份	805,900	26,465,756.00	3.96
11	002353	杰瑞股份	315,800	22,368,114.00	3.34
12	000893	亚钾国际	438,100	21,015,657.00	3.14
13	605060	联德股份	499,751	18,470,796.96	2.76
14	002536	飞龙股份	601,000	17,849,700.00	2.67
15	002602	世纪华通	996,700	17,003,702.00	2.54
16	002142	宁波银行	589,751	16,566,105.59	2.48
17	002240	盛新锂能	430,100	14,808,343.00	2.21
18	002478	常宝股份	1,381,300	11,699,611.00	1.75
19	300037	新宙邦	215,000	11,266,000.00	1.68
20	000792	盐湖股份	292,700	8,242,432.00	1.23
21	002731	萃华珠宝	623,200	7,827,392.00	1.17
22	603129	春风动力	27,800	7,747,304.00	1.16
23	688275	万润新能	95,687	7,214,799.80	1.08

24	301345	涛涛车业	24,100	6,056,812.00	0.91
25	002916	深南电路	15,800	3,670,182.00	0.55
26	603026	石大胜华	46,900	3,508,589.00	0.52
27	603993	洛阳钼业	173,400	3,468,000.00	0.52
28	300750	宁德时代	5,600	2,056,656.00	0.31
29	603799	华友钴业	29,900	2,040,974.00	0.31
30	688795	摩尔线程	2,215	921,484.30	0.14
31	002463	沪电股份	11,500	840,305.00	0.13
32	600246	万通发展	61,100	751,530.00	0.11
33	600989	宝丰能源	36,200	710,606.00	0.11
34	600938	中国海油	22,500	679,050.00	0.10
35	688802	沐曦股份	1,664	664,601.60	0.10
36	601001	晋控煤业	49,700	653,555.00	0.10
37	603019	中科曙光	7,600	650,864.00	0.10
38	300772	运达股份	33,300	634,698.00	0.09
39	601857	中国石油	59,200	616,272.00	0.09
40	603259	药明康德	6,700	607,288.00	0.09
41	300476	胜宏科技	2,100	603,918.00	0.09
42	300343	ST 联创	100,000	603,000.00	0.09
43	300432	富临精工	34,300	572,810.00	0.09
44	002460	赣锋锂业	9,100	572,299.00	0.09
45	000833	粤桂股份	28,600	556,556.00	0.08
46	300679	电连技术	11,100	540,348.00	0.08
47	002080	中材科技	14,500	526,930.00	0.08
48	601333	广深铁路	166,800	507,072.00	0.08
49	600958	东方证券	45,700	498,130.00	0.07
50	688521	芯原股份	3,571	489,119.87	0.07
51	601567	三星医疗	21,073	485,100.46	0.07
52	601127	赛力斯	3,886	470,050.56	0.07
53	601601	中国太保	11,200	469,392.00	0.07
54	002983	芯瑞达	20,200	463,590.00	0.07
55	600522	中天科技	25,500	462,060.00	0.07
56	688809	强一股份	1,837	461,899.44	0.07
57	601138	工业富联	7,400	459,170.00	0.07
58	601919	中远海控	29,700	450,846.00	0.07
59	601702	华峰铝业	21,900	448,293.00	0.07
60	000977	浪潮信息	6,707	446,686.20	0.07
61	300454	深信服	3,860	444,517.60	0.07
62	600536	中国软件	9,500	439,850.00	0.07
63	300866	安克创新	3,820	436,969.80	0.07
64	301377	鼎泰高科	3,100	431,210.00	0.06
65	301230	泓博医药	13,500	403,245.00	0.06
66	603179	新泉股份	5,100	376,788.00	0.06

67	600428	中远海特	52,700	374,170.00	0.06
68	601668	中国建筑	72,720	373,053.60	0.06
69	688122	西部超导	4,786	356,939.88	0.05
70	603486	科沃斯	4,400	354,992.00	0.05
71	688778	厦钨新能	4,522	349,867.14	0.05
72	002155	湖南黄金	16,380	345,454.20	0.05
73	600150	中国船舶	10,000	332,600.00	0.05
74	301035	润丰股份	4,700	319,647.00	0.05
75	688059	华锐精密	4,048	318,577.60	0.05
76	688563	航材股份	5,416	316,565.20	0.05
77	002241	歌尔股份	10,900	313,157.00	0.05
78	600285	羚锐制药	15,100	312,721.00	0.05
79	600011	华能国际	41,200	307,352.00	0.05
80	603393	新天然气	11,500	305,785.00	0.05
81	300785	值得买	6,961	305,031.02	0.05
82	600546	山煤国际	29,100	293,619.00	0.04
83	603290	斯达半导	2,800	269,052.00	0.04
84	688588	凌志软件	18,616	266,394.96	0.04
85	002540	亚太科技	37,449	265,138.92	0.04
86	688169	石头科技	1,665	253,179.90	0.04
87	301210	金杨精密	6,811	247,920.40	0.04
88	300634	彩讯股份	9,800	247,254.00	0.04
89	300705	九典制药	15,674	234,796.52	0.04
90	688526	科前生物	15,025	229,281.50	0.03
91	600521	华海药业	13,500	229,095.00	0.03
92	605080	浙江自然	9,900	227,700.00	0.03
93	603267	鸿远电子	4,100	223,163.00	0.03
94	002050	三花智控	4,000	221,240.00	0.03
95	002138	顺络电子	6,100	216,733.00	0.03
96	300896	爱美客	1,500	212,580.00	0.03
97	688408	中信博	5,003	210,676.33	0.03
98	601111	中国国航	22,400	209,888.00	0.03
99	600699	均胜电子	6,600	206,976.00	0.03
100	603678	火炬电子	5,808	205,138.56	0.03
101	300863	卡倍亿	4,060	204,624.00	0.03
102	301004	嘉益股份	3,820	198,831.00	0.03
103	688010	福光股份	6,346	197,487.52	0.03
104	300820	英杰电气	4,100	196,595.00	0.03
105	002126	银轮股份	5,200	196,560.00	0.03
106	600276	恒瑞医药	3,293	196,164.01	0.03
107	003000	劲仔食品	16,900	192,491.00	0.03
108	002429	兆驰股份	25,400	188,468.00	0.03
109	300373	扬杰科技	2,700	183,600.00	0.03

110	001222	源飞宠物	7,600	179,816.00	0.03
111	300919	中伟股份	3,800	176,054.00	0.03
112	605286	同力天启	4,100	166,501.00	0.02
113	600111	北方稀土	3,600	166,032.00	0.02
114	000403	派林生物	12,090	165,512.10	0.02
115	002475	立讯精密	2,900	164,459.00	0.02
116	000733	振华科技	3,100	162,471.00	0.02
117	300130	新国都	5,800	160,834.00	0.02
118	000034	神州数码	4,107	159,803.37	0.02
119	688658	悦康药业	6,906	156,144.66	0.02
120	688981	中芯国际	1,269	155,871.27	0.02
121	301459	丰茂股份	3,482	154,531.16	0.02
122	300351	永贵电器	8,400	151,452.00	0.02
123	002291	遥望科技	22,600	144,414.00	0.02
124	000543	皖能电力	17,600	139,920.00	0.02
125	000963	华东医药	3,500	138,075.00	0.02
126	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.02
127	000915	华特达因	4,000	132,160.00	0.02
128	300451	创业慧康	26,565	128,574.60	0.02
129	300568	星源材质	8,400	128,100.00	0.02
130	603444	吉比特	300	127,155.00	0.02
131	300364	中文在线	5,000	125,600.00	0.02
132	688765	禾元生物	2,385	125,498.70	0.02
133	300593	新雷能	4,000	119,040.00	0.02
134	300953	震裕科技	700	117,614.00	0.02
135	300879	大叶股份	3,900	116,415.00	0.02
136	000032	深桑达 A	5,977	115,654.95	0.02
137	601390	中国中铁	21,300	115,233.00	0.02
138	688376	美埃科技	1,956	113,095.92	0.02
139	301327	华宝新能	1,960	113,033.20	0.02
140	603600	永艺股份	9,500	112,765.00	0.02
141	603338	浙江鼎力	1,937	109,711.68	0.02
142	301269	华大九天	1,000	106,330.00	0.02
143	002335	科华数据	1,900	105,507.00	0.02
144	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.02
145	600559	老白干酒	6,300	101,052.00	0.02
146	603185	弘元绿能	3,300	100,650.00	0.02
147	600732	爱旭股份	7,500	100,500.00	0.02
148	301656	联合动力	3,864	98,377.44	0.01
149	000887	中鼎股份	4,200	97,482.00	0.01
150	603927	中科软	4,952	94,533.68	0.01
151	688378	奥来德	3,388	92,492.40	0.01
152	601595	上海电影	3,100	88,753.00	0.01

153	603297	永新光学	791	83,292.30	0.01
154	603197	保隆科技	1,900	70,281.00	0.01
155	002283	天润工业	11,100	69,264.00	0.01
156	300580	贝斯特	2,535	66,645.15	0.01
157	300408	三环集团	1,400	64,050.00	0.01
158	603005	晶方科技	2,300	63,618.00	0.01
159	300973	立高食品	1,300	55,900.00	0.01
160	688729	屹唐股份	2,223	53,974.44	0.01
161	300726	宏达电子	1,000	50,910.00	0.01
162	688790	昂瑞微	400	46,876.00	0.01
163	002991	甘源食品	700	39,837.00	0.01
164	002897	意华股份	700	37,849.00	0.01
165	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
166	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
167	603890	春秋电子	1,000	16,130.00	0.00
168	300674	宇信科技	600	14,556.00	0.00
169	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
170	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
171	000888	峨眉山 A	900	11,808.00	0.00
172	688759	必贝特	465	11,676.15	0.00
173	300695	兆丰股份	100	10,006.00	0.00
174	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
175	300193	佳士科技	1,000	8,950.00	0.00
176	601800	中国交建	1,000	8,240.00	0.00
177	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
178	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
179	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
180	002483	润邦股份	1,000	7,140.00	0.00
181	300769	德方纳米	160	7,041.60	0.00
182	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
183	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
184	600048	保利发展	1,000	6,100.00	0.00
185	688088	虹软科技	111	5,494.50	0.00
186	603035	常熟汽饰	100	1,547.00	0.00
187	601816	京沪高铁	100	515.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300850	新强联	72,354,607.61	12.17
2	300502	新易盛	67,444,176.00	11.34
3	002536	飞龙股份	64,657,168.00	10.87

4	603129	春风动力	59,433,141.00	9.99
5	002916	深南电路	57,963,544.40	9.75
6	300476	胜宏科技	55,935,432.71	9.40
7	000977	浪潮信息	52,767,707.61	8.87
8	300604	长川科技	51,384,130.24	8.64
9	603259	药明康德	49,585,696.00	8.34
10	002080	中材科技	43,826,384.00	7.37
11	603185	弘元绿能	43,486,907.36	7.31
12	600183	生益科技	41,680,982.00	7.01
13	002353	杰瑞股份	41,565,251.00	6.99
14	002126	银轮股份	40,043,020.96	6.73
15	000792	盐湖股份	38,623,667.00	6.49
16	002602	世纪华通	37,912,825.00	6.37
17	601138	工业富联	37,313,450.00	6.27
18	605060	联德股份	36,409,589.67	6.12
19	002487	大金重工	34,864,152.00	5.86
20	605196	华通线缆	34,733,707.00	5.84
21	688275	万润新能	34,166,203.87	5.74
22	002558	巨人网络	33,434,197.38	5.62
23	000807	云铝股份	33,157,104.50	5.57
24	301345	涛涛车业	33,093,265.12	5.56
25	003033	征和工业	32,759,139.00	5.51
26	002050	三花智控	32,219,856.00	5.42
27	301377	鼎泰高科	30,920,388.09	5.20
28	300274	阳光电源	29,350,017.00	4.93
29	002371	北方华创	29,161,837.05	4.90
30	002768	国恩股份	29,050,551.00	4.88
31	601689	拓普集团	28,857,052.85	4.85
32	603766	隆鑫通用	28,329,558.00	4.76
33	688668	鼎通科技	28,179,854.95	4.74
34	000893	亚钾国际	27,838,690.00	4.68
35	002155	湖南黄金	27,441,930.00	4.61
36	603799	华友钴业	27,300,996.50	4.59
37	300308	中际旭创	27,163,108.90	4.57
38	603338	浙江鼎力	26,747,383.00	4.50
39	002028	思源电气	26,698,525.00	4.49
40	601595	上海电影	26,640,697.00	4.48
41	002142	宁波银行	26,218,997.27	4.41
42	603228	景旺电子	26,039,241.00	4.38
43	002731	萃华珠宝	25,574,774.36	4.30
44	300726	宏达电子	25,500,414.80	4.29
45	300866	安克创新	25,495,250.60	4.29
46	688401	路维光电	25,488,619.79	4.29

47	002345	潮宏基	25,243,961.82	4.24
48	301210	金杨精密	25,146,543.00	4.23
49	601333	广深铁路	25,140,114.00	4.23
50	603678	火炬电子	24,814,845.59	4.17
51	600549	厦门钨业	24,798,850.00	4.17
52	601601	中国太保	24,765,339.98	4.16
53	300373	扬杰科技	24,686,136.00	4.15
54	001222	源飞宠物	24,485,450.00	4.12
55	300037	新宙邦	24,100,406.98	4.05
56	002384	东山精密	23,983,510.00	4.03
57	605080	浙江自然	23,917,249.00	4.02
58	301459	丰茂股份	21,437,399.75	3.60
59	300777	中简科技	21,001,540.00	3.53
60	603986	兆易创新	20,824,566.00	3.50
61	300438	鹏辉能源	20,748,687.28	3.49
62	002478	常宝股份	20,638,983.00	3.47
63	688521	芯原股份	20,090,218.11	3.38
64	002008	大族激光	19,850,594.00	3.34
65	300014	亿纬锂能	19,795,784.72	3.33
66	600276	恒瑞医药	19,735,852.85	3.32
67	603444	吉比特	19,635,874.00	3.30
68	601229	上海银行	19,337,181.66	3.25
69	688800	瑞可达	19,252,171.42	3.24
70	603876	鼎胜新材	19,148,584.45	3.22
71	688526	科前生物	19,041,095.78	3.20
72	688981	中芯国际	18,431,606.88	3.10
73	000657	中钨高新	18,314,825.96	3.08
74	688008	澜起科技	17,745,756.01	2.98
75	688658	悦康药业	17,471,966.25	2.94
76	603197	保隆科技	17,374,665.80	2.92
77	300454	深信服	17,287,823.90	2.91
78	601001	晋控煤业	17,283,672.00	2.91
79	605319	无锡振华	17,185,133.00	2.89
80	605305	中际联合	16,893,526.59	2.84
81	002463	沪电股份	16,713,830.40	2.81
82	300634	彩讯股份	16,584,635.00	2.79
83	002286	保龄宝	15,926,590.00	2.68
84	002283	天润工业	15,825,344.00	2.66
85	688508	芯朋微	15,325,715.66	2.58
86	000032	深桑达 A	14,922,583.34	2.51
87	603809	豪能股份	14,769,217.89	2.48
88	301382	蜂助手	14,671,500.60	2.47
89	002240	盛新锂能	14,607,636.00	2.46

90	600150	中国船舶	14,405,300.84	2.42
91	002956	西麦食品	14,077,906.20	2.37
92	688313	仕佳光子	13,758,238.03	2.31
93	601958	金钼股份	13,718,157.45	2.31
94	300945	曼卡龙	13,533,792.00	2.28
95	002734	利民股份	13,443,028.32	2.26
96	603983	丸美生物	13,036,331.00	2.19
97	000880	潍柴重机	12,850,223.33	2.16
98	000997	新大陆	12,750,904.00	2.14
99	000833	粤桂股份	12,682,543.00	2.13
100	002448	中原内配	12,652,294.00	2.13
101	688226	威腾电气	12,504,917.98	2.10
102	300153	科泰电源	12,170,002.00	2.05

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	78,641,203.00	13.22
2	603129	春风动力	70,635,995.00	11.88
3	002916	深南电路	68,405,335.00	11.50
4	000977	浪潮信息	63,246,719.00	10.63
5	300502	新易盛	60,373,300.20	10.15
6	002463	沪电股份	58,579,152.60	9.85
7	603259	药明康德	51,581,040.50	8.67
8	002080	中材科技	50,544,512.91	8.50
9	002536	飞龙股份	46,207,785.00	7.77
10	603185	弘元绿能	44,040,652.02	7.40
11	002558	巨人网络	42,042,580.00	7.07
12	002602	世纪华通	40,247,596.00	6.77
13	002768	国恩股份	39,152,277.88	6.58
14	601138	工业富联	39,038,597.00	6.56
15	301345	涛涛车业	38,928,301.80	6.55
16	300274	阳光电源	38,719,369.56	6.51
17	300850	新强联	37,229,975.70	6.26
18	301377	鼎泰高科	37,096,430.00	6.24
19	003033	征和工业	36,182,685.00	6.08
20	300308	中际旭创	34,882,989.74	5.86
21	002126	银轮股份	33,895,375.00	5.70
22	603766	隆鑫通用	31,187,237.00	5.24
23	601398	工商银行	30,295,931.00	5.09

24	002050	三花智控	30,174,396.12	5.07
25	300866	安克创新	30,110,417.48	5.06
26	605196	华通线缆	29,721,858.00	5.00
27	002345	潮宏基	29,697,096.84	4.99
28	688401	路维光电	29,499,765.63	4.96
29	000792	盐湖股份	29,052,704.04	4.88
30	688668	鼎通科技	28,658,341.01	4.82
31	600549	厦门钨业	28,215,927.30	4.74
32	600066	宇通客车	27,568,919.00	4.64
33	300604	长川科技	27,486,218.27	4.62
34	600428	中远海特	26,927,187.00	4.53
35	002155	湖南黄金	26,904,407.00	4.52
36	603228	景旺电子	26,846,309.00	4.51
37	603799	华友钴业	26,558,932.62	4.47
38	603338	浙江鼎力	26,298,336.68	4.42
39	601919	中远海控	25,865,810.00	4.35
40	601595	上海电影	25,648,611.80	4.31
41	601229	上海银行	25,488,207.00	4.29
42	300705	九典制药	24,816,735.74	4.17
43	601333	广深铁路	24,292,925.00	4.08
44	002241	歌尔股份	24,253,505.00	4.08
45	002384	东山精密	23,991,914.00	4.03
46	601689	拓普集团	23,977,058.68	4.03
47	601601	中国太保	23,219,393.00	3.90
48	300014	亿纬锂能	23,135,525.00	3.89
49	300777	中简科技	22,889,509.23	3.85
50	603986	兆易创新	22,774,646.00	3.83
51	300438	鹏辉能源	22,720,953.00	3.82
52	688800	瑞可达	22,558,005.82	3.79
53	688313	仕佳光子	22,477,473.21	3.78
54	002008	大族激光	22,346,532.46	3.76
55	605080	浙江自然	21,989,293.00	3.70
56	300726	宏达电子	21,960,092.00	3.69
57	300373	扬杰科技	21,646,676.00	3.64
58	688275	万润新能	21,116,715.43	3.55
59	301210	金杨精密	21,054,934.00	3.54
60	001222	源飞宠物	21,047,610.88	3.54
61	603678	火炬电子	20,974,430.98	3.53
62	002353	杰瑞股份	20,721,492.00	3.48
63	601702	华峰铝业	19,924,915.00	3.35
64	601288	农业银行	19,705,454.00	3.31
65	301382	蜂助手	19,660,652.30	3.31
66	600276	恒瑞医药	19,550,025.20	3.29

67	000657	中钨高新	19,275,827.40	3.24
68	605305	中际联合	19,209,653.30	3.23
69	603876	鼎胜新材	19,198,969.45	3.23
70	605319	无锡振华	18,972,919.00	3.19
71	002734	利民股份	18,750,868.44	3.15
72	300945	曼卡龙	18,626,277.00	3.13
73	300153	科泰电源	18,422,943.00	3.10
74	688008	澜起科技	18,405,741.46	3.09
75	688981	中芯国际	17,903,337.54	3.01
76	600183	生益科技	17,744,274.64	2.98
77	002765	蓝黛科技	17,450,208.00	2.93
78	688526	科前生物	17,157,180.82	2.88
79	002286	保龄宝	16,901,837.00	2.84
80	601001	晋控煤业	16,526,920.00	2.78
81	688521	芯原股份	16,262,056.95	2.73
82	301459	丰茂股份	16,086,600.00	2.70
83	603444	吉比特	15,965,323.00	2.68
84	688658	悦康药业	15,824,441.47	2.66
85	603380	易德龙	15,691,437.46	2.64
86	601958	金钼股份	15,627,596.00	2.63
87	300454	深信服	15,516,806.00	2.61
88	601857	中国石油	15,490,261.40	2.60
89	603900	莱绅通灵	15,014,724.00	2.52
90	603809	豪能股份	14,974,473.96	2.52
91	300634	彩讯股份	14,903,865.00	2.51
92	002891	中宠股份	14,855,571.28	2.50
93	688226	威腾电气	14,836,050.71	2.49
94	601567	三星医疗	14,618,187.50	2.46
95	600150	中国船舶	14,350,016.00	2.41
96	603983	丸美生物	14,283,801.00	2.40
97	002731	萃华珠宝	14,230,430.00	2.39
98	605060	联德股份	14,092,717.00	2.37
99	000997	新大陆	14,040,931.00	2.36
100	002448	中原内配	14,028,875.00	2.36
101	002956	西麦食品	13,979,237.00	2.35
102	000032	深桑达 A	13,952,228.00	2.35
103	688591	泰凌微	13,901,677.42	2.34
104	600933	爱柯迪	13,678,558.59	2.30
105	688508	芯朋微	13,676,867.28	2.30
106	000880	潍柴重机	13,213,964.60	2.22
107	002283	天润工业	13,155,861.00	2.21
108	603197	保隆科技	12,808,806.00	2.15
109	300750	宁德时代	12,719,228.00	2.14

110	688256	寒武纪	12,551,498.11	2.11
111	300548	长芯博创	12,301,311.00	2.07
112	300383	光环新网	12,296,003.00	2.07
113	000807	云铝股份	12,226,193.00	2.06
114	601390	中国中铁	12,177,880.00	2.05
115	002444	巨星科技	11,979,162.00	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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	3,453,439,208.01
卖出股票收入（成交）总额	3,633,463,032.21

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	331,721.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	125,479.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	457,201.13

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华安幸福 生活混合 A	34,300	6,625.29	5,186,117.18	2.28	222,061,195.14	97.72
华安幸福 生活混合 C	192	12,643.08	2,152,984.06	88.69	274,487.03	11.31
合计	34,492	6,658.78	7,339,101.24	3.20	222,335,682.17	96.80

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	华安幸福生活混合 A	764,229.38	0.34
	华安幸福生活混合 C	-	-
	合计	764,229.38	0.33

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本开 放式基金	华安幸福生活混合 A	-
	华安幸福生活混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有 本开放式基金	华安幸福生活混合 A	10~50
	华安幸福生活混合 C	-
	合计	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安幸福生活混合 A	华安幸福生活混合 C
基金合同生效日 (2017 年 10 月 26 日) 基金份额总额	3,844,867,784.03	-
本报告期期初基金 份额总额	319,241,009.23	686,528.21

本报告期基金总申购份额	19,604,357.06	2,965,811.40
减：本报告期基金总赎回份额	111,598,053.97	1,224,868.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	227,247,312.32	2,427,471.09

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2025年8月28日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，朱学华先生离任本基金管理人的董事长，徐勇先生新任本基金管理人的董事长。

2025年9月27日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，谷媛媛女士离任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

中国建设银行股份有限公司研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 40,000.00 元。

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

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正、暂停受理固定收益类公募基金产品注册申请 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、人员管理、公司治理、其他问题；基金销售、财务管理
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》、《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、优化管理机制、加强事后检查等多种方式完成整改并通过监管机构检查验收。目前已恢复受理公司固定收益类公募基金产品注册。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3；高级管理人员 4；
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；2025 年 11 月 28 日；
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；中国证券监督管理委员会上海监管局；
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施；
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函；出具警示函；
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、人员管理、其他问题；基金销售、财务管理；投资运作、合规内控；其他问题；基金销售、财务管理；其他问题；财务管理；

受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》、《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》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金管理人监督管理办法〉有关问题的规定》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、优化管理机制、加强事后检查等多种方式完成整改并通过监管机构检查验收。目前已恢复受理公司固定收益类公募基金产品注册。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内无托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

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 (%)	
申万宏源	2	2,690,688,555.47	37.98	1,226,690.90	37.98	-
东北证券	1	691,306,532.30	9.76	315,174.22	9.76	-
华泰证券	2	638,716,024.92	9.02	291,186.80	9.02	-
国盛证券	1	476,901,123.72	6.73	217,418.06	6.73	-
国泰君安	3	352,482,942.02	4.98	160,695.71	4.98	-
国信证券	1	242,244,777.49	3.42	110,452.01	3.42	-
光大证券	1	234,187,154.09	3.31	106,760.45	3.31	-
中信证券	1	218,730,556.7	3.09	99,726.53	3.09	-

		8				
招商证券	4	208,209,775.24	2.94	94,920.13	2.94	-
西南证券	1	164,915,288.45	2.33	75,184.41	2.33	-
中信建投	2	160,063,163.97	2.26	72,963.25	2.26	-
国泰海通	4	156,250,987.82	2.21	71,223.72	2.21	-
海通证券	1	137,896,969.82	1.95	62,866.88	1.95	-
中金公司	2	127,622,380.79	1.80	58,182.20	1.80	-
长江证券	2	124,634,403.45	1.76	56,829.63	1.76	-
广发证券	2	121,064,205.58	1.71	55,210.15	1.71	-
银河证券	1	61,033,108.34	0.86	27,828.30	0.86	-
天风证券	2	56,248,041.60	0.79	25,646.10	0.79	-
方正证券	3	52,456,142.85	0.74	23,915.60	0.74	-
财通证券	1	46,873,127.00	0.66	21,366.34	0.66	-
中泰证券	1	37,227,168.54	0.53	16,969.66	0.53	-
瑞银证券	1	33,121,392.75	0.47	15,096.96	0.47	-
华安证券	1	32,847,378.40	0.46	14,975.10	0.46	-
兴业证券	1	18,250,310.00	0.26	8,319.87	0.26	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

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

(1) 财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；

(2) 提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持；

(3) 交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券

交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

(1) 证券公司的尽职调查

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

(2) 证券公司的准入评估

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

(3) 证券公司的审批程序

公司领导对证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：华泰证券（018780）、中金公司（397978）。

撤销交易单元的证券公司：国泰海通（43027）、万联证券（42145）、湘财证券（357000）、中银国际（24173）。

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 (%)
申万宏源	18,203.27	0.55	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	1,407,400.00	42.20	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,554,685.69	46.61	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	354,911.93	10.64	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（兴福电子）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025年1月16日
2	华安幸福生活混合型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025年1月22日
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票华大九天（301269）估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025年3月27日
4	华安基金管理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）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025年3月29日
5	华安基金管理有限公司旗下部分基金2024年年度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025年3月31日

		定媒介	
6	华安幸福生活混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 3 月 31 日
7	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日
8	华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 4 月 22 日
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（屹唐股份）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 7 月 2 日
10	华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 7 月 21 日
11	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（悍高集团）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 7 月 24 日
12	华安基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 28 日
13	华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 8 月 30 日
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中芯国际”股票估值调整的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 9 日
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（联合动力）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 18 日
16	华安幸福生活混合型证券投资基金（华安幸福生活混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 19 日
17	华安幸福生活混合型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 19 日
18	华安幸福生活混合型证券投资基金（华安幸福生活混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 19 日
19	华安基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 9 月 27 日
20	华安基金管理有限公司关于副总经	中国证监会基金电子披	2025 年 9 月 27 日

	理变更的公告	露网站和公司网站等规定媒介	
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告（禾元生物）	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 17 日
22	华安幸福生活混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 28 日
23	华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 10 月 28 日
24	关于暂停部分基金销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 22 日
25	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 29 日
26	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等规定媒介	2025 年 12 月 29 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在规定媒介上披露。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日