

年度报告

华夏精选固定收益配置基金

(依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，
同属华夏精选基金的子基金)

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

目 录

	页 码
管理及行政	1
基金管理人向基金份额持有人的报告	2
受托人向基金份额持有人的报告	3
独立审计师报告	4 - 6
已审财务报表	
全面收益表	7
财务状况表	8
基金份额持有人应占资产净值变动表	9 - 10
现金流量表	11
财务报表附注	12 - 40
投资组合列表 (未经审计)	41 - 49
投资组合持有变动表 (未经审计)	50 - 75
金融衍生工具的详情 (未经审计)	76
金融衍生工具产生的风险信息 (未经审计)	77
投资表现报表 (未经审计)	78 - 80

重要提示:

本年度报告内所载的任何意见仅反映基金管理人的意见, 可能发生变更。有关基金的更多资料, 请参阅刊载于我们网站的基金说明书:

<https://www.chinaamc.com.hk/zh-hans/product/chinaamc-select-fixed-income-allocation-fund/>

投资者制定投资决策时不得依赖本报告所载的资料。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

管理及行政

基金管理人

华夏基金(香港)有限公司
香港中环花园道 1 号
中银大厦 37 楼

基金管理人董事

甘添先生
李一梅女士
李丰名先生
孙立强先生
阳琨先生

基金管理人的法律顾问

的近律师事务所
香港中环遮打道 18 号
历山大厦 5 楼

受托人、行政管理人及基金登记机构

中银国际英国保诚信托有限公司
香港太古城
英皇道 1111 号 15 楼 1501-1507 室及 1513-1516 室

审计师

安永会计师事务所
香港鲗鱼涌
英皇道 979 号
太古坊一座 27 楼

保管人

中国银行(香港)有限公司
香港中环花园道 1 号
中国银行大厦 14 楼

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金管理人向基金份额持有人的报告

简介

华夏精选固定收益配置基金(“本子基金”)同属华夏精选基金的子基金,是按照 2012 年 1 月 12 日签订的信托契约并依据香港法律成立的伞形单位信托(经不时修订或补充)。本子基金旨在透过将本子基金不少于 70%的资产净值直接或间接投资于全球市场的固定收益及债务工具,以达致资本增值。

市场回顾

尽管 2024 年市场波动加剧,全球固定收益市场仍保持相对积极的势头。在美国经济超预期走强、美联储启动降息周期以及唐纳德·特朗普重返白宫等因素的共同作用下,股市总体表现优于债券和大宗商品。美国国债收益率持续高位震荡,而信用利差已收窄至近十年最低水平。截至 11 月末,彭博全球投资级债券指数和摩根大通亚洲信用核心指数分别累计上涨 0.46%和 7.14%。

回顾全年,全球宏观经济整体表现超出投资者于年初的预期。美国 GDP 增速再度突破 2.5%关口。美联储将首降时点从 3 月推迟至 9 月。特朗普率领共和党在美国大选中取得压倒性胜利。发达市场中,除日本央行外,大多数央行跟随美联储启动降息。但欧洲意外遭受政治与财政不确定性影响,经济增长受阻。新兴经济体普遍展现出强劲的增长势头,多国选举结果均符合预期。然而,中国经济企稳复苏的预期尚未完全兑现。值得欣慰的是,随着全球通胀回落与降息周期开启,多数投资者认为美国乃至全球经济有望实现软着陆,甚至不着陆。但世界正处于大变革之中,2025 年宏观经济环境并不明朗。

展望 2025 年,宏观经济与金融市场面临的不确定性显著上升。特朗普政府新一轮加征关税措施预计将对全球通胀和经济增长构成持续挑战。与此同时,欧美意识形态转变将带来更大的政治风险。中国经济亦将面临国内外双重压力。随着逆全球化浪潮的推进,更多市场波动与尾部风险将成为新常态。

华夏基金(香港)有限公司
2025 年 4 月 28 日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

受托人向基金份额持有人的报告

我们特此确认，我们认为，截至 2024 年 12 月 31 日止年度内，基金管理人华夏基金（香港）有限公司在所有重大方面，根据 2012 年 1 月 12 日订立的信托契约（经不时修订或补充）的规定管理了华夏精选固定收益配置基金（华夏精选基金的子基金）。

谨代表
受托人中银国际英国保诚信托有限公司

2025 年 4 月 28 日

独立审计师报告

致华夏精选固定收益配置基金的份额持有人

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，同属华夏精选基金的子基金）

财务报表审计报告

意见

我们已审计刊载于第 7 至 40 页的华夏精选固定收益配置基金（华夏精选基金（“伞基金”）的子基金，以下简称“本子基金”）的财务报表，此财务报表包括截至 2024 年 12 月 31 日止年度的全面收益表、权益变动表和现金流量表，以及财务报表附注，包括重要会计政策信息。

我们认为，该等财务报表已根据国际会计准则理事会（“IASB”）颁布的《国际财务报告会计准则》，真实而中肯地反映了本子基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况及截至该日止年度的财务业绩和现金流量。

意见的基础

我们已根据国际审计与鉴证准则理事会（“IAASB”）颁布的《国际审计准则》（“ISA”）进行审计。我们在该等准则下承担的责任已在本报告“审计师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。根据香港会计师公会颁布的《专业会计师道德守则》（“守则”），我们独立于本子基金，并已履行守则中的其他专业道德责任。我们相信，我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

财务报表及审计师报告之外的信息

本子基金的基金管理人及受托人需对其他信息负责。其他信息包括刊载于年度报告内的信息，但不包括财务报表及我们的审计师报告。

我们对财务报表的意见并不涵盖其他信息，我们亦不对该等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所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。基于我们已执行的工作，如果我们认为其他信息存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

独立审计师报告（续）

致华夏精选固定收益配置基金的份额持有人

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，同属华夏精选基金的子基金）

财务报表审计报告（续）

基金管理人及受托人就财务报表须承担的责任

本子基金的基金管理人及受托人须负责根据国际会计准则理事会颁布的《国际财务报告会计准则》编制真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的编制不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在编制财务报表时，本子基金的基金管理人及受托人负责评估本子基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非基金管理人及受托人有意将本子基金清盘或停止经营，或别无其他实际的替代方案。

另外，本子基金的基金管理人及受托人须要确保财务报表在各重大方面乃根据日期为 2012 年 1 月 12 日订立的信托契约（经不时修订或补充）的相关披露条款及香港证券及期货事务监察委员会制定的《单位信托及互惠基金守则》（“证监会守则”）附录 E 所列明之相关披露规定适当地编制。

审计师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的审计师报告。我们仅对华夏精选固定收益配置基金的受托人及基金管理人作出报告，除此以外，本报告并无其他用途。我们不会就审计师报告的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。

合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《国际审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可被视作重大。此外，我们需评估本子基金的财务报表在各重大方面是否已按照信托契约之相关披露条文及《证监会守则》附录 E 所列明之相关披露规定妥为编制。

在根据《国际审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对本子基金内部控制的有效性发表意见。

独立审计师报告（续）

致华夏精选固定收益配置基金的份额持有人

（依据香港法律以伞形基金形式成立的开放式单位信托，同属华夏精选基金的子基金）

财务报表审计报告（续）

审计师就审计财务报表承担的责任（续）

- 评价基金管理人及受托人所采用会计政策的恰当性及作出会计估计和相关披露的合理性。
- 对基金管理人及受托人采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对本子基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在审计师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是基于审计师报告日止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致本子基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否公允反映交易和事项。

关于信托契约相关披露规定以及证监会守则附录 E 的相关披露规定事宜的报告

我们认为，财务报表在所有重大方面均按照信托契约相关披露条款及证监会守则附录 E 订明的相关披露规定妥为编制。

安永会计师事务所
执业会计师
香港
2025 年 4 月 28 日

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

全面收益表

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

	附注	2024 美元	2023 美元
收入			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产产生的利息收入		7,301,185	3,044,492
银行存款利息收入		8,985	47,112
其他收入		15,420	1,127
		<u>7,325,590</u>	<u>3,092,731</u>
费用			
管理费	3(a)	(1,230,386)	(486,900)
受托人费用	3(b)	(250,225)	(112,266)
保管费用及银行费用	3(c)	(83,842)	(49,106)
审计师酬金		(14,537)	(17,437)
法律和专业服务费		(17,744)	(4,352)
交易手续费	3(d)	(20,595)	(18,090)
交易费用		(153,483)	-
其他费用		(59,606)	(81,712)
		<u>(1,830,418)</u>	<u>(769,863)</u>
减：由基金管理人承担的报销费用	3(h)	<u>240,790</u>	<u>133,297</u>
		<u>(1,589,628)</u>	<u>(636,566)</u>
投资（损失）/收益及汇兑差额前利润		<u>5,735,962</u>	<u>2,456,165</u>
投资（损失）/收益及汇兑差额			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债产生的净（损失）/收益		(3,939,663)	2,809,603
汇兑差额		<u>(184,762)</u>	<u>(212,207)</u>
投资（损失）/收益净额及汇兑差额		<u>(4,124,425)</u>	<u>2,597,396</u>
税前收益		<u>1,611,537</u>	<u>5,053,561</u>
预扣税	5	<u>-</u>	<u>-</u>
基金份额持有人应占资产净值增加		<u>1,611,537</u>	<u>5,053,561</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务状况表

2024 年 12 月 31 日

	附注	2024 美元	2023 美元
资产			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	6、7	512,286,240	109,802,793
应收利息		4,883,286	1,005,737
应收认购款		711,704	199,890
预付款		-	1,704
应收基金管理人款项	3(h)	207,755	124,280
现金及现金等价物	8	539,186,814	112,596,771
资产总额		<u>207,755</u>	<u>124,280</u>
负债			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	6, 7	2,739,780	77,342
应付管理费	3(a)	610,857	178,917
应付受托人费用	3(b)	51,721	12,926
应计费用和其他应付款		35,473	30,587
应付赎回款项		408,344	109,821
应付经纪人款项	9	4,688	-
应付税费		373	373
总负债 (不含基金份额持有人应占资产净值)		<u>3,851,236</u>	<u>409,966</u>
基金份额持有人应占资产净值	10	<u>535,335,578</u>	<u>112,186,805</u>
负债总额		<u>539,186,814</u>	<u>112,596,771</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

	基金份额数目	美元
2023 年 1 月 1 日	58,794,552.24	57,681,637
认购的基金份额		
– A 类 (美元)	297,517.73	3,182,638
– A 类 (港币)	8,415,029.46	11,377,324
– A 类 (人民币)	241,814.05	372,454
– R 类 (人民币) (对冲)	309,193,718.99	41,984,872
– R 类 (人民币)	78,002,347.32	11,967,565
– I 类派息 (美元)	743,383.88	8,000,000
	396,893,811.43	76,884,853
赎回的基金份额		
– I 类 (美元)	(17,871.76)	(203,000)
– A 类 (美元)	(404,913.35)	(4,314,093)
– A 类 (港币)	(9,387,246.52)	(12,709,094)
– A 类 (人民币)	(6,815.08)	(10,464)
– R 类 (人民币) (对冲)	(42,128,860.67)	(5,818,577)
– R 类 (人民币)	(28,676,368.99)	(4,378,018)
	(80,622,076.37)	(27,433,246)
基金份额持有人应占资产净值增加	-	5,053,561
2023 年 12 月 31 日和 2024 年 1 月 1 日	375,066,287.30	112,186,805
认购的基金份额		
– I 类 (美元)	13,084,662.88	160,270,000
– A 类 (美元)	1,266,722.86	14,516,630
– A 类 (港币)	5,823,979.27	8,427,389
– A 类 (人民币)	11,182,401.95	18,242,916
– R 类 (美元)	10,572,214.00	9,999,200
– R 类 (人民币) (对冲)	514,996,453.67	72,288,264
– R 类 (人民币)	767,222,537.00	127,928,161
– I 类派息 (美元)	4,260,919.46	50,000,000
– C 类 (人民币)	1,000.00	1,368
– C 类 (人民币) (对冲)	1,000.00	1,368
– C 类 (美元)	1,000.00	10,000
	1,328,412,891.09	461,685,296
赎回的基金份额		
– I 类 (美元)	(44,300.76)	(533,262)
– A 类 (美元)	(547,058.80)	(6,210,705)
– A 类 (港币)	(5,766,835.73)	(8,356,812)
– A 类 (人民币)	(6,264,473.06)	(10,367,080)
– R 类 (人民币) (对冲)	(93,586,705.76)	(13,137,920)
– R 类 (人民币)	(9,217,023.25)	(1,542,281)
	(115,426,397.36)	(40,148,060)
基金份额持有人应占资产净值增加	-	1,611,537
2024 年 12 月 31 日	1,588,052,781.03	535,335,578

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

基金份额持有人应占资产净值变动表 (续)

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

	2024	2023
已发行基金份额数目		
— I 类 (港币)	2,168,358.93	2,168,358.93
— I 类 (美元)	16,231,076.31	3,190,714.19
— A 类 (美元)	1,210,029.90	490,365.84
— A 类 (港币)	4,634,854.07	4,577,710.53
— A 类 (人民币)	5,155,009.65	237,080.76
— R 类 (美元)	10,572,214.00	不适用 ¹
— R 类 (人民币)	807,331,492.08	49,325,978.33
— R 类 (人民币) (对冲)	735,742,442.75	314,332,694.84
— I 类派息 (美元)	5,004,303.34	743,383.88
— C 类 (人民币)	1,000.00	不适用 ¹
— C 类 (人民币) (对冲)	1,000.00	不适用 ¹
— C 类 (美元)	1,000.00	不适用 ¹
	<u>1,588,052,781.03</u>	<u>375,066,287.30</u>
份额净值		
— I 类 (港币)	港币 11.3961	港币 10.8935
— I 类 (美元)	美元 12.2671	美元 11.6583
— A 类 (美元)	美元 11.5057	美元 10.9689
— A 类 (港币)	港币 11.4224	港币 10.9512
— A 类 (人民币)	人民币 12.1474	人民币 11.2375
— R 类 (美元)	美元 0.9417	不适用 ¹
— R 类 (人民币)	人民币 1.2252	人民币 1.1335
— R 类 (人民币) (对冲)	人民币 1.0039	人民币 0.9901
— I 类派息 (美元)	美元 11.6588	美元 11.0809
— C 类 (人民币)	人民币 10.0534	不适用 ¹
— C 类 (人民币) (对冲)	人民币 10.0534	不适用 ¹
— C 类 (美元)	美元 10.0080	不适用 ¹

¹ 该等类别份额于报告日期尚未发行。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

现金流量表

截至 2024 年 12 月 31 日止年度

	附注	2024 美元	2023 美元
经营活动产生的现金流量			
税前利润		1,611,537	5,053,561
调整项:			
银行存款利息收入		(7,310,170)	(3,091,604)
		(5,698,633)	1,961,957
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产增加		(402,483,447)	(59,987,006)
定期存款减少		-	2,000,000
预付款项减少/(增加)		1,704	(970)
应收基金管理人款项增加		(83,475)	(61,080)
应收经纪人款项减少		-	32,812
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债增加		2,662,438	77,342
应付管理费增加		431,940	109,060
应付受托人费用增加		38,795	6,714
应计费用和其他应付款增加/(减少)		4,886	(123)
应付经纪人款项增加		4,688	-
经营活动使用的现金流量		(405,121,104)	(55,861,294)
已收利息		3,432,621	2,514,623
经营活动使用的现金流量净额		(401,688,483)	(53,346,671)
筹资活动产生的现金流量			
认购基金份额的收益		461,173,482	76,881,521
赎回基金份额支付的款项		(39,849,537)	(27,521,359)
筹资活动产生的现金流量净额		421,323,945	49,360,162
现金及现金等价物增加/(减少) 净额		19,635,462	(3,986,509)
年初现金及现金等价物		1,462,367	5,448,876
年末现金及现金等价物		21,097,829	1,462,367
现金及现金等价物余额分析			
银行存款	8	21,087,829	1,436,760
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	8	10,000	25,607
		21,097,829	1,462,367

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

1. 本子基金

华夏精选基金(“伞基金”)是依据香港法律并根据日期为 2012 年 1 月 12 日订立的信托契约(经不时修订或补充)(“本信托契约”)以伞形基金形式成立的开放式单位信托。

华夏精选固定收益配置基金(“本子基金”)是该伞基金一只单独的子基金。本子基金是香港证券及期货事务监察委员会(“证监会”)依据《证券及期货条例》(“SFO”)第 104(1)节的规定授权批准的开放式单位信托,其还需遵守证监会颁布的《单位信托及互惠基金守则》(“证监会守则”)。证监会的授权批准并不意味着正式审批或推荐。本子基金于 2019 年 8 月 28 日设立。截至 2024 年 12 月 31 日,伞基金下设立十只其他子基金,成立日期如下:

	成立日
华夏精选人民币债券基金	2012 年 2 月 21 日
华夏精选大中华科技基金	2015 年 5 月 27 日
华夏精选亚洲债券基金	2016 年 9 月 30 日
华夏精选货币基金	2019 年 3 月 29 日
华夏精选跃动中国股票基金	2021 年 6 月 25 日
华夏精选稳定收益基金	2022 年 5 月 11 日
华夏精选人民币投资级别收益基金	2022 年 6 月 9 日
华夏精选美元货币基金	2022 年 9 月 5 日
华夏精选灵活周期收益基金	2022 年 10 月 28 日
华夏精选动态固定收益基金	2023 年 5 月 25 日

伞基金的管理人为华夏基金(香港)有限公司(“基金管理人”),受托人为中银国际英国保诚信托有限公司(“受托人”),保管人为中国银行(香港)有限公司(“保管人”),人民币合格境外机构投资者内地保管人为中国银行股份有限公司(“人民币合格境外机构投资者内地保管人”)。

根据国家外汇管理局(“外管局”)于 2014 年 5 月 30 日发布并生效的《合格境外机构投资者境内账户额度管理操作指引》,人民币合格境外机构投资者可灵活地将外管局授予的人民币合格境外机构投资者配额分配给其管理的不同公募基金产品。因此,对于外管局此前就华夏精选固定收益分配基金而授予基金管理人的全部人民币合格境外机构投资者配额,华夏精选固定收益配置基金不再独自使用。基金管理人可酌情决定将华夏精选固定收益配置基金的人民币合格境外机构投资者配额重新分配至其管理的其他公募基金产品,反之亦然,且无需获得外管局的事先批准。

本子基金可把高达 70%的资产净值持有现金、现金存款、存单、商业票据、国库券及其他现金等价票据,用于流动性管理及/或在市场发生剧烈波动或市场条件极为不利等特殊情况下,用以暂时性防守。

2024 年 12 月 31 日

2. 会计政策

2.1 编制基础

本子基金财务报表的编制依据为国际会计准则理事会(“IASB”)颁布的《国际财务报告会计准则》及国际会计准则理事会旗下的国际财务报告解释委员会颁布的解释以及信托契约的相关披露条款和证监会守则附录 E 中的相关披露规定。

本财务报表按照历史成本法编制,但以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产除外。除另有说明外,本财务报表以美元列报,且所有数值四舍五入为最接近的美元数值。

2.2 会计政策和披露的变动

本年度所采用的会计政策与上一年度一致。并无对本子基金产生重大影响的本财年首次生效的其他准则、解释或对现有准则的修订。

2.3 已颁布但尚未生效的国际财务报告会计准则

本子基金未采用已发布但对于截至 2024 年 12 月 31 日止的年度尚未生效的任何新的及经修订的国际财务报告会计准则。其中,以下新的及经修订的国际财务报告会计准则预计将在生效后对本子基金财务报表产生影响:

缺乏可兑换性——对《国际会计准则第 21 号》的修订

2023 年 8 月,国际会计准则理事会发布了对《国际会计准则第 21 号——汇率变动的影响》的修订,规定了主体应如何评估货币的兑换性,以及在缺乏可兑换性时应如何确定即期汇率。该修订还要求主体披露相关信息,使财务报表使用者了解当一种货币无法兑换为另一种货币时(预计)将对主体的经营成果、财务状况和现金流量产生的影响。

该修订自 2025 年 1 月 1 日或之后开始的年度报告期间生效。允许提前采用,但需要予以披露。主体在采用该修订时不得重述比较信息。

该修订预计不会对本子基金的财务报表产生重大影响。

2024年12月31日

2.3 已颁布但尚未生效的国际财务报告会计准则 (续)

国际财务报告准则第18号——财务报表列报和披露

2024年4月,国际会计准则理事会发布了《国际财务报告准则第18号》,该准则将取代《国际会计准则第1号——财务报表列报》。《国际财务报告准则第18号》提出了新的要求,包括纳入特定的总计和小计项目。此外,该准则要求主体将所有收益和费用归为以下五类:经营类、投资类、筹资类、所得税费用类和终止经营类,前三类均为新增类别。

该准则还要求披露新规定的管理层制定的业绩指标、收益和费用小计,还要求基于主要财务报表(“PFS”)和财务报表附注中已识别的“角色”对财务信息进行汇总和分解。

此外,理事会对《国际会计准则第7号——现金流量表》进行了小范围修订,包括将采用间接法编制经营活动现金流量时,将起点从“损益”改为“经营利润或亏损”,并删除了股息和利息现金流量分类的选择权。此外,还对其他几项标准进行了相应的修订。

《国际财务报告准则第18号》以及对其他准则的修订自2027年1月1日或之后开始的报告期生效,但允许提前采用,并且必须予以披露。《国际财务报告准则第18号》将追溯采用该修订。

本子基金目前正在确定以上修订将对主要财务报表和财务报表附注产生的所有影响。

对《国际财务报告准则第9号》和《国际财务报告准则第7号》的修订

2024年5月30日,国际会计准则理事会发布了对《国际财务报告准则第9号》和《国际财务报告准则第7号》的修订,明确了金融资产或金融负债的终止确认日期,还制定了一项会计政策,允许主体在满足特定标准的情况下,对采用电子支付系统结算的金融负债在结算日之前终止确认。该修订明确了如何对具有环境、社会 and 治理及其他类似特征的金融资产和合同现金流量特征进行评估。此外,该修订明确了具有无追索权特征的金融资产和合同挂钩工具的分类要求。该修订还包括对指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具和具有或有特征的金融工具投资的额外披露。主体应追溯修订,并对首次执行日的期初未分配利润(或权益的其他组成部分)进行调整。无需对以前期间进行重述,且重述不可使用后见之明。允许提前同时采用所有修订或仅提前采用与金融资产分类相关的修订。该预计修订不会对本子基金的财务报表产生任何重大影响。

该修订自2026年1月1日或之后开始的年度期间生效。允许提前采用,可选择提前采用仅针对金融资产分类和相关披露的修订。本子基金目前并不打算提前采用该修订。

2024 年 12 月 31 日

2.4. 重要会计政策

金融工具

(a) 分类

根据《国际财务报告准则第 9 号》(“IFRS 9”), 本子基金于初始确认时, 将其金融资产及金融负债分类为下文所讨论的金融资产及金融负债类别。

在应用该分类时, 当金融资产或金融负债符合下列条件之一, 则分类为交易性类别:

- 其取得或发生的主要目的为短期内出售或回购, 或
- 于初始确认时属于合并管理下可辨认金融工具组合的一部分, 且有证据表明近期确实存在短期获利抛售模式, 或
- 属于衍生工具(财务担保合约或被指定且有效的对冲工具的衍生工具除外)

金融资产

本子基金根据以下两者将其金融资产分类为按摊余成本进行后续计量或以公允价值计量且其变动计入当期损益:

- 主体管理其金融资产的业务模式及
- 该金融资产的合同现金流量特征

按摊余成本计量的金融资产

如果满足以下条件, 则按摊余成本计量债务工具: 在以下业务模式中持有债务工具, 其目的是持有金融资产以收取合同现金流量; 合同条款于指定日期产生的现金流量仅限于支付未偿本金的本金和利息。本子基金将现金及现金等价物和短期非融资应收款项(含应收利息、应收认购款以及应收基金管理人款项)包括在此类别。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

当金融资产符合下列条件之一, 则以公允价值计量且其变动计入当期损益:

- 其合同条款于指定日期产生的现金流量并非仅限于支付未偿本金的本金和利息, 或
- 并非在以下业务模式中持有该金融资产, 其目的是收集合同现金流量, 或收集合同现金流量并出售, 或
- 于初始确认时, 其不可撤销地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, 这样做可以消除或显著减少因金融资产或金融负债的计量基础不同所导致的相关利得或损失在计量或确认方面不一致的情况。

本子基金在该类别中包括债务工具和集合投资计划, 其获取的主要目的是为了从短期价格波动中获得利润。该类别还包括资产状况中的衍生工具合约。

2.4. 重要会计政策 (续)

金融工具 (续)

(a) 分类 (续)

金融负债

按摊余成本计量的金融负债

该类别包括所有金融负债，惟以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债除外。本子基金在该类别中包括应付管理费、应付受托人费用、其他应付款、应付赎回费以及应付经纪人的款项。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

倘金融负债符合持作买卖的定义，则以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本子基金在该类别中包括处于负债状况的衍生工具合约，原因在于其为交易目的而持有。本子基金还将其可赎回基金份额纳入该类别。

(b) 确认

当且仅当本子基金成为该工具合同条款的一方时，本子基金才确认金融资产或金融负债。

如果金融资产的买卖要求在监管规定或市场惯例（常规交易）订立的一般时间范围内交付资产，则于交易日（即，本子基金承诺买卖该金融资产的日期）确认该金融资产买卖。

(c) 初始计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债在财务状况表中以公允价值计量。该类工具的所有交易成本直接计入损益。

金融资产和金融负债（以公允价值计量且其变动计入当期损益的除外）以其公允价值加上任何可直接归属的增量购置或发行成本进行初始计量。

2024年12月31日

2.4. 重要会计政策 (续)

金融工具 (续)

(d) 后续计量

初始计量后，本子基金以公允价值计量被分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。该类金融工具公允价值的后续变动计入全面收益表中的“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债的净利得或损失”。该类工具赚取或支付的利息和股息单独计入全面收益表中的“利息收入或费用以及股息收入或费用”。

金融资产（惟分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益者除外）采用实际利率法按摊余成本减去任何减值准备进行计量。当金融资产被终止确认或发生减值时，利得和损失通过摊销程序计入损益。

除被分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的负债外，金融负债采用实际利率法按摊余成本进行计量。当负债被终止确认时，利得和损失通过摊销程序计入损益。

实际利率法指计算金融资产或金融负债的摊余成本并在相关期间内分摊和确认利息收入或利息费用的方法。实际利率指准确地将预计未来收到或支出的现金金额在金融资产或金融负债的预计存续期间内折算为金融资产的账面总额或金融负债的摊余成本时使用的比率。

当计算实际利率时，本子基金在考虑金融工具所有合同条款后估计现金流量，但不考虑预期信用损失。该计算包括构成实际利率、交易成本及所有其他溢价或折价且由合同双方支付或收取的所有费用。

2024年12月31日

2.4. 重要会计政策 (续)

金融工具 (续)

(e) 终止确认

金融资产 (或者金融资产的一部分或一组类似金融资产的一部分, 如适用) 的终止确认条件为: 收取金融资产现金流量的权利届满; 或本子基金转移了收取金融资产现金流量的权利, 或在过手协议下承担了及时将收取的现金流量全额支付给第三方的义务, 且本子基金:

- 实质上转移了金融资产上几乎所有的风险和报酬, 或
- 虽然实质上既没有转移也没有保留金融资产上几乎所有的风险和报酬, 但转移了对该金融资产的控制

如果本子基金转移了收取金融资产现金流量的权利 (或签订了过手协议), 且实质上既没有转移也没有保留金融资产上几乎所有的风险和报酬, 而且也没有转移对该金融资产的控制, 则该金融资产按照本子基金对该金融资产的继续涉入程度予以确认。在这种情况下, 本子基金还确认相关负债。被转移的资产和相关负债以反映本子基金保留的权利和义务为基础进行计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满, 则本子基金对金融负债进行终止确认。

金融资产减值

就按摊余成本计量的金融资产而言, 减值准备根据一般方法确认, 其中预期信用损失的确认分为两个阶段。对于自初始确认以来信用风险并未显著增加的信用风险敞口, 本子基金需针对未来12个月内可能发生的违约事件而导致的信用损失计提预期信用损失。对于自初始确认以来信用风险显著增加的信用风险敞口, 无论违约时点如何, 在风险敞口剩余期限内的预期信用损失均需要损失准备金。

本子基金计算预期信用损失的方法反映了概率加权结果、货币时间价值以及于报告日可获得的关于过去事件、当前情况以及未来经济形势预测的合理支持信息, 该信息无需过多成本或投入即可获得。

本子基金利用准备矩阵作为实际可行合宜方法, 根据具有类似损失模式的应收款项分组的逾期天数, 来衡量应收利息及其他应收款的预期信用损失。应收款项根据其性质进行分组。准备矩阵以应收款项在预期年限内观察的历史损失率为依据, 并根据前瞻性估计进行调整。

抵销金融工具

当且仅当存在一项可依法强制执行的现时权利来抵销已确认金额, 且亦有意以净额结算或同时变现资产及债务偿付时, 金融资产和金融负债可予抵销, 并将净额列入财务状况表。除非协议的一方违约, 并且相关资产和负债在财务状况表中列报为总额, 否则一般情况下, 主净额结算协议不属于这种情况。

2.4. 重要会计政策 (续)

公允价值计量

本子基金在各报告日以公允价值计量其金融工具投资，如权益工具、债务工具和衍生工具。

公允价值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。公允价值计量假定出售资产或转移负债的交易发生在：

- 相关资产或负债的主要市场，或
- 如不存在主要市场，假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

主要市场或最有利市场是本子基金必须可进入的交易市场。

资产或负债的公允价值计量采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

本子基金采纳适用于不同情况且具备充分数据以供计量公允价值的估值方法，以尽量利用相关可观察输入值并尽量减少使用不可观察输入值。

在活跃市场交易的金融工具于报告日的公允价值以其报价（长仓的买入价及短仓的卖出价）为基础，且不扣除任何交易成本。

对于不在活跃市场交易的所有其他金融工具，采用在当前情况下认为适当的估值方法确定其公允价值。估值方法包括市场法（即，利用最近以公平交易原则进行的市场交易作必要调整，并参考其他基本相同的工具的当前市价）和收益法（即，贴现现金流使用分析和期权定价模型而尽量使用可用及具有支持性的市场数据）。

在财务报表中以公允价值计量或披露的所有资产和负债，基于对于公允价值的整体计量属重大的最低层次输入值，在公允价值层级中进行分类，具体如下：

第1层次 — 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价

第2层次 — 对于公允价值计量属重大的最低层次输入值直接或间接可观察的估值技术

第3层次 — 对于公允价值计量属重大的最低层次输入值不可观察的估值技术

对于在财务报表中持续确认的资产和负债，本子基金在各报告期末重估分类（基于对整体公允价值计量属重大的最低层次输入值），以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

2.4. 重要会计政策 (续)

衍生金融工具

衍生金融工具按调至市价基准入账。公允价值使用市场报价确定或参考相关资产的特定价格或以其他方式确定名义金额的变动计算。所有衍生工具在款项为子基金的应收款项时作为资产入账，款项为子基金的应付款项时作为负债入账。

公允价值变动产生的未变现利得和损失及已变现利得和损失均计入损益。

记账本位币和列报货币

本基金的记账本位币为美元，美元也是其运营所在的主要经济环境的货币。本基金的业绩以美元评估，且其流动性也以美元进行管理。因此，美元被视为最能如实反映相关交易、事件和情况的经济影响的货币。本基金的列报货币也是美元。

外币交易

本年度的交易（包括买卖证券）、收入及费用均按交易日的现行汇率进行折算。

以外币计量的货币性资产和负债按于报告日适用的记账本位币汇率进行折算。

以外币历史成本计量的非货币性项目，则采用初始交易日的汇率对其进行折算。以外币公允价值计量的非货币性项目，则采用确定该公允价值之日的汇率对其进行折算。

被分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具进行外币交易产生的利得和损失以及其他金融工具产生的汇兑差额均计入全面收益表。

基金份额持有人应占资产净值

可赎回份额可根据持有人的选择进行赎回。由于不符合归类为权益的条件，因此可赎回份额被归类为金融负债。可赎回份额以赎回金额计量。

可赎回基金份额可由持有人选择发行和赎回，且价格为发行或赎回时本基金的份额净值。本基金的份额净值的计算方法为基金份额持有人应占资产净值除以基金份额的发行数量。

对基金份额持有人的收益分配

收益分配由本基金自行决定。对本基金的基金份额持有人所作的收益分配会在全面收益表中确认为财务费用。拟派金额在基金管理人批准的期间内被确认为负债。

2024年12月31日

2.4. 重要会计政策 (续)

现金及现金等价物

在财务状况表中, 现金及现金等价物包括持有现金和银行存款, 以及通常在三个月内到期、易于转换为确定金额的现金、价值变动风险轻微且为满足短期现金要求而持有的短期高流动性存款。

就现金流量表而言, 现金及现金等价物包括持有现金、银行存款和上述定义的短期存款在扣除银行透支(该银行透支需偿还, 并构成本子基金现金管理的组成部分)后的净额。

收入确认

(a) 股息收入

股息收入于本子基金的收款权利确立时予以确认。所列报的股息收入未扣除在全面收益表中独立披露的任何不可收回的预扣税。

(b) 利息收入

利息收入以权责发生制为基础采用实际利率法予以确认, 所使用的利率是在金融工具的预期年限或更短期限(视情况而定)内将预期未来现金收入准确折现至金融资产账面净值的利率。

(c) 其他收入

其他收入只有在经济利益很可能流入本子基金、且经济利益的流入额能够可靠计量时才能予以确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的净损益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债的净损益是交易性金融资产及负债或初始确认时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及负债的公允价值变动, 但不包括利息收入和费用。

未变现利得和损失包括本年度的金融工具公允价值变动以及上一年度金融工具未变现的利得和损失在本报告期间变现的转回金额。处置被分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具所得的变现利得和损失采用债务工具的加权平均法以及衍生工具的先进先出法进行计算。其指工具的初始账面金额与处置金额, 或衍生工具合约的现金付款或收入之间的差额。

应收/应付经纪人款项

应收经纪人款项包括截至报告日已签订合同但尚未交割的(在常规交易中)已售证券的保证金账户和应收款项。保证金账户指经纪人持有的现金存款, 作为未平仓期货合约的抵押品。

应付经纪人款项指于报告日已签约但尚未交割的(在常规交易中)已购证券的应付款项。应付经纪人款项属于金融负债, 但被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除外。

2024年12月31日

2.4. 重要会计政策 (续)

税费

在一些管辖区内，需针对股息收入、利息收入和资本利得在收入来源地扣缴预扣税。本子基金在全面收益表中单独列报投资总收入产生的预扣税。在现金流量表中，投资活动产生的资金流入在扣除预扣税前进行适当列报。

关联方

在下列情况下，一方被视为与本子基金之间存在关联：

- (a) 该方为符合以下条件的个人或其亲属，且该个人
- (i) 可控制或共同控制本子基金；
 - (ii) 对本子基金有重大影响；或
 - (iii) 担任本子基金或其母公司的主要管理层成员；

或者

- (b) 该方为符合下列任何条件的主体：
- (i) 该主体及本子基金均是同一集团的成员公司；
 - (ii) 一个主体是另一主体（或另一主体的母公司、子公司或同系附属子公司）的联营公司或合营公司；
 - (iii) 该主体与本子基金均是同一第三方的合营公司；
 - (iv) 一个主体是第三方主体的合营公司，而另一主体则是该第三方主体的联营公司；
 - (v) 该主体为本子基金或本子基金相关主体的雇员提供雇员离职后福利计划；
 - (vi) 该主体受(a)项中所识别个人的控制或共同控制；
 - (vii) 在(a)(i)项中所识别的个人对该主体有重大影响力，或该个人是该主体（或该主体母公司）的主要管理层成员；以及
 - (viii) 该主体或其所属集团内的任何成员向本子基金或其母公司提供主要管理层成员服务。

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易

基金管理人的关联人士为香港证监会守则所界定的关联人士。在本年度内，本子基金与基金管理人及其关联人士的一切交易均在常规业务过程中按正常商业条款执行。就基金管理人所知，除下文所披露信息外，本子基金与关联人士之间不存在任何其他交易。

(a) 管理费

对于在各交易日于本子基金中计算和预提的资产净值，基金管理人有权向本子基金收取管理费，A类基金份额的现行年费率为0.8%，I类基金份额的现行年费率为0.4%，R类基金份额的现行年费率为0.8%，C类基金份额的现行年费率为0.2%，管理费在每个交易日计算及累计并按月到期支付。。

截至2024年12月31日止年度所产生的管理费为1,230,386美元（2023年：486,900美元）。截至2024年12月31日，应付基金管理人的管理费为610,857美元（2023年：178,917美元）。

2024 年 12 月 31 日

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易 (续)

(b) 受托人费用

受托人有权基于子基金资产净值按照最高 0.5% 的年费率收取受托人费用。该费用于各交易日计算和预提，并应于每月月底支付。

截至 2024 年 12 月 31 日止年度所产生的受托人费用为 250,225 美元 (2023 年: 112,266 美元)。截至 2024 年 12 月 31 日，应付受托人的受托人费用为 51,721 美元 (2023 年: 12,926 美元)。

(c) 保管费用及银行费用

保管人及人民币合格境外机构投资者内地保管人有权按照现行 0.023% 至 0.025% (最高 0.1%) 的年费率向本子基金收取保管费，该费用按月计算，并于每月月底支付。

截至 2024 年 12 月 31 日止年度所产生的保管费为 77,713 美元 (2023 年: 43,494 美元)。截至 2024 年 12 月 31 日，并无应付保管人的保管费 (2023 年: 无)。

截至 2024 年 12 月 31 日止年度，中国银行 (香港) 有限公司收取银行手续费 6,129 美元 (2023 年: 5,612 美元)。

(d) 经纪佣金及其他交易成本—交易手续费

经纪佣金及其他交易成本包括经纪佣金和投资手续费。交易手续费为通过行政管理人进行的每笔交易的行政管理费，每笔交易费用为 15 美元。截至 2024 年 12 月 31 日止年度的交易手续费为 20,595 美元 (2023 年: 18,090 美元)。截至 2024 年 12 月 31 日，应付行政管理人的交易手续费为 660 美元 (2023 年: 360 美元)。

(e) 受托人关联公司持有的银行存款

本子基金的银行存款中，21,087,664 美元 (2023 年: 1,436,595 美元) 由受托人的关联公司中国银行 (香港) 有限公司所持有，在截至 2024 年 12 月 31 日止的期间内，利息收入达 8,196 美元 (2023 年: 4,851 美元)。关于所持有银行存款的更多详情，请参见财务报表附注 8。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易 (续)

(f) 与基金管理人以及受托人关联人士之间的投资交易

中信证券经纪(香港)有限公司及中信银行(国际)有限公司为基金管理人的关联公司。

	买卖证券 的总价值 美元	支付的 佣金总额 美元	在本子基金 年度交易总额 中的占比 %	平均 佣金费率 %
2024				
中信证券经纪(香港)有限公司	9,582,412	-	0.65%	-
中信银行(国际)有限公司	31,335,159	-	2.12%	-
2023				
中信证券经纪(香港)有限公司	2,816,018	-	0.33%	-
中信银行(国际)有限公司	22,804,655	-	2.70%	-

中国银行(香港)有限公司、中银国际英国保诚信托有限公司以及中银国际证券有限公司为受托人的关联公司。

	买卖证券 的总价值 美元	支付的 佣金总额 美元	在本子基金 年度交易总额 中的占比 %	平均 佣金费率 %
2024				
中国银行(香港)有限公司	5,211,327	-	0.35%	-
中银国际英国保诚信托有限公司	82,531,652	-	5.59%	-
中银国际证券有限公司	248,588	-	0.02%	-
2023				
中国银行(香港)有限公司	5,388,803	-	0.67%	-
中银国际英国保诚信托有限公司	7,583,638	-	0.94%	-
中银国际证券有限公司	3,160,168	-	0.37%	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易 (续)

(g) 本子基金的基金份额持有情况

本子基金允许基金管理人及其关联人士和基金管理人管理的其他基金认购和赎回在本子基金中的基金份额。华夏中国成长基金是一家于开曼群岛注册成立的开放式豁免投资有限责任公司。该基金根据开曼群岛《共同基金法》注册为共同基金，于 2009 年 8 月 3 日在开曼群岛金融管理局(“CIMA”)注册，并由基金管理人管理。华夏基金管理有限公司和 ChinaAMC International Holdings Limited 分别为基金管理人的中间控股公司及子公司，甘添先生为基金管理人的董事。截至 2024 年 12 月 31 日及 2023 年 12 月 31 日，基金管理人及其关联人士在本子基金持有的基金份额情况如下：

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日 已发行的 基金份额	期间认购 基金份额	期间赎回 基金份额	2024 年 12 月 31 日 已发行的 基金份额
由 ChinaAMC International Holdings Limited 持有的				
I 类(港币)基金份额	2,168,359	-	-	2,168,359
I 类(美元)基金份额	743,384	4,260,919	-	5,004,303
由华夏基金管理有限公司持有的				
R 类(人民币)(对冲)基金份额	314,332,695	514,996,454	93,586,706	735,742,443
R 类(人民币)基金份额	49,325,978	767,222,537	9,217,023	807,331,492
R 类(美元)基金份额	-	10,572,214	-	10,572,214
由中信证券国际资本管理有限公司持有的				
I 类(美元)基金份额	-	8,981,637	-	8,981,637
由中信信期国际证券有限公司持有的				
I 类(美元)基金份额	-	734,892	-	734,892
由 ChinaAMC CNCB Stable Income FOF Fund SP 持有的				
I 类(美元)基金份额	533,300	-	-	533,300
由 Security Nominees Limited 持有的				
A 类(美元)基金份额	1,524	628	80	2,072
A 类(港币)基金份额	2,948	11,350	5,387	8,911
A 类(人民币)基金份额	-	102,379	4,183	98,196
由 ChinaAMC China Growth Fund 持有的				
C 类(人民币)基金份额	-	1,000	-	1,000
C 类(人民币)(对冲)基金份额	-	1,000	-	1,000
C 类(美元)基金份额	-	1,000	-	1,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易 (续)

(g) 本子基金的基金份额持有情况 (续)

2023 年 12 月 31 日

	2023 年 1 月 1 日 已发行的 基金份额	期间认购 基金份额	期间赎回 基金份额	2023 年 12 月 31 日 已发行的 基金份额
由 ChinaAMC International Holdings Limited 持有的 I 类 (港币) 基金份额	2,168,359	-	-	2,168,359
由华夏基金管理有限公司持有的 R 类 (人民币) (对冲) 基金份额	47,267,837	309,193,719	42,128,861	314,332,695
由华夏基金管理有限公司持有的 R 类 (人民币) 基金份额	-	78,002,347	28,676,369	49,325,978
由 ChinaAMC International Holdings Limited 持有的 I 类 (美元) 基金份额	-	743,384	-	743,384

(h) 由基金管理人管理的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

截至 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日, 由基金管理人管理的集合投资计划的本子基金的持有情况如下:

2024 年 12 月 31 日

	2024 美元
华夏亚洲 ESG 债券基金	5,139,710
华夏全球投资级别债券基金	42,467,952
华夏精选亚洲债券基金	10,965,454
华夏精选人民币投资级收益基金	33,106,154
华夏全球精选收益基金	10,653,464

3. 与受托人、基金管理人及其关联人士的交易 (续)

(h) 由基金管理人管理的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 (续)

2023 年 12 月 31 日

2023
美元

华夏全球投资级别债券基金	16,223,743
华夏精选货币基金	1,425,513
华夏全球精选收益基金	8,485,844
华夏精选人民币投资级收益基金	5,033,332

根据《证监会守则》第 7.11C 章，凡计划投资于任何由同一家管理公司或其关联人士管理的相关计划，则就相关计划而征收的首次费用及赎回费用须全部加以宽免。截至 2024 年 12 月 31 日止年度，基金管理人并未就上述集合投资计划产生任何首次费用及赎回费用（2023 年：无）。截至 2024 年 12 月 31 日止年度，本子基金从基金管理人处获得管理费回佣 240,790 美元（2023 年：133,297 美元）。截至 2024 年 12 月 31 日，应收基金管理人的管理费回佣为 207,755 美元（2023 年：124,280 美元）。

(i) 基金管理人以及受托人关联人士持有的投资及保证金存款

截至 2024 年 12 月 31 日及 2023 年 12 月 31 日存入受托人关联公司的投资和银行存款余额汇总如下：

	附注	2024 美元	2023 美元
<u>投资</u>			
中国银行（香港）有限公司	6	404,591,241	78,634,361
中银国际英国保诚信托有限公司	6	107,420,234	6,458,845

(j) 与基金管理人管理的基金及授权之间的交易

截至 2024 年 12 月 31 日止的年度期间内，本子基金已按交易日的现行市价向基金管理人管理的其他基金及授权分别购入及售出投资额 72,099,976 美元及 5,418,274 美元（2023 年：16,883,638 美元及 700,000 美元）。

4. 软佣金安排

在截至 2024 年 12 月 31 日止年度及截至 2023 年 12 月 31 日止期间内，基金管理人及其关联人士并未就本子基金的管理收取任何软佣金或签订任何软佣金安排。基金管理人及其关联人士并未保留任何经纪或证券商的现金回佣。

5. 预扣税

香港税费

根据香港《税务条例》第 14、26 或 26A 节的规定，本子基金处置投资产生的利息收入及变现利得免缴香港利得税，故本子基金未针对香港利得税计提纳税准备金。

2024 年 12 月 31 日

5. 预扣税 (续)

中国内地税费

根据中国内地法律法规的规定，境外投资者（如本子基金）可能需针对因中国内地税收居民企业发行的证券所产生的收入（如利息和资本利得）而缴纳预扣税，税率为 10%（“分配税”），以及针对非政府债券产生的利息收入而缴纳预扣税，税率为 6%（“增值税”）。但无法保证中国内地的税务机关未来不会修改税率。截至 2024 年 12 月 31 日止年度，未就证券所得收入计提中国内地税费（2023 年：无）。

美国税费

根据美国法律法规的规定，境外投资者（如本子基金）可能需针对因美国税收居民企业发行的证券所产生的收入（如利息和资本利得）而缴纳预扣税，税率为 30%（“分配税”）。但无法保证美国的税务机关未来不会修改税率。截至 2024 年 12 月 31 日止年度，本子基金并无应缴分配税为（2023 年：无）。

其他管辖区

本子基金出售投资所得的利息收入和变现利得，可能需要由其所得税来源地管辖区征收预扣税和其他税款。本子基金评估有关税收诉讼以及后续现金流出的可能性很低。

6. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债

	附注	2024 美元	2023 美元
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			
- 债券		404,591,241	78,634,361
- 集合投资计划		107,420,234	31,168,432
- 远期外汇合约	7	274,765	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 合计		<u>512,286,240</u>	<u>109,802,793</u>
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债			
- 远期外汇合约	7	2,739,780	77,342
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 合计		<u>2,739,780</u>	<u>77,342</u>

在活跃市场交易的金融资产及负债的公允价值以报告期末交易结束时的市场报价为基础。

活跃市场是指发生充足频率和数量的资产或负债交易以持续提供定价信息的市场。

金融工具被视为具有在活跃市场报价的条件是，其报价可随时且定期从交易所、交易商、经纪人、行业团队、定价服务或监管机构获得，且这些价格指以公平交易原则实际定期发生的市场交易。

如最后成交价格在买卖价差内，则本子基金使用金融资产及负债的最后成交市场价格。如若最后成交价格不在买卖价差内，则基金管理人将在最具代表性的公允价值买卖价差内确定一个数值。

本子基金的公允价值计量假设，在现时市况下，市场参与者之间于计量日在有序交易中交换资产或负债，以出售资产或转移负债。

2024 年 12 月 31 日

6. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债 (续)

如果无法观察一项完全相同的资产或负债的价格，则本子基金可尽量利用相关可观察输入值并尽量减少使用不可观察输入值，采用该估值技术来计量公允价值。由于公允价值以市场为基础进行计量，故其使用市场参与者在资产或负债定价时所运用的假设（包括风险假设）进行计量。因此，在计量公允价值时，本子基金持有一项资产或清偿（或履行）一项负债的意图与其并无关联。

即使不存在可观察市场提供于计量日出售资产或转移负债的定价信息，公允价值计量也应假定交易于该日发生，并从持有资产或亏欠负债的市场参与者的角度加以考虑。该假定交易为出售资产或转移负债的估价提供了依据。

下表分析了截至 2024 年 12 月 31 日及 2023 年 12 月 31 日，本子基金在公允价值层级内以公允价值计量的金融资产及金融负债。

	活跃 市场报价 第 1 层次 美元	重大可观察 输入值 第 2 层次 美元	重大不可 观察输入值 第 3 层次 美元	总计 美元
2024 年 12 月 31 日				
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产				
-债券	-	404,591,241	-	404,591,241
-集合投资计划	-	107,420,234	-	107,420,234
-远期外汇合约	-	274,765	-	274,765
	-	512,286,240	-	512,286,240
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债				
-远期外汇合约	-	(2,739,780)	-	(2,739,780)
	-	(2,739,780)	-	(2,739,780)

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

6. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债 (续)

	活跃 市场报价 第 1 层次 美元	重大可观察 输入值 第 2 层次 美元	重大不可 观察输入值 第 3 层次 美元	总计 美元
2023 年 12 月 31 日				
以公允价值计量且其变动计入当 期损益的金融资产				
-债券	-	78,634,361	-	78,634,361
-集合投资计划	-	31,168,432	-	31,168,432
	-	109,802,793	-	109,802,793
以公允价值计量且其变动计入当 期损益的金融负债				
-远期外汇合约	-	(77,342)	-	(77,342)
	-	(77,342)	-	(77,342)

截至 2024 年 12 月 31 日，本子基金进行了债务、集合投资计划及远期外汇合约投资，并将其分类为第 2 层次。截至 2024 年 12 月 31 日止年度，本子基金未对投资进行第 1 层次和第 3 层次的分类，各层次之间也未发生转移（2023 年：无）。

7. 衍生金融工具

远期外汇合约

本子基金使用远期外汇合约来降低外汇汇率波动风险。本子基金订立的远期外汇合约是与交易对手达成的协议，根据预定名义金额按商定汇率兑换货币。

截至 2024 年 12 月 31 日及 2023 年 12 月 31 日尚未结算的衍生工具合约如下

2024 年 12 月 31 日

	名义金额			公允价值	
	多头敞口		空头敞口	资产 美元	负债 美元
美元	32,000,000	人民币	233,664,000	136,009	-
美元	32,000,000	人民币	232,689,210	138,756	-
人民币	227,838,336	美元	32,000,000	-	(930,442)
人民币	741,853,621	美元	102,158,366	-	(827,609)
人民币	226,534,400	美元	32,000,000	-	(981,729)

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

7. 衍生金融工具 (续)

远期外汇合约 (续)

2023 年 12 月 31 日

		名义金额		公允价值	
		多头敞口	空头敞口	资产	负债
				美元	美元
美元	960,501	港币	7,500,000	-	(501)
人民币	310,822,016	美元	43,991,510	-	(76,841)

8. 现金及现金等价物

	2024 美元	2023 美元
银行存款	21,087,829	1,436,760
定期存款	10,000	25,607
小计	21,097,829	1,462,367
减：原始期限超过三个月的定期存款	-	-
	21,097,829	1,462,367

银行存款余额包括在中国银行（香港）有限公司（受托人的关联公司）处持有的银行存款。银行存款根据每日银行存款利率赚取浮动利率的利息。

短期存款的存款期分为一天至三个月不等，依本子基金的实时现金需求而定，并按照相应的短期存款利率赚取利息。

银行存款余额存入近期无违约记录且信誉良好的银行。

9. 应付经纪人款项

截至 2024 年 12 月 31 日，本子基金的应付经纪人款项指针对截至报告日已签约但尚未交割的已购买证券的应付款项。截至 2023 年 12 月 31 日，本子基金无应付经纪人款项。

	附注	2024 美元	2023 美元
应付经纪人款项			
- 已购买但尚未交割证券的应付款项		4,688	-
		4,688	-

10. 基金份额持有人应占资产净值

对于已发行或已重购的基金份额，其已收或已付对价分别根据本子基金于交易日的份额净值进行计算。根据规定，本子基金的投资状况以其最后成交市场价格来估值，以确定认购和赎回交易的份额净值。本子基金的份额净值以本子基金的净资产除以已发行基金份额总数进行计算。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

10. 基金份额持有人应占资产净值 (续)

资本管理

本基金的资本管理目标旨在通过资本投资来实现投资目标，同时维持充足的流动性，以满足本基金的
基金的费用支出以及赎回需求。

在财务状况表中列报的基金份额持有人应占资产净值与为处理基金份额认购和赎回而确定的基金份额
持有人应占资产净值之间的对账如下：

	2024 美元	2023 美元
截至本期间最后工作日及日历日的基金份额持有人应占资 产净值 (根据基金说明书计算)	520,040,553	112,207,673
未结算资本交易的调整	15,295,025	(5,149)
年末估值的调整	-	(15,719)
基金份额持有人应占资产净值 (根据国际财务报告会计准则计算)	535,335,578	112,186,805

	2024	2023
截至本期间最后工作日及日历日的 (每份额) 基金 份额持有人应占资产净值 (根据基金说明书计算)		
I 类 (港币)	港币 11.3961	港币 10.8943
I 类 (美元)	美元 12.2671	美元 11.6591
A 类 (美元)	美元 11.5057	美元 10.9699
A 类 (港币)	港币 11.4224	港币 10.9522
A 类 (人民币)	人民币 12.1474	人民币 11.2385
R 类 (美元)	美元 0.9417	不适用 ¹
R 类 (人民币)	人民币 1.2252	人民币 1.1336
R 类 (人民币) (对冲)	人民币 1.0039	人民币 0.9904
I 类 (美元派息)	美元 11.6588	美元 11.0817
C 类 (人民币)	人民币 10.0534	不适用 ¹
C 类 (人民币) (对冲)	人民币 10.0534	不适用 ¹
C 类 (美元)	美元 10.0080	不适用 ¹

(每份额) 基金份额持有人应占资产净值 (根据国际财务报告会计准则计算)	2024	2023
I 类 (港币)	港币 11.3961	港币 10.8935
I 类 (美元)	美元 12.2671	美元 11.6583
A 类 (美元)	美元 11.5057	美元 10.9689
A 类 (港币)	港币 11.4224	港币 10.9512
A 类 (人民币)	人民币 12.1474	人民币 11.2375
R 类 (美元)	美元 0.9417	不适用 ¹
R 类 (人民币)	人民币 1.2252	人民币 1.1335
R 类 (人民币) (对冲)	人民币 1.0039	人民币 0.9901
C 类 (人民币)	美元 11.6588	美元 11.0809
C 类 (人民币) (对冲)	人民币 10.0534	不适用 ¹
C 类 (美元)	人民币 10.0534	不适用 ¹

¹ 该等类别份额于报告日期尚未发行。

2024年12月31日

11. 金融风险与管理目标和政策

风险管理

风险隐藏于本子基金业务活动中，通过持续识别、计量和监控程序进行管理。基金管理人负责识别和控制风险。在风险管理方面，本子基金的目标旨在创建和保护基金份额持有人的价值。

本子基金面临其所持有金融工具产生的市场风险（包括价格风险、利率风险和外汇风险）、流动性风险以及信用风险。

(a) 市场风险

市场风险是由市场价格和比率变动的不确定性而造成损失的风险，包括可观察变量（如利率、信用利差、汇率）和间接可观察变量（如波动率和相关性）。市场风险包括经济环境、消费模式和投资者预期改变等因素，这可能对投资价值产生重大影响。因此，市场变化可导致本子基金的可赎回份额净值发生大幅波动。

金融工具产生的最大风险与其公允价值相当。

本子基金在交易活动中承担市场风险。本子基金将市场风险分为价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 价格风险

本子基金透过分散投资组合及投资于具有强劲基本面的证券来管理市场价格风险。下表汇总了截至2024年12月31日和2023年12月31日，本子基金市场风险敞口的总体情况，以及本子基金以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的增减对其资产净值的影响。该分析依据的假设为，在所有其他变量恒定的情况下，集合投资计划的相关投资通过合理可能的变动而增加/减少。然而，这并不代表其可预测相应主要市场的未来走势。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 价格风险 (续)

	以公允 价值计量且 其变动计入 当期损益的 金融资产的 账面价值 美元	在资产净值 中的占比 %	相关证券 变动增加/ (减少) %	资产净值 的估计 可能变动 增加/ (减少) 美元
2024 年 12 月 31 日				
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融资产	107,420,234	20	1 (1)	1,074,202 (1,074,202)
2023 年 12 月 31 日				
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融资产	31,168,432	28	1 (1)	311,684 (311,684)

(ii) 利率风险

利率风险来自于有息资产公允价值和未来现金流量的市场利率水平波动产生的影响。

由于本子基金投资了债券，且其价值受到利率变动的显著影响，所以本子基金面临利率风险。当利率上浮时，由于新取得的债券将支付更高的利率，所以之前取得的债券价值通常将下跌。与此相反，当利率下浮时，之前取得的债券价值通常将上涨。基金管理人定期评估经济状况，监督利率变动展望来控制利率风险的影响。在利率上浮的情况下，本子基金将取得短期债券，以将对投资组合的负面影响降至最低。

大部分利率风险敞口来自于债券投资。本子基金的大部分债券投资具有固定利率。基金管理人认为利率变动对利息收入影响不大。

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(ii) 利率风险 (续)

下表展示了在所有其他变量恒定的情况下，本子基金截至 2024 年 12 月 31 日至 2023 年 12 月 31 日期间损益对于利率的合理可能变动的敏感性。

	基点变动	投资公允价值变动 (减少)/增加的敏感性 美元
2024		
债券	25	(2,822,435)
债券	(25)	2,822,435
2023		
债券	25	(1,308,151)
债券	(25)	1,308,151

本子基金还拥有有息银行存款。由于这些银行存款于三个月内到期，所以基金管理人认为利率变动对截至 2024 年 12 月 31 日至 2023 年 12 月 31 日期间的基金份额持有人应占资产净值产生的现金流量影响不重大，故而未列报对银行存款的敏感性分析。

(iii) 外汇风险

外汇风险指金融工具价值随外汇汇率变动而波动的风险。

本子基金主要持有以美元（即本子基金记账本位币）计价的资产和负债。基金管理人认为，本子基金未面临重大外汇风险，因此未列报相关敏感性分析。

(b) 流动性风险

流动性风险指本子基金难以履行通过交付现金或另一金融资产来偿清金融负债相关义务的风险。流动性风险敞口的产生归因于本子基金可能需早于预期时间来偿还负债或赎回基金份额。本子基金面临每日以现金方式赎回其可赎回基金份额的风险敞口。基金份额可由持有人在赎回时按本子基金份额净值选择赎回，并按照本子基金的信托契约进行计算。本子基金的政策规定，基金管理人每日监控本子基金的流动性状况。

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(b) 流动性风险 (续)

下表汇总了截至报告期末，本子基金基于未折现的合同现金流量的金融资产和负债的到期情况，以全面审视本子基金的合约承诺与流动性。

金融负债

到期分类依据为自报告期末至合同到期日之间的剩余期间。当交易对手可选择金额支付的时间时，则将该负债分类至本子基金需支付的最早期间内。

金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券到期分类的分析依据为这些资产的预计变现日期。其他资产的到期分类的分析依据为自报告期末至合同到期日之间的剩余期间或者资产的预计变现日期两者间的较早者。

	即期 美元	1 个月内 到期 美元	1 个月至 3 个月 美元	3 个月 至 1 年 美元	合计 美元
截至 2024 年 12 月 31 日					
<u>金融资产</u>					
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融资产	-	512,286,240	-	-	512,286,240
应收利息	-	1,725,102	1,588,808	1,569,376	4,883,286
应收认购款	-	711,704	-	-	711,704
应收基金管理人款项	-	-	207,755	-	207,755
现金及现金等价物	21,097,829	-	-	-	21,097,829
金融资产合计	<u>21,097,829</u>	<u>514,723,046</u>	<u>1,796,563</u>	<u>1,569,376</u>	<u>539,186,814</u>
<u>金融负债</u>					
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债	-	2,739,780	-	-	2,739,780
应付管理费	-	610,857	-	-	610,857
应付受托人费用	-	51,721	-	-	51,721
其他应付款	-	3,660	-	31,813	35,473
应付赎回	-	408,344	-	-	408,344
应付经纪人款项	-	4,688	-	-	4,688
应占资产净值*	535,335,578	-	-	-	535,335,578
金融负债合计	<u>535,335,578</u>	<u>3,819,050</u>	<u>-</u>	<u>31,813</u>	<u>539,186,441</u>

* 受本子基金赎回条款之约束

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(b) 流动性风险 (续)

	即期 美元	1 个月内 到期 美元	1 个月至 3 个月 美元	3 个月 至 1 年 美元	合计 美元
截至 2023 年 12 月 31 日					
<u>金融资产</u>					
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融资产	-	109,802,793	-	-	109,802,793
应收利息	-	58,413	153,202	794,122	1,005,737
应收认购款	-	199,890	-	-	199,890
应收基金管理人款项	-	-	124,280	-	124,280
现金及现金等价物	1,462,367	-	-	-	1,462,367
金融资产合计	1,462,367	110,061,096	277,482	794,122	112,595,067
<u>金融负债</u>					
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债	-	77,342	-	-	77,342
应付管理费	-	178,917	-	-	178,917
应付受托人费用	-	12,926	-	-	12,926
应计费用和其他应付款	-	1,754	-	28,833	30,587
应付赎回	-	109,821	-	-	109,821
应占资产净值*	112,186,805	-	-	-	112,186,805
金融负债合计	112,186,805	380,760	-	28,833	112,596,398

* 受本子基金赎回条款之约束

(c) 信用及交易对手风险

信用风险指本子基金可能因交易对手未履行其责任而就未偿还的金融工具招致损失的风险。本子基金透过只与有信誉的交易对手进行买卖而尽量减低信用风险。

本子基金的所有证券交易均在交付时通过经审批的经纪人进行结算/支付。由于仅在经纪人收到款项后方交付证券，所以违约风险极小。仅当经纪人收到证券后，方支付购买款项。如果任何一方未能履行其义务，则交易失效。

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手风险 (续)

基金管理人的政策为，通过定期审阅本子基金交易对手（例如经纪人、保管人及银行）的信用评级、财务报表及新闻稿，密切监督其信誉度。

信用风险披露根据相关金融工具是否符合 IFRS 9 的减值披露要求而分为两个部分。

符合 IFRS 9 减值要求的金融资产

本子基金在 IFRS 9 下受预期信用损失模型影响的金融资产仅为现金及现金等价物、应收基金管理人款项、应收认购款和应收利息。截至 2024 年 12 月 31 日，现金及现金等价物、应收基金管理人款项、应收认购款和应收利息共计 26,900,574 美元，且并未计提任何损失准备（2023 年：共计 2,792,274 美元，且并未计提任何损失准备）。该等资产中不存在任何信用集中风险。在此期间，并无任何资产被视为已减值且未对任何金额进行冲销。

针对按摊余成本计量的金融资产，本子基金应用一般减值方法，且并无信息表明金融资产自初始确认以来信用风险显着增加。因此，金融资产仍归类于第 1 阶段，并以账面总额呈列。

计算损失准备时，已在按照前瞻性估计调整的应收账款的预期使用存续期间内，根据观察的历史损失率使用准备矩阵。项目按其性质分为以下类别：现金及现金等价物、应收经纪人款项、应收基金管理人款项、应收认购款以及应收利息。本子基金的所有现金及现金等价物均存放于位于香港的主要金融机构内，基金管理人认为该等金融机构具有高信用质量。基金管理人认为本子基金并未面临重大信用风险，故未计提任何损失准备。

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手风险 (续)

符合 IFRS 9 减值要求的金融资产 (续)

本子基金可能受到交易对手风险的集中程度影响的现金及现金等价物，主要包括银行持有的资产。下表概述了本子基金存放于银行的短期存款以及其获穆迪和标准普尔的信用评级：

2024 年 12 月 31 日	美元	信用评级	信用评级来源
<u>现金及现金等价物</u>			
中国银行（香港）有限公司	21,087,664	A+	标准普尔
平安银行股份有限公司广州分行	165	BBB+	标准普尔
<u>定期存款</u>			
渤海银行股份有限公司	10,000	BBB-	标准普尔
2023 年 12 月 31 日	美元	信用评级	信用评级来源
<u>现金及现金等价物</u>			
中国银行（香港）有限公司	1,436,595	A+	标准普尔
平安银行股份有限公司广州分行	165	A3	穆迪
<u>定期存款</u>			
浙商银行股份有限公司香港分行	25,607	BBB-	标准普尔

不符合 IFRS 9 减值要求的金融资产

本子基金面临债券及衍生资产的信用风险。由于该类金融资产以公允价值计量且其变动计入当期损益，故不符合 IFRS 9 的减值要求。根据 IFRS 9 的规定，该等资产的账面价值代表本子基金于各报告日不符合 IFRS 9 减值要求的金融工具的最大信用风险敞口。因此，并未就该等工具单独披露最大信用风险敞口。

本子基金投资由超国家组织、政府、政府机关、地方当局以及任何行业的公司发行或担保的固定收益和债务工具，且这些机构的信用评级等级至少为 Baa3 或 BBB-，或者由中国内地有关主管部门认可的当地评级机构给出的同等评级。

2024 年 12 月 31 日

11. 金融风险与管理目标和政策 (续)

风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手风险 (续)

不符合 IFRS 9 减值要求的金融资产 (续)

本子基金可能受到交易对手风险的集中程度影响的金融资产，主要包括保管人持有的资产。下表概述了本子基金存放于保管人的资产以及其获标准普尔的相关信用评级：

2024 年 12 月 31 日	美元	信用评级	信用评级来源
保管人			
中国银行 (香港) 有限公司	512,286,240	A+	标准普尔
2023 年 12 月 31 日			
保管人			
中国银行 (香港) 有限公司	109,802,793	A+	标准普尔

最大信用风险敞口为财务状况表中各金融资产的账面金额。

12. 报告期后事项

本财务报表的报告期末至授权公布日期间，本子基金对于 A 类 (港币) 份额，认购 1,259,627 份，赎回 1,866,292 份；对于 A 类 (人民币) 份额，认购 2,900,202 份，赎回 2,794,084 份；对于 A 类 (人民币) (对冲) 份额，认购 1,998 份；对于 A 类 (美元) 份额，认购 278,236 份，赎回 295,970 份；对于 A 类 (港币派息) 份额，认购 1,994 份；对于 A 类 (美元派息) 份额，认购 1,993 份；对于 A 类 (人民币派息) 份额，认购 1,998 份；对于 R 类 (人民币) 份额，认购 7,020,620,430 份，赎回 981,003,265 份；对于 R 类 (人民币) (对冲) 份额，认购 1,391,617,424 份，赎回 569,196,713 份；对于 R 类 (美元) (对冲) 份额，认购 11,874,323 份；对于 I 类 (人民币) 份额，认购 3,000,000 份，赎回 3,000,000 份；对于 I 类 (美元) 份额，认购 25,086,557 份，赎回 24,287,694 份；对于 I 类 (美元派息) 份额，认购 515,978 份，赎回 516,022 份；对于 C 类 (人民币) 份额，赎回 1,000 份；对于 C 类 (人民币) (对冲) 份额，赎回 1,000 份；对于 C 类 (美元) 份额，认购 10,747,909 份，赎回 2,095,926 份。

13. 财务报表的批准

本财务报表经受托人和基金管理人于 2025 年 4 月 28 日决议批准并授权公布。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
上市债务证券			
澳大利亚			
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.25% S/A PERP	3,000,000	2,994,420	0.56%
WESTPAC BANKING CORP 2.894% S/A 04FEB2030	6,190,000	6,175,020	1.15%
保加利亚			
REPUBLIC OF BULGARIA 5% S/A 05MAR2037	150,000	140,724	0.03%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	1,000,000	997,650	0.19%
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	2,280,000	2,196,643	0.41%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 5.25% S/A 26MAY2035	600,000	588,324	0.11%
BAIDU INC 3.075% S/A 07APR2025	200,000	198,910	0.04%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.75% S/A 27MAR2025	700,000	703,990	0.13%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.375% S/A 02MAR2025	500,000	497,465	0.09%
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	1,500,000	1,600,620	0.30%
MEITUAN 4.5% S/A 2APR2028 REGS	1,400,000	1,364,244	0.25%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	1,300,000	1,148,732	0.21%
MEITUAN DIANPING 4.625% S/A 02OCT2029 REGS	500,000	484,490	0.09%
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	250,000	253,177	0.05%
SANDS CHINA LTD 2.3% S/A 08MAR2027	2,000,000	1,863,640	0.35%
SANDS CHINA LTD 2.85% S/A 08MAR2029	500,000	446,115	0.08%
SANDS CHINA LTD 5.125% S/A 08AUG2025	1,000,000	997,290	0.19%
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTL CORP 2.693% S/A 27FEB2025	1,100,000	1,094,500	0.20%
SOAR WISE LTD 4.05% S/A 08OCT2024	1,700,000	1,692,197	0.32%
SUCI SECOND INVESTMENT CO 4.375% S/A 10SEP2027 REGS	500,000	490,895	0.09%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	7,495,000	7,579,469	1.42%
TENCENT HLDGS LTD 3.8% S/A 11FEB2025 REGS	2,984,000	2,979,404	0.56%
WEIBO CORP 3.375% S/A 08JUL2030	2,000,000	1,790,900	0.33%
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 5.98% S/A 30JAN2028	2,000,000	1,978,400	0.37%
智利			
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	700,000	707,462	0.13%
中国大陆			
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	300,000	306,366	0.06%
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 6.8% S/A 05AUG2025	1,000,000	1,008,600	0.19%
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 2.349% S/A 29OCT2025	500,000	483,130	0.09%
WUHAN METRO GROUP CO LTD 4.45% S/A 22OCT2027	1,000,000	990,190	0.18%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
上市债务证券			
中国大陆 (续)			
ZHENGZHOU URBAN CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 3.8% S/A 16JAN2025	1,500,000	1,497,990	0.28%
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.125% S/A 16JUL2025	1,200,000	1,180,860	0.22%
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	1,825,000	1,775,086	0.33%
爱沙尼亚			
BANCO SANTANDER SA 5.365% S/A 15JUL2028	1,000,000	1,007,200	0.19%
BANCO SANTANDER SA 5.439% S/A 15JUL2031	1,000,000	999,360	0.19%
法国			
BNP PARIBAS SA 4.625% S/A PERP REGS	200,000	187,168	0.03%
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	3,000,000	3,029,460	0.57%
德国			
DEUTSCHE BANK AG 6.25% A PERP	2,000,000	1,962,980	0.37%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	500,000	507,020	0.09%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	1,046,100	0.20%
中国香港			
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	1,000,000	964,770	0.18%
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	500,000	372,335	0.07%
AIA GROUP LTD 5.4% S/A 30SEP2054 REGS	500,000	468,260	0.09%
BANK OF EAST ASIA LTD 4% S/A 29MAY2030	3,000,000	2,974,080	0.56%
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	520,000	504,821	0.09%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	5,900,000	5,844,894	1.09%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	1,500,000	1,515,090	0.28%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	200,000	200,700	0.04%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	880,000	903,170	0.17%
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	1,000,000	1,007,780	0.19%
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	1,041,060	0.19%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	250,000	245,825	0.05%
CHIYU BANKING CORP LTD 8% S/A PERP	500,000	501,705	0.09%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% S/A 14MAR2025	15,000,000	14,991,150	2.80%
DAH SING BANK LTD 7.375% S/A 15NOV2033	1,500,000	1,564,965	0.29%
FAR EAST HORIZON LTD 3.375% S/A 18FEB2025	5,861,000	5,840,779	1.09%
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 26OCT2026	4,100,000	3,976,918	0.74%
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	3,000,000	3,030,060	0.57%
HUAXIN CEMENT INTL FINANCE CO LTD 2.25% S/A 19NOV2025	2,955,000	2,870,753	0.54%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6% S/A 6AUG2034	250,000	250,603	0.05%
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.4% S/A 03SEP2029	2,000,000	273,874	0.05%
印度			
REC LTD 4.75% S/A 27SEP2029	1,000,000	974,340	0.18%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

上市债务证券	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
印度尼西亚			
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	500,000	501,445	0.09%
爱尔兰			
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.7% A 11NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.75% A 12NOV2034	7,000,000	7,000,000	1.31%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 6.06% A 21NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
ZURICH FINANCE IRELAND II DAC 5.5% A 23APR2055	1,300,000	1,271,803	0.24%
日本			
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	831,088	0.16%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP	1,000,000	1,096,640	0.20%
NORINCHUKIN BANK 5.094% S/A 16OCT2029 REGS	200,000	199,026	0.04%
SEKISUI HOUSE LTD 4.7% S/A 23FEB2030	1,000,000	986,990	0.18%
SEKISUI HOUSE LTD 5.1% S/A 23OCT2034	1,300,000	1,266,187	0.24%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.836% S/A 09JUL2044	450,000	456,147	0.09%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.45% S/A 10SEP2027	900,000	892,260	0.17%
韩国			
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	513,275	0.10%
IND BK OF KOREA S+0.62% Q 30SEP2027 REGS	1,000,000	1,001,560	0.19%
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	750,000	759,157	0.14%
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M S+0.7% Q 23OCT2026	600,000	602,172	0.11%
KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	1,949,096	0.36%
KOREA LAND & HOUSING CORP 5.75% S/A 06OCT2025	1,000,000	1,005,270	0.19%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	750,000	752,498	0.14%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.9% Q 30SEP2027	500,000	502,635	0.09%
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.125% S/A 30SEP2027 REGS	300,000	295,458	0.06%
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.25% S/A 30SEP2029 REGS	500,000	483,680	0.09%
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	500,000	501,535	0.09%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.5% S/A 31JUL2027	500,000	501,135	0.09%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	200,000	201,828	0.04%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	700,000	711,991	0.13%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	1,532,880	0.29%
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	1,000,000	999,350	0.19%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
上市债务证券			
韩国 (续)			
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	1,500,000	1,444,185	0.27%
SK HYNIX INC 6.25% S/A 17JAN2026 REGS	520,000	525,902	0.10%
SK HYNIX INC 6.375% S/A 17JAN2028 REGS	800,000	824,856	0.15%
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 5.25% S/A PERP	442,000	439,786	0.08%
荷兰			
ING GROEP NV 7.25% S/A PERP	1,000,000	1,005,570	0.19%
SYNGENTA FINANCE NV 4.892% S/A 24APR2025 REGS	8,627,000	8,609,574	1.61%
卡塔尔			
QIIB TIER 1 SUKUK LLC 5.45% S/A PERP	500,000	502,645	0.09%
新加坡			
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	900,000	930,483	0.17%
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% S/A 11SEP2034	200,000	193,640	0.04%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	200,000	201,736	0.04%
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	800,000	812,760	0.15%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.1% S/A 28AUG2054	3,000,000	409,078	0.08%
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 6.75% S/A PERP	1,000,000	976,970	0.18%
瑞士			
UBS GROUP AG 7% A PERP	1,000,000	1,000,830	0.19%
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	400,000	433,232	0.08%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	400,000	460,180	0.09%
土耳其			
TVF VARLIK KIRALAMA AS 6.95% S/A 23JAN2030	400,000	401,272	0.07%
阿拉伯联合酋长国			
ABU DHABI DEVELOPMENTAL HOLDING CO PJSC 5.25% S/A 02OCT2054	500,000	460,050	0.09%
EMIRATES NBD BANK PJSC 5.141% S/A 26NOV2029	900,000	905,598	0.17%
英国			
BARCLAYS PLC 6.125% Q PERP	1,000,000	1,000,140	0.19%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.04% Q 19NOV2028	1,000,000	1,004,010	0.19%
HSBC HLDGS PLC 6.875% S/A PERP	800,000	797,904	0.15%
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP	2,500,000	2,521,950	0.47%
STANDARD CHARTERED PLC 5.005% S/A 15OCT2030 REGS	1,000,000	982,130	0.18%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	350,000	360,251	0.07%
STANDARD CHARTERED PLC L+1.51% Q PERP	1,000,000	928,910	0.17%
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	1,016,760	0.19%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
上市债务证券			
美国			
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.718% S/A 23JUL2032	1,300,000	1,304,290	0.24%
JPMORGAN CHASE & CO 5.294% S/A 22JUL2035	2,000,000	1,980,120	0.37%
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	1,213,896	0.23%
PROLOGIS LP 3.25% S/A 11SEP2029	5,000,000	684,733	0.13%
PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING 4.772% S/A 09DEC2029	400,000	395,564	0.07%
US TREASURY N/B 4.25% S/A 30NOV2026	1,000,000	1,000,020	0.19%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.55% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
乌兹别克斯坦			
NAVOI MINING & METALLURGICAL COMBINAT 6.7% S/A 17OCT2028 REGS	400,000	396,040	0.07%
英属维尔京群岛			
CENTRAL INTL DEVELOPMENT BVI LTD 5.1% S/A 19AUG2027	500,000	501,445	0.09%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	1,000,000	1,009,090	0.19%
CHINA CINDA FINANCE 2015 I LTD 4.25% S/A 23APR2025 REGS	2,150,000	2,143,443	0.40%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.375% S/A 08FEB2025	1,500,000	1,498,710	0.28%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	2,000,000	1,913,060	0.36%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 4.25% S/A 28APR2025	5,000,000	4,969,150	0.93%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	600,000	622,578	0.12%
CHINA SHENHUA OVERSEAS CAPITAL CO LTD 3.875% S/A 20JAN2025	14,930,000	14,919,250	2.79%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4% S/A 18FEB2025	9,740,000	9,722,858	1.82%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	1,700,000	1,696,855	0.32%
COASTAL EMERALD LTD 4.1% S/A 15JUN2022	1,000,000	993,430	0.19%
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	2,000,000	2,062,680	0.39%
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.1% S/A PERP	2,000,000	1,904,860	0.36%
FORTUNE STAR BVI LTD 5% S/A 18MAY2026	1,000,000	961,920	0.18%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	750,000	705,840	0.13%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% S/A 19OCT2025	2,000,000	1,985,340	0.37%
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% S/A 19MAY2028	1,000,000	1,008,410	0.19%
HAITONG INTL FINANCE HLDGS 2015 LTD 2.107% S/A 12MAR2025	5,200,000	5,166,616	0.97%
HUAFA 2020 I CO LTD 2.8% S/A 04NOV2025	2,700,000	2,625,102	0.49%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.25% S/A 07NOV2027	5,000,000	4,802,800	0.90%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% S/A 27APR2027	3,000,000	2,938,680	0.55%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	200,000	179,272	0.03%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% S/A 13NOV2029	2,000,000	1,844,260	0.34%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
上市债务证券			
英属维尔京群岛 (续)			
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.25% S/A PERP	4,030,000	3,978,174	0.74%
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625% S/A 03JUN2026	3,000,000	2,957,580	0.55%
HUARONG FINANCE II CO LTD 5% S/A 19NOV2025	2,000,000	1,988,020	0.37%
HUARONG FINANCE II CO LTD 5.5% S/A 16JAN2025	15,134,000	15,124,920	2.83%
JUNFENG INTERNATIONAL CO LTD 5.6% S/A 21OCT2027	1,500,000	1,505,595	0.28%
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD 4.75% S/A 30JUL2025	1,000,000	997,900	0.19%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	5,580,000	5,525,372	1.03%
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	440,705	0.08%
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	300,000	299,991	0.06%
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 2.75% S/A 02JUN2025	1,734,000	1,715,966	0.32%
YUNDA HLDG INVESTMENT LTD 2.25% S/A 19AUG2025	3,500,000	3,420,830	0.64%
ZHEJIANG BOXIN BVI LTD 6.2% S/A 21APR2025	2,000,000	2,003,400	0.37%
非上市/上市债务证券			
澳大利亚			
APA INFRASTRUCTURE LTD 5.125% S/A 16SEP2034 REGS	1,000,000	958,010	0.18%
APA INFRASTRUCTURE LTD 5.75% S/A 16SEP2044 REGS	250,000	242,865	0.05%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.95% S/A 22JUL2030 REGS	1,500,000	1,479,510	0.28%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.85% Q 16DEC2029 REGS	1,000,000	1,003,420	0.19%
MACQUARIE GROUP LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	505,595	0.09%
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.875% S/A PERP REGS	3,000,000	3,003,030	0.56%
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	2,000,000	1,978,220	0.37%
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 3M TS+2.90961% Q PERP	900,000	892,494	0.17%
ROYAL BANK OF CANADA 6.35% Q 24NOV2084	1,000,000	958,060	0.18%
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE LTD 4.875% S/A 06JUN2025 REGS	3,280,000	3,258,942	0.61%
智利			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	750,000	765,270	0.14%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
非上市/上市债务证券			
中国大陆			
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 5% A 17JAN2025 FXCD	4,000,000	4,000,240	0.75%
法国			
BNP PARIBAS SA 5.894% S/A 05DEC2034 REGS	500,000	512,370	0.10%
SOCIETE GENERALE SA 8.125% S/A PERP	950,000	930,563	0.17%
德国			
ALLIANZ SE 5.6% S/A 3SEP2054 REGS	1,400,000	1,384,810	0.26%
日本			
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 6.95% S/A 15SEP2026 REGS	1,200,000	1,225,452	0.23%
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 7.05% S/A 15SEP2028 REGS	1,200,000	1,243,296	0.23%
墨西哥			
BANCO SANTANDER MEXICO SA 5.621% S/A 10DEC2029 REGS	900,000	899,892	0.17%
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.45% S/A 24JAN2035	900,000	851,265	0.16%
GRUMA SAB DE CV 5.39% S/A 09DEC2034 REGS	300,000	292,755	0.05%
GRUMA SAB DE CV 5.761% S/A 09DEC2054 REGS	300,000	284,706	0.05%
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	500,000	429,935	0.08%
新加坡			
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.4% A 11DEC2034	6,000,000	6,000,000	1.12%
西班牙			
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	1,000,000	1,006,760	0.19%
瑞典			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	1,012,730	0.19%
英国			
BP CAPITAL MARKETS PLC 6.45% S/A PERP	750,000	773,092	0.14%
HSBC BANK PLC 5.5% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
HSBC BANK PLC 5.5% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
HSBC BANK PLC 5.5% A 21NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
HSBC BANK PLC 5.75% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
HSBC BANK PLC 5.8% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	1,000,000	1,001,410	0.19%
LLOYDS BANKING GROUP PLC S+1.06% Q 26NOV2028	2,000,000	2,004,220	0.37%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
非上市/上市债务证券			
美国			
ALLY FINANCIAL INC 5.543% S/A 17JAN2031	500,000	493,825	0.09%
ALLY FINANCIAL INC 6.646% S/A 17JAN2040	500,000	485,900	0.09%
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 6% S/A 15DEC2054	50,000	49,426	0.01%
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	829,272	0.15%
ARROW ELECTRONICS INC 5.15% S/A 21AUG2029	350,000	348,558	0.07%
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	300,000	307,152	0.06%
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	500,000	505,490	0.09%
CENCORA INC 4.625% S/A 15DEC2027	500,000	500,040	0.09%
CENCORA INC 5.15% S/A 15FEB2035	500,000	488,450	0.09%
CITIBANK NA 4.838% S/A 06AUG2029	1,000,000	994,550	0.19%
CITIBANK NA 4.929% S/A 06AUG2026	1,000,000	1,004,240	0.19%
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	1,000,000	1,013,040	0.19%
CITIGROUP INC 4.542% S/A 19SEP2030	2,000,000	1,944,600	0.36%
CITIGROUP INC 5.411% S/A 19SEP2039	800,000	762,664	0.14%
CVS HEALTH CORP 7% S/A 10MAR2055	500,000	502,910	0.09%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	550,000	551,617	0.10%
DUKE ENERGY CORP 6.45% S/A 01SEP2054	300,000	304,734	0.06%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.9% S/A 06OCT2029	500,000	492,510	0.09%
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.692% S/A 23OCT2030	1,500,000	1,470,180	0.27%
GOODMAN US FINANCE FIVE LLC 4.625% S/A 04MAY2032 REGS	1,000,000	947,080	0.18%
GOODMAN US FINANCE SIX LLC 5.125% S/A 07OCT2034 REGS	2,000,000	1,927,220	0.36%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.04% Q 19MAR2027	1,000,000	1,002,490	0.19%
JPMORGAN CHASE & CO 4.505% S/A 22OCTFEB2028	1,000,000	991,430	0.19%
JPMORGAN CHASE & CO 4.979% S/A 22JUL2028	500,000	501,545	0.09%
JPMORGAN CHASE & CO 5.012% S/A 23JAN2030	400,000	398,680	0.07%
JPMORGAN CHASE & CO S+0.86% Q 22OCT2028	2,000,000	2,006,020	0.37%
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 21NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	203,536	0.04%
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.812% S/A 21COT2032	1,000,000	972,980	0.18%
RANDE PROPERTY 6.65% S/A 01JUN2055	600,000	602,268	0.11%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 3.125% S/A 12MAY2023 REGS	700,000	682,836	0.13%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	761,460	0.14%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.7% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.93%
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	307,230	0.06%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合列表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	名义价值/数量	公允价值 (美元)	在资产净值 中的占比
集合投资计划			
中国香港			
CHINAAMC ASIA ESG BOND FUND-CLASS I	477,588	5,139,710	0.96%
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	3,618,605	42,467,952	7.93%
CHINAAMC SELECT ASIA BOND FUND-I ACC USD	1,218,560	10,965,454	2.05%
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	3,050,837	33,106,154	6.18%
CNCB CAPITAL ASIAN INVESTMENT GRADE BOND FUND CLASS I USD ACC	50,000	5,087,500	0.95%
卢森堡			
CHINAAMC GLOBAL SELCTED INCOME FUND-I A USD	931,084	10,653,464	1.99%
远期外汇合约			
Buy CNY227,838,336.00 Sell USD32,000,000.00(Counterparty: Citibank, National Association)		(930,442)	(0.17%)
Buy CNY741,853,620.59 Sell USD102,158,365.78 (交易 对手: JPM Chase Bank)		(827,609)	(0.15%)
Buy CNY226,534,400.00 Sell USD32,000,000.00 (交易 对手: 中国银行 (香港) 有限公司)		(981,729)	(0.18%)
Buy USD32,000,000.00 Sell USD233,664,000.00 (交易 对手: 中国银行 (香港) 有限公司)		136,009	0.03%
Buy USD32,000,000.00 Sell USD232,689,209.60 (交易 对手: JPM Chase Bank)		138,756	0.03%
总投资组合		509,546,460	93.37%
其他资产净值		25,789,118	6.63%
资产净值总额		535,335,578	100.00%
投资总额 (按成本计量)		511,291,065	

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	-	2,280,000	-	-	2,280,000
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	-	6,574,000	-	(6,574,000)	-
ABBVIE INC 5.4% S/A 15MAR2054	-	400,000	-	(400,000)	-
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC 0.08% S/A PERP	300,000	-	-	(300,000)	-
ABU DHABI DEVELOPMENTAL HOLDING CO PJSC 4.375% S/A 02OCT2031	-	1,750,000	-	(1,750,000)	-
ABU DHABI DEVELOPMENTAL HOLDING CO PJSC 5.25% S/A 02OCT2054	-	1,250,000	-	(750,000)	500,000
ADANI TRANSMISSION LTD 4% S/A 03AUG2026 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
ADNOC MURBAN RSC LTD 4.25% S/A 11SEP2034 REGS	-	2,050,000	-	(2,050,000)	-
ADNOC MURBAN RSC LTD 4.5% S/A 11SEP2034 REGS	-	4,450,000	-	(4,450,000)	-
ADNOC MURBAN RSC LTD 5.125% S/A 11SEP2054 REGS	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
AFRICAN DEVELOPMENT BANK A 5.75% PERP	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD/SEOUL 0% A 07FEB2024 CD	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	-	500,000	-	-	500,000
AIA GROUP LTD 5.375% S/A 15APR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
AIA GROUP LTD 5.4% S/A 30SEP2054 REGS	-	500,000	-	-	500,000
ALIBABA GROUP HLDG LTD 3.6% S/A 28NOV2024	-	11,300 ,000	-	(11,300, 000)	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 4.875% S/A 26MAY2030	-	500,000	-	(500,000)	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 5.25% S/A 26MAY2035	-	600,000	-	-	600,000
ALIBABA GROUP HLDG LTD 5.625% S/A 26NOV2054	-	200,000	-	(200,000)	-
ALLIANZ SE 5.6% S/A 3SEP2054 REGS	-	1,400,000	-	-	1,400,000
ALLY FINANCIAL INC 5.543% S/A 17JAN2031	-	500,000	-	-	500,000
ALLY FINANCIAL INC 6.646% S/A 17JAN2040	-	500,000	-	-	500,000
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.9% S/A 10JAN2034	-	700,000	-	(700,000)	-
ANTOFAGASTA PLC 2.375% S/A 14OCT2030 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
AOZORA BANK LTD 5.9% S/A 02MAR2026	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
APA INFRASTRUCTURE LTD 5.125% S/A 16SEP2034 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
APA INFRASTRUCTURE LTD 5.75% S/A 16SEP2044 REGS	-	250,000	-	-	250,000
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 6% S/A 15DEC2054	-	250,000	-	(200,000)	50,000
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	-	-	-	800,000
ARROW ELECTRONICS INC 5.15% S/A 21AUG2029	-	350,000	-	-	350,000
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	-	-	-	800,000
ASTRAZENECA PLC 4.375% S/A 17AUG2048	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
ASTRAZENECA PLC 4.8% S/A 06AUG2030	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
ASTRAZENECA PLC 4.9% S/A 02FEB2031	-	800,000	-	(800,000)	-
ASTRAZENECA PLC 5% S/A 26FEB2034	-	400,000	-	(400,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK GROUP LTD 5.731% S/A 18SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.95% S/A 22JUL2030 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 5.204% S/A 25NOV2035 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.85% Q 16DEC2029 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/NEW YORK 3.919% S/A 30SEP2027	-	1,096,000	-	(1,096,000)	-
AUTOMATIC DATA PROCESSNG INC 4.45% S/A 9SEP2034	-	450,000	-	(450,000)	-
AVALONBAY COMMUNITIES INC 5.35% S/A 1JUN2034	-	400,000	-	(400,000)	-
BAE SYSTEMS PLC 5.3% S/A 26MAR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2% S/A 16MAR2024	1,660,000	-	-	(1,660,000)	-
BAIDU INC 3.075% S/A 07APR2025	-	200,000	-	-	200,000
BANCO BANCOMER SA/TEXAS 5.25% S/A 10SEP2029	-	200,000	-	(200,000)	-
BANCO BBVA PERU SA 6.2% S/A 7JUN2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 5.381% S/A 13MAR2029	-	200,000	-	(200,000)	-
BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 6% S/A 18MAR2031 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
BANCO SANTANDER MEXICO SA 5.621% S/A 10DEC2029 REGS	-	900,000	-	-	900,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
BANCO SANTANDER SA 5.365% S/A 15JUL2028	-	2,400,000	-	(1,400,000)	1,000,000
BANCO SANTANDER SA 5.439% S/A 15JUL2031	-	2,400,000	-	(1,400,000)	1,000,000
BANCO SANTANDER SA 5.538% S/A 14MAR2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO SANTANDER SA 5.552% S/A 14MAR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO SANTANDER SA 6.35% S/A 14MAR2034	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
BANCO SANTANDER SA 8% Q PERP	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
BANCO SANTANDER SA S+1.12% Q 15JUL2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	-	2,000,000	-	(1,000,000)	1,000,000
BANK OF AMERICA CORP 5.425% S/A 15AUG2035	-	500,000	-	(500,000)	-
BANK OF AMERICA CORP 5.468% S/A 23JAN2035	-	250,000	-	(250,000)	-
BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	-	15,000,000	-	(15,000,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 4% S/A 29MAY2030	-	3,000,000	-	-	3,000,000
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	-	520,000	-	-	520,000
BANK OF EAST ASIA LTD 5.125% S/A 07JUL2028	-	500,000	-	(500,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	-	5,900,000	-	-	5,900,000
BANK OF EAST ASIA LTD 5.875% S/A PERP (CALLED)	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	-	1,500,000	-	-	1,500,000
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	-	2,300,000	-	(2,100,000)	200,000
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	-	500,000	-	-	500,000
BANK OF NEW ZEALAND 5.076% S/A 30JAN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANK OF NOVA SCOTIA 3M TS+2.90961% Q PERP	-	900,000	-	-	900,000
BARCLAYS PLC 6.125% Q PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
BARCLAYS PLC 8% Q PERP (CALLED)	600,000	-	-	(600,000)	-
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	-	300,000	-	-	300,000
BAT CAPITAL CORP 6% S/A 20FEB2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BECTON DICKINSON AND CO 5.11% S/A 08FEB2034	-	750,000	-	(750,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
BIOCON BIOLOGICS GLOBAL PLC 6.67% S/A 9OCT2029 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
BK OF CHINA/TOKYO CD 0% A 04OCT2024	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BK OF NOVA SCOTIA 8% Q 27JAN2084	-	500,000	-	(500,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 4.7% S/A 14MAR2029	-	500,000	-	(500,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 5% S/A 14MAR2034	-	750,000	-	(750,000)	-
BLACKROCK FUNDING INC 5.25% S/A 14MAR2054	-	300,000	-	(300,000)	-
BLUE OWL CREDIT INCOME CORP 6.65% S/A 15MAR2031	-	200,000	-	(200,000)	-
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.1% S/A PERP (CALLED)	1,200,000	-	-	(1,200,000)	-
BNP PARIBAS SA 4.625% S/A PERP REGS	-	200,000	-	-	200,000
BNP PARIBAS SA 5.283% S/A 19NOV2030 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BNP PARIBAS SA 5.894% S/A 05DEC2034 REGS	-	500,000	-	-	500,000
BNP PARIBAS SA 6.625% S/A PERP REGS (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
BOC AVIATION USA CORP 5.25% S/A 14JAN2030 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BOEING CO 6.298% S/A 01MAY2029	-	300,000	-	(300,000)	-
BOEING CO 6.858% S/A 1MAY2054	-	300,000	-	(300,000)	-
BOEING CO 7.008% S/A 1MAY2064 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
BOSTON PROPERTIES LP 5.75% S/A 15MAR2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BP CAPITAL MARKETS PLC 6.45% S/A PERP	-	750,000	-	-	750,000
BPCE SA 5.281% S/A 30MAY2035 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
BPCE SA 5.936% S/A 30MAY2035 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.125% S/A 15MAR2034	-	300,000	-	(300,000)	-
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 7.125% S/A 13MAY2054	-	500,000	-	(500,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.9% S/A 22FEB2027	-	200,000	-	(200,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.9% S/A 22FEB2029	-	200,000	-	(200,000)	-
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.1% S/A 22FEB2031	-	400,000	-	(400,000)	-
BROADCOM INC 5.05% S/A 12JUL2027 REGS	-	600,000	-	(600,000)	-
BROADCOM INC 5.05% S/A 12JUL2029 REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
BROADCOM INC 5.15% S/A 15NOV2031	-	200,000	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 5.5% S/A 15MAR2055	-	600,000	-	(600,000)	-
CAMPBELL SOUP CO 5.4% S/A 21MAR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.463% S/A 26JUL2030	-	800,000	-	(800,000)	-
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.7% S/A 01FEB2030	-	700,000	-	(700,000)	-
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.051% S/A 1FEB2035	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	-	500,000	-	-	500,000
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.3% S/A 05SEP2039	-	400,000	-	(400,000)	-
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	-	900,000	-	-	900,000
CBQ FINANCE LTD 5.375% S/A 28MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CCCI TREASURE LTD 3.425% S/A PERP	-	10,268,000	-	(10,268,000)	-
CCTHK 2021 LTD 2% S/A 19JAN2025	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
CELESTIAL DYNASTY LTD 4.25% S/A 27JUN2029	-	400,000	-	(400,000)	-
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% S/A 22AUG2029	-	850,000	-	(850,000)	-
CELESTIAL MILES LTD 5.75% S/A PERP (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
CENCORA INC 4.625% S/A 15DEC2027	-	500,000	-	-	500,000
CENCORA INC 5.15% S/A 15FEB2035	-	500,000	-	-	500,000
CENTRAL INTL DEVELOPMENT BVI LTD 5.1% S/A 19AUG2027	-	500,000	-	-	500,000
CHAMPION MTN LTD 2.95% S/A 15JUN2030	-	500,000	-	(500,000)	-
CHENGDU COMMUNICATIONS INVESTMENT GROUP CORP LTD 2.2% S/A 01DEC2024	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CHILE ELECTRICITY LUX 5.58% S/A 20OCT2035 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.25% S/A 20JAN2024	2,300,000	-	-	(2,300,000)	-
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CHINA CINDA FINANCE 2014 LTD 5.625% S/A 14MAY2024 REGS	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
CHINA CINDA FINANCE 2015 I LTD 4.25% S/A 23APR2025 REGS	-	2,150,000	-	-	2,150,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.1% S/A 09MAR2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.375% S/A 08FEB2025	-	1,500,000	-	-	1,500,000
CHINA CITIC BANK INTL LTD 4.625% S/A 28FEB2029 (CALLED)	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	1,300,000	-	-	(420,000)	880,000
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 5% A 17JAN2025 FXCD	-	4,000,000	-	-	4,000,000
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+0.5% Q 21DEC2024	382,000	-	-	(382,000)	-
CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 2.875% S/A 28SEP2030	-	700,000	-	(700,000)	-
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS IV LTD 3.95% S/A PERP (CALLED)	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 4.25% S/A 28APR2025	-	5,000,000	-	-	5,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	-	600,000	-	-	600,000
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	-	991,000	-	(991,000)	-
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.75% S/A 27MAR2025	-	700,000	-	-	700,000
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VI LTD 5.95% S/A 08MAY2024	1,300,000	-	-	(1,300,000)	-
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.375% S/A 02MAR2025	-	500,000	-	-	500,000
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 6.125% S/A 16MAY2034	-	300,000	-	(300,000)	-
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP (CALLED)	-	10,072,000	-	(10,072,000)	-
CHINA RESOURCES LAND LTD 6% S/A 27FEB2024	2,609,000	-	-	(2,609,000)	-
CHINA SHENHUA OVERSEAS CAPITAL CO LTD 3.875% S/A 20JAN2025	-	14,930,000	-	-	14,930,000
CHINA STATE CONSTRUCTION FINANCE CAYMAN III LTD 4% S/A PERP (CALLED)	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	-	250,000	-	-	250,000
CHIYU BANKING CORP LTD 8% S/A PERP	-	500,000	-	-	500,000
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP (CALLED)	-	1,350,000	-	(1,350,000)	-
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4% S/A 18FEB2025	-	9,740,000	-	-	9,740,000
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD S+0.95% Q 18JAN2027	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5% S/A 15MAY2029	-	500,000	-	(500,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5.125% S/A 31MAY2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5.25% S/A 15FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
CIMIC FINANCE USA PTY LTD 7% S/A 25MAR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CITIBANK NA 4.838% S/A 06AUG2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CITIBANK NA 4.876% S/A 19NOV2027	-	12,200,000	-	12,200,000	-
CITIBANK NA 4.929% S/A 06AUG2026	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CITIBANK NA 5.438% S/A 30APR2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	-	1,700,000	-	(700,000)	1,000,000
CITIBANK NA S+0.59% Q 30APR2026	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
CITIBANK NA S+0.708% Q 06AUG2026	-	450,000	-	(450,000)	-
CITIBANK NA S+0.712% Q 19NOV2027	-	14,700,000	-	(14,700,000)	-
CITIGROUP INC 4.542% S/A 19SEP2030	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CITIGROUP INC 5.411% S/A 19SEP2039	-	800,000	-	-	800,000
CITIGROUP INC 5.449% S/A 11JUN2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
CITIGROUP INC 5.592% S/A 19NOV2034	-	3,200,000	-	(3,200,000)	-
CITIGROUP INC 7.125% Q PERP	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
CITIGROUP INC 7.2% Q PERP	-	700,000	-	(700,000)	-
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.718% S/A 23JUL2032	-	1,300,000	-	-	1,300,000
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.841% S/A 23JAN2030	-	300,000	-	(300,000)	-
CK HUTCHISON INTERNATIONAL 24 LTD 4.75% S/A 13SEP2034 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
CK HUTCHISON INTL 24 LTD 4.375% S/A 13MAR2030 REGS	-	300,000	-	(300,000)	-
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	500,000	1,200,000	-	-	1,700,000
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% S/A 14MAR2025	-	15,870,000	-	(870,000)	15,000,000
CNOOC NEXEN FINANCE 2014 ULC 4.25% S/A 30APR2024	-	433,000	-	(433,000)	-
COASTAL EMERALD LTD 4.1% S/A 15JUN2022	-	1,000,000	-	-	1,000,000
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	-	3,000,000	-	(1,000,000)	2,000,000
COCA-COLA CO 4.65% S/A 14AUG2034	-	700,000	-	(700,000)	-
COCA-COLA CO 5% S/A 13MAY2034	-	600,000	-	(600,000)	-
COCA-COLA CO 5.2% S/A 14JAN2055	-	300,000	-	(300,000)	-
COLUMBIA PIPELINES HOLDING CO LLC 5.681% S/A 15JAN2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
COMCAST CORP 5.1% S/A 1JUN2029	-	700,000	-	(700,000)	-
COMCAST CORP 5.3% S/A 1JUN2034	-	300,000	-	(300,000)	-
COMCAST CORP 5.65% S/A 1JUN2054	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.45% S/A 24JAN2035	-	900,000	-	-	900,000
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.837% S/A 13MAR2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
CONOCOPHILLIPS CO 5.5% S/A 15JAN2055	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
CONOCOPHILLIPS CO 5.65% S/A 15JAN2065	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.3% S/A 08SEP2053 REGS	-	750,000	-	(750,000)	-
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	-	750,000	-	-	750,000
COSAN LUXEMBOURG SA 7.25% S/A 27JUN2031 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
CRCC CHENGAN LTD 3.97% S/A PERP (CALLED)	3,000,000	-	-	(3,000,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 5.134% S/A 11MAR2027 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 6.251% S/A 10JAN2035	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 6.7% Q PERP REGS	-	2,700,000	-	(2,700,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
CREDIT AGRICOLE SA 7.875% Q PERP REGS (CALLED)	2,100,000	-	-	(2,100,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA S+0.87% Q 11MAR2027 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
CROWN CASTLE INC 5.6% S/A 01JUN2029	200,000	-	-	(200,000)	-
CROWN CASTLE INC 5.8% S/A 01MAR2034	300,000	-	-	(300,000)	-
CSL FINANCE PLC 5.106% S/A 03APR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
CSL FINANCE PLC 5.417% S/A 03APR2054	-	250,000	-	(250,000)	-
CUMMINS INC 5.15% S/A 20FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
CUMMINS INC 5.45% S/A 20FEB2054	-	700,000	-	(700,000)	-
CVS HEALTH CORP 7% S/A 10MAR2055	-	500,000	-	-	500,000
DAH SING BANK LTD 5% S/A 15JAN2029 (CALLED)	2,500,000	-	-	(2,500,000)	-
DAH SING BANK LTD 7.375% S/A 15NOV2033	-	1,500,000	-	-	1,500,000
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 5.1% S/A PERP REGS (CALLED)	350,000	-	-	(350,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5% S/A 1JAN2037	-	250,000	-	(250,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 18JAN2034	-	300,000	-	(300,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 25JUN2034	-	550,000	-	(550,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	-	550,000	-	-	550,000
DBS GROUP HLDGS LTD S+0.61% Q 12SEP2025 REGS	500,000	-	-	(500,000)	-
DEUTSCHE BANK AG 6.25% A PERP	-	2,000,000	-	-	2,000,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 4.999% S/A 11SEP2030	-	800,000	-	(800,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.403% S/A 11SEP2035	-	500,000	-	(500,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	-	1,000,000	-	(500,000)	500,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.706% S/A 08FEB2029	-	900,000	-	(900,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	-	-	-	1,000,000
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.15% S/A 30JAN2030	-	600,000	-	(600,000)	-
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.2% S/A 18APR2027	-	600,000	-	(600,000)	-
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.4% S/A 18APR2034	-	600,000	-	(600,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.9% S/A 18APR2064	-	250,000	-	(250,000)	-
DUKE ENERGY CORP 6.45% S/A 01SEP2054	-	300,000	-	-	300,000
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.1% S/A PERP	-	4,000,000	-	(2,000,000)	2,000,000
ELI LILLY & CO 4.7% S/A 09FEB2034	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
ELI LILLY & CO 5% S/A 09FEB2054	-	250,000	-	(250,000)	-
EMIRATES NBD BANK PJSC 5.141% S/A 26NOV2029	-	900,000	-	-	900,000
ENTERGY CORP 7.125% S/A 1DEC2054	-	350,000	-	(350,000)	-
EQUINIX INC 5.5% S/A 15JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-
ESIC SUKUK LTD 5.831% S/A 14FEB2029	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
EXELON CORP 5.45% S/A 15MAR2034	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
EXPORT-IMPORT BANK OF THAILAND 5.354% S/A 16MAY2029	-	600,000	-	(600,000)	-
F&G ANNUITIES & LIFE INC 6.5% S/A 4JUN2029	-	250,000	-	(250,000)	-
FAR EAST HORIZON LTD 3.375% S/A 18FEB2025	-	5,861,000	-	-	5,861,000
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 26OCT2026	-	4,100,000	-	-	4,100,000
FAR EAST HORIZON LTD 5.875% S/A 5MAR2028	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	-	4,000,000	-	(1,000,000)	3,000,000
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS DU QUEBEC 5.25% S/A 26APR2029	-	400,000	-	(400,000)	-
FIFTH THIRD BANCORP 5.631% S/A 29JAN2032	-	600,000	-	(600,000)	-
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.125% S/A 08MAR2034	-	750,000	-	(750,000)	-
FORTUNE STAR BVI LTD 5% S/A 18MAY2026	-	1,000,000	-	-	1,000,000
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	-	750,000	-	-	750,000
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% S/A 19OCT2025	-	2,000,000	-	-	2,000,000
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% S/A 19MAY2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
FWD GROUP LTD 5.75% S/A 09JUL2024	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	-	1,500,000	-	-	1,500,000
GACI FIRST INVESTMENT CO 5.25% S/A 13OCT2032	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
GATX CORP 6.05% S/A 05JUN2054	-	300,000	-	(300,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
GEELY AUTOMOBILE HLDGS LTD 4% S/A PERP (CALLED)	1,000,000	8,736,000	-	(9,736,000)	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.9% S/A 06OCT2029	-	500,000	-	-	500,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.4% S/A 08MAY2027	-	775,000	-	(775,000)	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.75% S/A 08FEB2031	-	400,000	-	(400,000)	-
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.692% S/A 23OCT2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000
GOODMAN US FINANCE FIVE LLC 4.625% S/A 04MAY2032 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
GOODMAN US FINANCE SIX LLC 5.125% S/A 07OCT2034 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
GRUMA SAB DE CV 5.39% S/A 09DEC2034 REGS	-	300,000	-	-	300,000
GRUMA SAB DE CV 5.761% S/A 09DEC2054 REGS	-	300,000	-	-	300,000
HAITONG INTL FINANCE HLDGS 2015 LTD 2.107% S/A 12MAR2025	-	5,200,000	-	-	5,200,000
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	-	-	-	500,000
HANWHA TOTAL PETROHEMICAL CO LTD 5.5% S/A 18JUL2029	-	800,000	-	(800,000)	-
HASBRO INC 6.05% S/A 14MAY2034	-	300,000	-	(300,000)	-
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.2% S/A 15JUN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HEALTH CARE SERVICE CORP 5.875% S/A 15JUN2054 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.4% S/A 25SEP2027	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.55% S/A 15OCT2029	-	700,000	-	(700,000)	-
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 4.85% S/A 15OCT2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HOME DEPOT INC 4.75% S/A 25JUN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 4.85% S/A 25JUN2031	-	900,000	-	(900,000)	-
HOME DEPOT INC 4.875% S/A 25JUN2027	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 4.95% S/A 25JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 5.1% S/A 24DEC2025	-	400,000	-	(400,000)	-
HOME DEPOT INC 5.15% S/A 25JUN2026	-	900,000	-	(900,000)	-
HOME DEPOT INC 5.3% S/A 25JUN2054	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC 5.4% S/A 25JUN2064	-	200,000	-	(200,000)	-
HOME DEPOT INC S+0.33% Q 24DEC2025	-	400,000	-	(400,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
HONEYWELL INTL INC 4.7% S/A 01FEB2030	-	900,000	-	(900,000)	-
HONEYWELL INTL INC 4.75% S/A 01FEB2032	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HSBC BANK PLC 5.5% A 14NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HSBC BANK PLC 5.5% A 18NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HSBC BANK PLC 5.5% A 21NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HSBC BANK PLC 5.75% A 22NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HSBC BANK PLC 5.8% A 22NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HSBC HLDGS PLC 3.803% S/A 11MAR2025 (CALLED)	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.04% Q 19NOV2028	-	1,500,000	-	(500,000)	1,000,000
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.29% Q 19NOV2030	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HSBC HLDGS PLC 4.25% S/A 14MAR2024	2,395,000	-	-	(2,395,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.13% S/A 19NOV2028	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.286% S/A 19NOV2030	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.874% S/A 18NOV2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP (CALLED)	-	200,000	-	(200,000)	-
HSBC HLDGS PLC 6.875% S/A PERP	-	1,400,000	-	(600,000)	800,000
HSBC HLDGS PLC 6.95% S/A PERP	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
HUAFA 2020 I CO LTD 2.8% S/A 04NOV2025	-	2,700,000	-	-	2,700,000
HUAFA 2021 I CO LTD 4.25% S/A PERP (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.25% S/A 07NOV2027	-	5,000,000	-	-	5,000,000
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% S/A 27APR2027	-	3,000,000	-	-	3,000,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.25% S/A 13NOV2024	-	4,883,000	-	(4,883,000)	-
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	200,000	-	-	-	200,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.75% S/A 29MAY2024	1,200,000	1,800,000	-	(3,000,000)	-
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% S/A 13NOV2029	-	2,000,000	-	-	2,000,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.25% S/A PERP	600,000	3,430,000	-	-	4,030,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625% S/A 03JUN2026	-	3,000,000	-	-	3,000,000
HUARONG FINANCE II CO LTD 5% S/A 19NOV2025	-	2,000,000	-	-	2,000,000
HUARONG FINANCE II CO LTD 5.5% S/A 16JAN2025	-	16,634,000	-	(1,500,000)	15,134,000
HUAXIN CEMENT INTL FINANCE CO LTD 2.25% S/A 19NOV2025	-	2,955,000	-	-	2,955,000
HUMANA INC 5.375% S/A 15APR2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.25% S/A 30JUN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.5% S/A 30JUN2034	-	200,000	-	(200,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.25% S/A 08JAN202 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.3% S/A 08JAN2029 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% S/A 08JAN2031 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.04% Q 19MAR2027	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 5.125% S/A 05FEB2027 REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 5.125% S/A 05FEB2029 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
HYUNDAI CARD CO LTD 5.75% S/A 24APR2029	-	200,000	-	(200,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.6% S/A 05FEB2027	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.6% S/A 05FEB2029	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.75% S/A 05FEB2031	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 4.9% S/A 05FEB2034	-	300,000	-	(300,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 5.25% S/A 05FEB2044	-	700,000	-	(700,000)	-
IBM INTERNAT CAPITAL PTE LTD 5.3% S/A 05FEB2054	-	700,000	-	(700,000)	-
ICBC/LU 0% 11MAR2024 CD	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
IND BK OF KOREA 4% S/A 30SEP2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
IND BK OF KOREA S+0.62% Q 30SEP2027 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
INDIKA ENERGY TBK PT 8.75% S/A 05JUL2029 REGS	-	550,000	-	(550,000)	-
ING GROEP NV 6.75% S/A PERP (CALLED)	800,000	1,800,000	-	(2,600,000)	-
ING GROEP NV 7.25% S/A PERP	-	1,900,000	-	(900,000)	1,000,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
INGERSOLL-RAND INC 5.176% S/A 15JUN2029	-	400,000	-	(400,000)	-
INGERSOLL-RAND INC 5.314% S/A 15JUN2031	-	400,000	-	(400,000)	-
INGERSOLL-RAND INC 5.45% S/A 15JUN2034	-	400,000	-	(400,000)	-
INTEL CORP 5.6% S/A 21FEB2054	-	750,000	-	(750,000)	-
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 5.25% S/A 15JUN2031	-	200,000	-	(200,000)	-
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	-	700,000	-	-	700,000
JERA CO INC 4.614% S/A 4SEP2029	-	500,000	-	(500,000)	-
JINAN SHUNTONG INTERNATIONAL CO LTD 6.7% S/A 18NOV2024	2,600,000	-	-	(2,600,000)	-
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	-	300,000	-	-	300,000
JOHN DEERE CAPITAL CORP 5.1% S/A 11APR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 5.5% S/A 1FEB2027	-	500,000	-	(500,000)	-
JPMORGAN CHASE & CO 4.505% S/A 22OCTFEB2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
JPMORGAN CHASE & CO 4.946% S/A 22OCT2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
JPMORGAN CHASE & CO 4.979% S/A 22JUL2028	-	1,500,000	-	(1,000,000)	500,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.012% S/A 23JAN2030	-	2,900,000	-	(2,500,000)	400,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.294% S/A 22JUL2035	-	2,000,000	-	-	2,000,000
JPMORGAN CHASE & CO S+0.86% Q 22OCT2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
JPMORGAN CHASE & CO S+0.93% Q 22JUL2028	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 14NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 18NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 21NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
JUNFENG INTERNATIONAL CO LTD 5.6% S/A 21OCT2027	-	1,500,000	-	-	1,500,000
KELLOGG CO 5.75% S/A 16MAY2054	-	200,000	-	(200,000)	-
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	-	750,000	-	-	750,000
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M S+0.7% Q 23OCT2026	600,000	-	-	-	600,000
KOREA EXPRESSWAY CORP 5% S/A 14MAY2027 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	-	-	-	1,900,000
KOREA LAND & HOUSING CORP 5.75% S/A 06OCT2025	1,000,000	-	-	-	1,000,000
KOREA MINE REHABILITATION & MINERAL RESOURCES CORP 5.125% S/A 08MAY2029	-	300,000	-	(300,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	-	750,000	-	-	750,000
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.9% Q 30SEP2027	-	500,000	-	-	500,000
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.125% S/A 30SEP2027 REGS	-	300,000	-	-	300,000
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.25% S/A 30SEP2029 REGS	-	500,000	-	-	500,000
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.875% S/A 03APR2027 REGS	-	750,000	-	(750,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.875% S/A 03APR2029 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	-	750,000	-	(250,000)	500,000
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2029	-	300,000	-	(300,000)	-
KROGER CO 5.65% S/A 15SEP2064	-	200,000	-	(200,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 04JUN2027 REGS	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 04JUN2030 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
KSA SUKUK LTD 5.25% S/A 4JUN2034 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC 4.447% S/A 02OCT2029	-	400,000	-	(400,000)	-
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS 4.8% S/A 1OCT2034	-	200,000	-	(200,000)	-
LG ELECTRONICS 5.625 S/A 24APR2027	-	700,000	-	(700,000)	-
LG ELECTRONICS INC 5.625% S/A 24APR2029 REGS	-	350,000	-	(350,000)	-
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	-	500,000	-	-	500,000
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2029 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
LG ENERGY SOLUTION 5.5% S/A 02JUL2034 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.087% S/A 26NOV2028	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.462% A 05JAN2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.59% S/A 26NOV2035	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.679% S/A 05JAN2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP	-	2,500,000	-	-	2,500,000
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC S+1.06% Q 26NOV2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
LOCKHEED MARTIN 4.5% S/A 15FEB2029	-	800,000	-	(800,000)	-
LOCKHEED MARTIN 4.8% S/A 15AUG2034	-	200,000	-	(200,000)	-
LOCKHEED MARTIN 5.2% S/A 15FEB2064	-	200,000	-	(200,000)	-
LSEGA FINANCING PLC 5.297% S/A 28MAR2034 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
MACQUARIE GROUP LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	-	-	-	500,000
MARRIOTT INTL 4.875% S/A 15MAY2029	-	500,000	-	(500,000)	-
MARRIOTT INTL 5.3% S/A 15MAY2034	-	500,000	-	(500,000)	-
MARUBENI CORP 4.458% S/A 19SEP2029	-	700,000	-	(700,000)	-
MASTERCARD INC 4.875% S/A 09MAY2034	-	500,000	-	(500,000)	-
MDGH SUKUK LTD 4.959% S/A 04APR2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MEIJI YASUDA LIFE INSURANCE CO 5.8% S/A 11SEP2054 REGS	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MEITUAN 4.5% S/A 2APR2028 REGS	-	1,400,000	-	-	1,400,000
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	-	1,300,000	-	-	1,300,000
MEITUAN DIANPING 4.625% S/A 02OCT2029 REGS	-	500,000	-	-	500,000
MELCO RESORTS FINANCE LTD 4.875% S/A 06JUN2025 REGS	-	3,280,000	-	-	3,280,000
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.75% S/A 01AUG2027	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.8% S/A 01AUG2029	-	2,100,000	-	(2,100,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.8% S/A 11JAN2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.85% S/A 11JAN2029	-	500,000	-	(500,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.875% S/A 31JUL2026	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 5% S/A 11JAN2034	-	300,000	-	(300,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.125% S/A 01AUG2034	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.63% Q 31JUL2026	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
METROPOLITAN BANK & TRUST CO 5.375% S/A 6MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
METROPOLITAN BANK & TRUST CO 5.5% S/A 6MAR2034	-	700,000	-	(700,000)	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 07MAY2036	-	700,000	-	(700,000)	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.4% S/A 07MAY2054	-	300,000	-	(300,000)	-
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	-	250,000	-	-	250,000
MICRON TECHNOLOGY INC 6.75% S/A 01NOV2029	-	200,000	-	(200,000)	-
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD 4.75% S/A 30JUL2025	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 1.375% S/A 07JUL2024	-	500,000	-	(500,000)	-
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.5% S/A 31UL2027	-	500,000	-	-	500,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	-	200,000	-	-	200,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	-	700,000	-	-	700,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	-	-	-	1,500,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.063% S/A 12SEP2025 (CALLED)	-	300,000	-	(300,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP CAYMAN 3 LTD 4.6% S/A 27MAR2024 REGS	2,836,000	-	-	(2,836,000)	-
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.579% S/A 26MAY2035	-	800,000	-	(800,000)	-
MORGAN STANLEY 0.79% S/A 30MAY2025 (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MORGAN STANLEY 5.972% S/A 07FEB2039	-	300,000	-	(300,000)	-
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	-	-	-	1,200,000
MTR CORP LTD 2.75% S/A 20SEP2034	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MTR CORP LTD 3.05% S/A 20SEP2054	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MUTHOOT FINANCE LTD 7.125% S/A 14FEB2028 REGS	-	350,000	-	(350,000)	-
NAN FUNG TREASURY LTD 3.625% S/A 27AUG2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% S/A 11SEP2034	-	1,000,000	-	(800,000)	200,000
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029 (CALLED)	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6% S/A 6AUG2034	-	250,000	-	-	250,000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD S+0.6% Q 26OCT2027	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
NATIONAL GRID GAS PLC 5.418% S/A 11JAN2034	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
NAVOI MINING & METALLURGICAL COMBINAT 6.7% S/A 17OCT2028 REGS	-	400,000	-	-	400,000
NEVADA POWER CO 5.625% S/A 01FEB2054	-	300,000	-	(300,000)	-
NEXTERA ENERGY CAPITAL HLDGS INC 6.051% S/A 01MAR2025	1,100,000	-	-	(1,100,000)	-
NIPPON LIFE INSURANCE CO 5.1% S/A 16OCT2044 REGS (CALLED)	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 5.3% S/A 13SEP2027 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 5.55% S/A 13SEP2029 REGS	-	600,000	-	(600,000)	-
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 6.95% S/A 15SEP2026 REGS	1,200,000	-	-	-	1,200,000
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP 7.05% S/A 15SEP2028 REGS	1,200,000	-	-	-	1,200,000
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.4% A 11DEC2034	-	6,000,000	-	-	6,000,000
NORDEA BANK ABP 6.3% S/A PERP	-	500,000	-	(500,000)	-
NORINCHUKIN BANK 5.094% S/A 16OCT2029 REGS	-	200,000	-	-	200,000
NOVARTIS CAPITAL CORP 3.8% S/A 18SEP2029	-	700,000	-	(700,000)	-
NOVARTIS CAPITAL CORP 4% S/A 18SEP2031	-	700,000	-	(700,000)	-
NOVARTIS CAPITAL CORP 4.2% S/A 18SEP2034	-	700,000	-	(700,000)	-
NOVARTIS CAPITAL CORP 4.7% S/A 18SEP2054	-	700,000	-	(700,000)	-
NTT FINANCE CORP 5.104% S/A 02JUL2027 REGS	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
NTT FINANCE CORP 5.11% S/A 02JUL2029 REGS	-	5,700,000	-	(5,700,000)	-
NTT FINANCE CORP 5.136% S/A 02JUL2031 REGS	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
NUTRIEN LTD 5.4% S/A 21JUN2034	-	240,000	-	(240,000)	-
NUVEEN LLC 5.85% S/A 15APR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5% S/A 01AUG2027	-	200,000	-	(200,000)	-
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.2% S/A 01AUG2029	-	200,000	-	(200,000)	-
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.375% S/A 01JAN2032	-	200,000	-	(200,000)	-
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.55% S/A 01OCT2034	-	200,000	-	(200,000)	-
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.05% S/A 01OCT2054	-	200,000	-	(200,000)	-
ONEOK INC 4.25% S/A 24SEP2027	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
ONEOK INC 4.75% S/A 15OCT2031	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ONEOK INC 5.05% S/A 01NOV2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	-	-	-	200,000
ORIX CORP 4.65% S/A 09OCT2029	-	400,000	-	(400,000)	-
OTIS WORLDWIDE CORP 5.125% S/A 19NOV2031	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	-	200,000	-	-	200,000
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 7.5% S/A 01MAR2031	-	300,000	-	(300,000)	-
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 7.875% S/A 01MAR2057	-	300,000	-	(300,000)	-
PANAMA GOVERNMENT INTL BOND 8% S/A 01MAR2038	-	300,000	-	(300,000)	-
PANASONIC HOLDINGS CORP 5.302% S/A 16JUL2032 REGS	-	600,000	-	(600,000)	-
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	-	5,580,000	-	-	5,580,000
PEPSICO INC 4.5% S/A 17JUL2029	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
PEPSICO INC 4.8% S/A 17JUL2034	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
PERENTI FINANCE PTY LTD 7.5% S/A 26APR2029	-	300,000	-	(300,000)	-
PHILIPPINE NATIONAL BANK 4.85% S/A 23OCT2029	-	800,000	-	(800,000)	-
PHILLIPS 66 CO 4.95% S/A 15MAR2035 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
PHILLIPS 66 CO 5.25% S/A 15JUN2031 REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP/PAA FINANCE CORP 5.7% S/A 15SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.812% S/A 21COT2032	-	3,000,000	-	(2,000,000)	1,000,000
POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 3.875% S/A 25MAR2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
POSCO 4.875% S/A 23JAN2027 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
PROLOGIS LP 3.25% S/A 11SEP2029	-	5,000,000	-	-	5,000,000
PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING 4.772% S/A 09DEC2029	-	400,000	-	-	400,000
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.25% S/A PERP	-	3,000,000	-	-	3,000,000
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.875% S/A PERP REGS	-	3,000,000	-	-	3,000,000
QIIB TIER 1 SUKUK LLC 5.45% S/A PERP	-	500,000	-	-	500,000
RANDE PROPERTY 6.65% S/A 01JUN2055	-	600,000	-	-	600,000
REC LTD 4.75% S/A 27SEP2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000
REPUBLIC OF BULGARIA 5% S/A 05MAR2037	-	150,000	-	-	150,000
ROCHE HLDGS INC 4.592% S/A 9SEP2034	-	700,000	-	(700,000)	-
ROCHE HLDGS INC 5.218% S/A 8MAR2054	-	300,000	-	(300,000)	-
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.5% S/A 15OCT2029	-	200,000	-	(200,000)	-
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.75% S/A 15FEB2032	-	200,000	-	(200,000)	-
ROPER TECHNOLOGIES INC 4.9% S/A 15OCT2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ROTHESAY LIFE PLC 7.019% S/A 10DEC2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ROYAL BANK OF CANADA 5.15% S/A 01FEB2034	-	250,000	-	(250,000)	-
ROYAL BANK OF CANADA 6.35% Q 24NOV2084	-	8,900,000	-	(7,900,000)	1,000,000
ROYAL BANK OF CANADA 7.5% Q 02MAY2084	-	200,000	-	(200,000)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.15% S/A 02SEP2029 REGS	-	362,500	-	(362,500)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.4% S/A 02SEP2034 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
ROYALTY PHARMA PLC 5.9% S/A 02SEP2054 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SANDS CHINA LTD 2.3% S/A 08MAR2027	-	2,000,000	-	-	2,000,000
SANDS CHINA LTD 2.85% S/A 08MAR2029	-	500,000	-	-	500,000
SANDS CHINA LTD 5.125% S/A 08AUG2025	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SANTANDER HLDGS USA INC 5.353% S/A 06SEP2030	-	200,000	-	(200,000)	-
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.7% A 11NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.75% A 12NOV2034	-	7,000,000	-	-	7,000,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 6.06% A 21NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
SAUDI ARABIAN OIL CO 4.25% S/A 02OCT2029 REGS	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
SAUDI ARABIAN OIL CO 4.75% S/A 02OCT2034 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 4.942% S/A 13FEB2029	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.194% S/A 13FEB2034	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5% S/A 16JAN2034 REGS	-	4,700,000	-	(4,700,000)	-
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.75% S/A 16JAN2054 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 6.8% S/A 05AUG2025	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SEKISUI HOUSE LTD 4.7% S/A 23FEB2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SEKISUI HOUSE LTD 5.1% S/A 23OCT2034	-	1,300,000	-	-	1,300,000
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTL CORP 2.693% S/A 27FEB2025	-	1,100,000	-	-	1,100,000
SEMPRA ENERGY 6.4% S/A 01OCT2054	-	300,000	-	(300,000)	-
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	-	500,000	-	-	500,000
SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 5% S/A 17JAN2029 (CALLED)	2,300,000	-	-	(2,300,000)	-
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	-	1,500,000	-	(500,000)	1,000,000
SHINHAN CARD CO LTD 2.5% S/A 27JAN2027	-	500,000	-	(500,000)	-
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
SHRIRAM FINANCE LTD 6.15% S/A 3APR2028 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 6.625% S/A 22APR2027 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	-	800,000	-	-	800,000
SK BATTERY AMERICA INC 4.875% S/A 23JAN2027	-	400,000	-	(400,000)	-
SK HYNIX INC 6.25% S/A 17JAN2026 REGS	-	520,000	-	-	520,000
SK HYNIX INC 6.375% S/A 17JAN2028 REGS	-	800,000	-	-	800,000

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 6.75% S/A PERP	-	3,000,000	-	(2,000,000)	1,000,000
SMFG PREFERRED 6.6% S/A PERP	-	500,000	-	(500,000)	-
SOAR WISE LTD 4.05% S/A 08OCT2024	-	1,700,000	-	-	1,700,000
SOCIETE GENERALE SA 5% S/A 17JAN2024 REGS	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 5.519% S/A 19JAN2028 REGS	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 7.132% S/A 19JAN2055 REGS	-	1,250,000	-	(1,250,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	-	3,000,000	-	-	3,000,000
SOCIETE GENERALE SA 8.125% S/A PERP	-	2,450,000	-	(1,500,000)	950,000
SOCIETE GENERALE SA 8.5% S/A PERP	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
SONOCO PRODUCTS CO 4.45% S/A 01SEP2046	-	700,000	-	(700,000)	-
SONOCO PRODUCTS CO 4.6% S/A 01SEP2029	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SONOCO PRODUCTS CO 4.9% S/A 01SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
SP GROUP TREASURY PTE LTD 4.625% S/A 21NOV2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ST MARYS CEMENT INC CANADA 5.75% S/A 02APR2034 REGS	-	200,000	-	(200,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 5.005% S/A 15OCT2030 REGS	-	2,600,000	-	(1,600,000)	1,000,000
STANDARD CHARTERED PLC 5.905% S/A 14MAR2035 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	-	300,000	-	-	300,000
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	-	350,000	-	-	350,000
STANDARD CHARTERED PLC L+1.51% Q PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
STATE BANK OF INDIA/LONDON 5% S/A 18JAN2024 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
STATE ELITE GLOBAL LTD S+1.03161% Q 24OCT2024	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
STRYKER CORP 4.85% S/A 08DEC2028	250,000	-	-	(250,000)	-
SUCI SECOND INVESTMENT CO 4.375% S/A 10SEP2027 REGS	-	1,200,000	-	(700,000)	500,000
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 5.875% S/A PERP REGS	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.109% S/A 23JAN2029	-	700,000	-	(700,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 4.436% S/A 02APR2024 REGS	200,000	-	-	(200,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.836% S/A 09JUL2044	-	450,000	-	-	450,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.45% S/A 10SEP2027	-	900,000	-	-	900,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.5% S/A 10SEP2029 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.85% S/A 10SEP2034 REGS	-	800,000	-	(800,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.35% S/A 7MAR2034	-	500,000	-	(500,000)	-
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	-	7,495,000	-	-	7,495,000
SUNTORY HLDGS LTD 5.124% S/A 11JUN2029	-	750,000	-	(750,000)	-
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SWEDBANK AB 5.625% S/A PERP (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.1% S/A 03SEP2027	-	3,500,000	-	(3,500,000)	-
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.4% S/A 03SEP2029	-	2,000,000	-	-	2,000,000
SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA 4.25% A PERP (CALLED)	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
SYNGENTA FINANCE NV 4.892% S/A 24APR2025 REGS	-	8,627,000	-	-	8,627,000
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.3% S/A 5JUL2034	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 05JUL2044	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.65% S/A 5JUL2054	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.8% S/A 5JUL2064	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
TARGET CORP 4.5% S/A 15SEP2034	-	500,000	-	(500,000)	-
TD SYNEX CORP 6.1% S/A 12APR2034	-	200,000	-	(200,000)	-
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.75% S/A 28AUG2034	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.1% S/A 28AUG2054	-	3,000,000	-	-	3,000,000
TENCENT HLDGS LTD 3.8% S/A 11FEB2025 REGS	-	5,184,000	-	(2,200,000)	2,984,000
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.6% S/A 08FEB2027	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 4.6% S/A 08FEB2029	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
TEXAS INSTRUMENTS INC 5.05% S/A 18MAY2063	-	400,000	-	(400,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
TEXAS INSTRUMENTS INC 5.15% S/A 08FEB2054	-	400,000	-	(400,000)	-
T-MOBILE USA INC 4.85% S/A 15JAN2029	-	200,000	-	(200,000)	-
T-MOBILE USA INC 5.15% S/A 15APR2034	-	250,000	-	(250,000)	-
T-MOBILE USA INC 5.5% S/A 15JAN2055	-	250,000	-	(250,000)	-
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 5.25% S/A PERP	-	442,000	-	-	442,000
TOWNGAS FINANCE LTD 4.75% S/A PERP (CALLED)	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
TPG OPERATING GROUP II LP 5.875% S/A 05MAR2034	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
TRUIST FINANCIAL CORP 5.435% S/A 24JAN2030	-	500,000	-	(500,000)	-
TRUIST FINANCIAL CORP 5.711% S/A 24JAN2035	-	600,000	-	(600,000)	-
TRUST FIBRA UNO 7.375% S/A 13FEB2034 REGS	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
TVF VARLIK KIRALAMA AS 6.95% S/A 23JAN2030	-	400,000	-	-	400,000
TYSON FOODS INC 5.4% S/A 15MAR2029	-	200,000	-	(200,000)	-
TYSON FOODS INC 5.7% S/A 15MAR2034	-	200,000	-	(200,000)	-
UBS GROUP AG 4.49% S/A 05AUG2025 REGS (CALLED)	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
UBS GROUP AG 5.699% S/A 08FEB2035 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
UBS GROUP AG 7% A PERP	-	1,000,000	-	-	1,000,000
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	-	400,000	-	-	400,000
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.85% S/A PERP	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	-	400,000	-	-	400,000
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 7% S/A PERP (CALLED)	800,000	-	-	(800,000)	-
UDR INC 5.125% S/A 15MAR2033	-	300,000	-	(300,000)	-
UNILEVER CAPITAL CORP 4.25% S/A 12AUG2027	-	300,000	-	(300,000)	-
UNILEVER CAPITAL CORP 4.625% S/A 12AUG2034	-	350,000	-	(350,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 29OCT2024	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
UNITEDHEALTH GROUP INC 5% S/A 15APR2034	-	600,000	-	(600,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 30NOV2026	-	1,000,000	-	-	1,000,000
VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.5% S/A 23FEB2054	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 2.85% S/A 28JUL2026	-	250,000	-	(250,000)	-
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 2.75% S/A 02JUN2025	-	1,734,000	-	-	1,734,000
VODAFONE GROUP PLC 5.75% S/A 28JUN2054	-	2,800,000	-	(2,800,000)	-
VODAFONE GROUP PLC 5.875% S/A 28JUN2064	-	2,100,000	-	(2,100,000)	-
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 3.125% S/A 12MAY2023 REGS	-	700,000	-	-	700,000
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 4.85% S/A 15AUG2027 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 4.9% S/A 14AUG2026 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	-	-	-	750,000
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC S+1.06% Q 14AUG2026	-	700,000	-	(700,000)	-
WEIBO CORP 3.375% S/A 08JUL2030	-	2,000,000	-	-	2,000,000
WEIBO CORP 3.5% S/A 05JUL2024	2,500,000	-	-	(2,500,000)	-
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.55% A 14NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 18NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.7% A 22NOV2034	-	5,000,000	-	-	5,000,000
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 2.349% S/A 29OCT2025	-	500,000	-	-	500,000
WESTPAC BANKING CORP 2.894% S/A 04FEB2030	-	6,190,000	-	-	6,190,000
WESTPAC BANKING CORP 4.6% S/A 20ICT2026	-	500,000	-	(500,000)	-
WESTPAC BANKING CORP 5.618% S/A 20NOV2035	-	900,000	-	(900,000)	-
WESTPAC BANKING CORP S+0.46% Q 20OCT2026	-	900,000	-	(900,000)	-
WHIRLPOOL CORP 5.75% S/A 01MAR2034	-	400,000	-	(400,000)	-
WILLIAMS COS INC 4.9% S/A 15MAR2029	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	-	-	-	300,000
WOORI BANK 1.03161% S/A 21MAY2024	500,000	-	-	(500,000)	-
WOORI BANK 6.375% S/A PERP REGS	-	400,000	-	(400,000)	-
WUHAN METRO GROUP CO LTD 1.58% S/A 03NOV2024	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资组合持有变动表 (未经审计) (续)

2024 年 12 月 31 日

	2024 年 1 月 1 日	增加	持有量的变动 红利/ 股息	处置	2024 年 12 月 31 日
WUHAN METRO GROUP CO LTD 4.45% S/A 22OCT2027	-	3,000,000	-	(2,000,000)	1,000,000
XIAOMI BEST TIME INTL LTD 2.875% S/A 14JUL2031 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
YUNDA HLDG INVESTMENT LTD 2.25% S/A 19AUG2025	-	3,500,000	-	-	3,500,000
ZHEJIANG BOXIN BVI LTD 5.9% S/A 11JUN2024	2,600,000	-	-	(2,600,000)	-
ZHEJIANG BOXIN BVI LTD 6.2% S/A 21APR2025	-	2,000,000	-	-	2,000,000
ZHENGZHOU URBAN CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 3.8% S/A 16JAN2025	-	1,500,000	-	-	1,500,000
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.125% S/A 16JUL2025	-	1,200,000	-	-	1,200,000
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	-	1,825,000	-	-	1,825,000
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 3% S/A 13JAN2026	-	500,000	-	(500,000)	-
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 5.98% S/A 30JAN2028	-	2,650,000	-	(650,000)	2,000,000
ZURICH FINANCE IRELAND II DAC 5.5% A 23APR2055	-	1,300,000	-	-	1,300,000
集合投资计划					
CHINAAMC ASIA ESG BOND FUND-CLASS I	-	477,588	-	-	477,588
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	1,371,407	2,332,494	-	(85,295)	3,618,605
CHINAAMC GLOBAL SELECTED INCOME FUND-I A USD	790,189	140,895	-	-	931,084
CHINAAMC SELECT ASIA BOND FUND-I ACC USD	-	1,218,560	-	-	1,218,560
CHINAAMC SELECT MONEY MARKET FUND-I HKD	1,041,451	-	-	(1,041,451)	-
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I RMB ACC	1,947,059	-	-	(1,947,059)	-
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	199,740	2,868,056	-	(16,959)	3,050,837
CNCB CAPITAL ASIAN INVESTMENT GRADE BOND FUND CLASS I USD ACC	-	50,000	-	-	50,000
	<u>83,781,846</u>	<u>870,765,093</u>	<u>-</u>	<u>529,593,265</u>	<u>424,953,674</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

金融衍生工具的详情 (未经审计)

于 2024 年 12 月 31 日, 本产品持有的金融衍生工具详情如下:

远期外汇合约

合约交付金额	汇兑金额	结算日	交易对手	公允价值 美元
<u>金融资产:</u>				
人民币 233,664,000	美元 32,000,000	12/02/2025	中国银行 (香港) 有限 公司	136,009
人民币 232,689,210	美元 32,000,000	12/05/2025	JPM Chase Bank	138,756
				<u>274,765</u>
<u>金融负债:</u>				
美元 32,000,000	人民币 227,838,336	12/02/2025	花旗银行	(930,442)
美元 102,158,366	人民币 741,853,621	31/03/2025	JPM Chase Bank	(827,609)
美元 32,000,000	人民币 226,534,400	12/05/2025	中国银行 (香港) 有限 公司	(981,729)
				<u>(2,739,780)</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

金融衍生工具产生的风险信息 (未经审计)

以下汇总了截至 2024 年 12 月 31 日止年度及截至 2023 年 12 月 31 日止年度因使用金融衍生工具而产生的总风险和净衍生风险。

总风险	最低	最高	平均
截至2024年12月31日止年度 -远期外汇合约	16.61%	49.28%	36.95%
截至2024年12月31日止年度 -远期外汇合约	9.45%	44.33%	24.88%
净衍生风险	最低	最高	平均
截至2024年12月31日止年度 - 远期外汇合约	16.37%	39.27%	32.93%
截至2023年12月31日止年度 - 远期外汇合约	9.45%	42.13%	24.37%

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未经审计)

基金份额持有人应占资产净值

	基金份额持有人 应占净资产	基金份额持有人 应占资产净值
2024 年 12 月 31 日		
- I 类 (港币)	港币 11.3961	美元 3,182,005
- I 类 (美元)	美元 12.2671	美元 199,108,109
- A 类 (美元)	美元 11.5057	美元 13,920,187
- A 类 (港币)	港币 11.4224	美元 6,817,227
- A 类 (人民币)	美元 12.1474	美元 8,533,777
- R 类 (美元)	美元 0.9417	美元 9,958,116
- R 类 (人民币)	人民币 1.2252	美元 134,800,964
- R 类 (人民币) (对冲)	人民币 1.0039	美元 100,658,290
- I 类 (美元派息)	美元 11.6588	美元 58,344,155
- C 类 (人民币)	人民币 10.0534	美元 1,370
- C 类 (人民币) (对冲)	人民币 10.0534	美元 1,370
- C 类 (美元)	美元 10.0080	美元 10,008
2023 年 12 月 31 日*		
- I 类 (港币)	港币 10.8935	美元 3,024,360
- I 类 (美元)	美元 11.6583	美元 37,198,207
- A 类 (美元)	美元 10.9689	美元 5,378,770
- A 类 (港币)	港币 10.9512	美元 6,418,662
- A 类 (人民币)	人民币 11.2375	美元 374,111
- R 类 (人民币)	人民币 1.1335	美元 7,851,173
- R 类 (人民币) (对冲)	人民币 0.9901	美元 43,704,144
- I 类 (美元派息)	美元 11.0809	美元 8,237,377
2022 年 12 月 31 日*		
- I 类 (港币)	港币 10.1561	美元 34,934,397
- I 类 (美元)	美元 10.8878	美元 2,824,579
- A 类 (美元)	美元 10.2622	美元 6,134,335
- A 类 (港币)	港币 10.2263	美元 7,279,506
- A 类 (人民币)	人民币 10.2212	美元 3,074
- R 类 (人民币) (对冲)	人民币 0.9526	美元 6,505,746
2021 年 12 月 31 日		
- I 类 (港币)	港币 10.6587	美元 2,964,160
- I 类 (美元)	美元 11.4254	美元 53,797,916
- A 类 (美元)	美元 10.7826	美元 15,622,002
- A 类 (港币)	港币 10.7485	美元 13,520,203
- A 类 (人民币)	人民币 9.8704	美元 1,554
- R 类 (美元)	美元 0.9856	美元 10,836,817
- R 类 (人民币) (对冲)	人民币 0.9934	美元 781,756

*2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日均非工作日，所有公布的每单位资产净值数据均为 2023 年 12 月 29 日和 2022 年 12 月 30 日数据。

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表(未经审计)(续)

每份额的最高发行和最低赎回价格

	每份额的 最高发行 价格	每份额的 最低赎回 价格
截至 2024 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 11.5037	港币 10.8762
- I 类(美元)	美元 12.3556	美元 11.6435
- A 类(美元)	美元 11.5992	美元 10.9544
- A 类(港币)	港币 11.5400	港币 10.9329
- A 类(人民币)	人民币 12.1474	人民币 11.2678
- R 类(美元)	美元 0.9457	美元 0.9393
- R 类(人民币)	人民币 1.2252	人民币 1.1366
- R 类(人民币)(对冲)	人民币 1.0241	人民币 0.9870
- I 类(美元派息)	美元 11.7434	美元 11.0669
- C 类(人民币)	人民币 10.0534	人民币 9.9904
- C 类(人民币)(对冲)	人民币 10.0534	人民币 9.9904
- C 类(美元)	美元 10.0080	美元 9.9981
截至 2023 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 10.8972	港币 10.1823
- I 类(美元)	美元 11.6591	美元 10.8917
- A 类(美元)	美元 10.9699	美元 10.2658
- A 类(港币)	港币 10.9553	港币 10.2527
- A 类(人民币)	人民币 11.3486	人民币 10.0240
- R 类(人民币)	人民币 1.1447	人民币 1.0184
- R 类(人民币)(对冲)	人民币 0.9907	人民币 0.9529
- I 类(美元派息)	美元 11.0817	美元 10.7616
截至 2022 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 10.6607	港币 10.0145
- I 类(美元)	美元 11.4286	美元 10.6637
- A 类(美元)	美元 10.7852	美元 10.0508
- A 类(港币)	港币 10.7502	港币 10.0856
- A 类(人民币)	人民币 10.7177	人民币 9.5746
- R 类(人民币)(对冲)	人民币 0.9944	人民币 0.9363
截至 2021 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 10.8334	港币 10.4553
- I 类(美元)	美元 11.6339	美元 11.2183
- A 类(美元)	美元 10.9927	美元 10.5932
- A 类(港币)	港币 10.9395	港币 10.5495
- A 类(人民币)	人民币 10.2688	人民币 9.7483
- I 类(美元派息)	美元 10.7771	美元 10.7616
- R 类(美元)	美元 1.0048	美元 0.9683
- R 类(人民币)(对冲)	人民币 1.0000	人民币 0.9721
截至 2020 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 10.6071	港币 10.5553
- I 类(美元)	美元 11.4111	美元 10.3474
- A 类(美元)	美元 10.8126	美元 9.8351
- A 类(港币)	港币 10.7171	港币 9.7517
- I 类(美元派息)	美元 10.7733	美元 9.7690

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

投资表现报表 (未经审计) (续)

每份额的最高发行和最低赎回价格 (续)

	每份额的 最高发行 价格		每份额的 最低赎回 价格	
截至 2019 年 12 月 31 日止年度				
- I 类 (港币)	港币	10.6213	港币	10.0892
- I 类 (美元)	美元	10.6506	美元	10.1111
- A 类 (美元)	美元	10.1357	美元	9.9875
- A 类 (港币)	港币	10.1447	港币	10.0000
- I 类 (美元派息)	美元	10.0953	美元	10.0000
自 2018 年 8 月 28 日 (成立日) 至 2018 年 12 月 31 日止的期间				
- I 类 (港币)	港币	10.0840	港币	9.9521
- I 类 (美元)	美元	10.1075	美元	9.9533

¹ 所示本基金的过往业绩并不预示其未来业绩。