

华夏精选基金

华夏精选固定收益配置基金

2025年度报告

截至 2025 年 12 月 31 日止年度



华夏基金
ChinaAMC

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 2025 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 - 11
现金流量表	12
财务报表附注	13 - 46
投资组合列表 (未经审计)	47 - 67
投资组合持有变动表 (未经审计)	68 - 113
金融衍生工具的详情 (未经审计)	114
金融衍生工具产生的风险信息 (未经审计)	115
投资表现报表 (未经审计)	116 - 118

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

中国内地托管人

中国银行股份有限公司
中国 北京 复兴门内大街 1 号

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

2025 年，全球宏观经济环境在所谓“分裂式繁荣”中发展。一方面，人工智能领域的技术突破产生了强劲的增长动力，并在某些资产价格上营造出繁荣的表象。另一方面，贸易摩擦加剧、债务风险上升以及政策不确定性加剧，严重侵蚀了美国及许多其他国家的经济基本面。年初，人工智能领域的“DeepSeek 时刻”以及美国总统特朗普于 4 月 2 日宣布的超出预期的对等关税政策，给风险资产价格带来压力，并加剧了去美元化的需求。随后，随着美国与多个国家达成贸易协定，且主要科技公司加速发布及投资人工智能模型，风险资产在随后的六个月内迅速回升。

在固定收益市场中，大多数发达经济体的政府债券收益率曲线走陡，其中美国国债在发达市场中表现相对强劲。在其他资产类别中，美元显著走弱，而黄金等贵金属在 2025 年因对货币可信度的担忧上涨超过 60%。除原油外，大多数大宗商品表现亦佳。

在债券市场中，票息收入仍是回报的主要来源。截至 2025 年 12 月 19 日，彭博全球综合指数（未对冲）上涨 7.66%，绝大多数子板块的全年回报率超过 6%。在所有子行业中，全球信用债券连续第三年表现优于政府债券。美国高收益债券与投资级债券录得相似回报，而新兴市场表现优于发达市场。中国发行的投资级美元（USD）债券在当年前 11 个月中，每月均实现了正收益。此外，中期债券的表现最为强劲。

基于我们的市场展望，我们认为投资组合定位应侧重于整体久期管理以及资产类别的识别与多元化。

一方面，当前的信用利差为提升收益提供的潜在空间有限。从信用迁移中产生超额收益的概率和回报相对较低。因此，在 2026 年，更加积极主动且纪律严明的主动管理框架将日益重要，其中久期管理将成为投资组合表现的关键驱动因素。

另一方面，我们建议继续在不同行业和地区之间进行多元化配置。与此同时，随着中国发行的美元债券供应减少以及传统信用债券估值上升，可能会出现具有吸引力的战术配置价值和投资机会，具体如下：

1. 离岸人民币债券：政策举措、市场规模扩大、在岸与离岸估值差异，以及与发达市场债券的低相关性。
2. 抵押贷款支持证券（MBS）：信用风险极低，相较于信用债券具有极具吸引力的相对估值，且票息收入相对较高。
3. 中国发行的可转换债券：补充萎缩的中国发行高收益美元债市场，并提供额外的回报潜力。
4. 以澳元等货币计价的债券：一级与二级市场价格利差有利，互换后收益率较高，且去美元化进程中存在机遇。

综上所述，我们旨在通过扎实的信用风险控制、积极的久期管理及多元化的资产配置，实现长期稳定的投资回报。

华夏基金（香港）有限公司
2026 年 4 月 27 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 2025 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

2026 年 4 月 27 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

我们已审计列载于第 7 至 46 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 2025 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 2025 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
2026 年 4 月 27 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 2025 年 12 月 31 日止年度

	附注	2025 美元	2024 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			
		69,984,643	7,301,185
银行存款利息收入		101,957	8,985
其他收入		19,681	15,420
		<u>70,106,281</u>	<u>7,325,590</u>
费用			
管理费	3(a)	(12,805,932)	(1,230,386)
受托人费用	3(b)	(1,794,782)	(250,225)
保管费用及银行费用	3(c)	(525,085)	(83,842)
审计师酬金		(20,460)	(14,537)
法律和专业服务费		(20,862)	(17,744)
交易手续费	3(d)	(29,610)	(20,595)
交易费用		-	(153,483)
其他费用		(99,931)	(59,606)
		<u>(15,296,662)</u>	<u>(1,830,418)</u>
减：由基金管理人承担的报销费用	3(h)	938,697	240,790
		<u>(14,357,965)</u>	<u>(1,589,628)</u>
财务费用			
向份额持有人分派			
-I 类派息 (美元)	11	(766,652)	-
-A 类派息 (美元)	11	(260)	-
-A 类派息 (港币)	11	(33)	-
-A 类派息 (人民币)	11	(43)	-
-A 类派息 (人民币) (对冲)	11	(22)	-
		<u>(767,010)</u>	<u>-</u>
投资收益/ (损失) 及汇兑差额前利润		<u>54,981,306</u>	<u>5,735,962</u>
投资收益/ (损失) 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收益/ (损失)			
		59,266,528	(3,939,663)
汇兑差额		(3,561,177)	(184,762)
投资收益/ (损失) 净额及汇兑差额		<u>55,705,351</u>	<u>(4,124,425)</u>
税前收益		<u>110,686,657</u>	<u>1,611,537</u>
预扣税	5	(25,064)	-
基金份额持有人应占资产净值增加		<u>110,661,593</u>	<u>1,611,537</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

2025年12月31日

	附注	2025 美元	2024 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	1,818,734,630	512,286,240
应收利息		20,212,752	4,883,286
应收认购款		53,039,281	711,704
应收基金管理人款项	3(h)	233,642	207,755
应收经纪人款项	9	2,025,467	-
定期存款	8	10,563	-
现金及现金等价物	8	45,174,495	21,097,829
资产总额		<u>1,939,430,830</u>	<u>539,186,814</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	459,973	2,739,780
应付管理费	3(a)	3,330,413	610,857
应付受托人费用	3(b)	168,755	51,721
应计费用和其他应付款		23,861	35,473
应付赎回款项		66,106,376	408,344
应付经纪人款项	9	-	4,688
应付税费		-	373
总负债 (不含基金份额持有人应占资产净值)		<u>70,089,378</u>	<u>3,851,236</u>
基金份额持有人应占资产净值	10	<u>1,869,341,452</u>	<u>535,335,578</u>
负债总额		<u>1,939,430,830</u>	<u>539,186,814</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 2025 年 12 月 31 日止年度

	基金份额数目	美元
2024 年 1 月 1 日	<u>375,066,287.30</u>	<u>112,186,805</u>
认购的基金份额		
– A 类 (美元)	1,266,722.86	14,516,630
– A 类 (人民币)	11,182,401.95	18,242,916
– A 类 (港币)	5,823,979.27	8,427,389
– C 类 (美元)	1,000.00	10,000
– C 类 (人民币)	1,000.00	1,368
– C 类 (人民币) (对冲)	1,000.00	1,368
– I 类 (美元)	13,084,662.88	160,270,000
– I 类派息 (美元)	4,260,919.46	50,000,000
– R 类 (美元)	10,572,214.00	9,999,200
– R 类 (人民币)	767,222,537.00	127,928,161
– R 类 (人民币) (对冲)	<u>514,996,453.67</u>	<u>72,288,264</u>
	1,328,412,891.09	461,685,296
赎回的基金份额		
– A 类 (美元)	(547,058.80)	(6,210,705)
– A 类 (人民币)	(6,264,473.07)	(10,367,080)
– A 类 (港币)	(5,766,835.73)	(8,356,812)
– I 类 (美元)	(44,300.76)	(533,262)
– R 类 (人民币)	(9,217,023.25)	(1,542,281)
– R 类 (人民币) (对冲)	<u>(93,586,705.76)</u>	<u>(13,137,920)</u>
	(115,426,397.37)	(40,148,060)
基金份额持有人应占资产净值增加	<u>-</u>	<u>1,611,537</u>
2024 年 12 月 31 日	<u><u>1,588,052,781.03</u></u>	<u><u>535,335,578</u></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(续)

截至 2025 年 12 月 31 日止年度

	基金份额数目	美元
2025 年 1 月 1 日	1,588,052,781.03	535,335,578
认购的基金份额		
– A 类(美元)	1,496,617.09	17,791,648
– A 类派息(美元)	1,992.89	20,000
– A 类(人民币)	3,928,177.19	6,583,354
– A 类派息(人民币)	3,985.27	5,575
– A 类派息(人民币)(对冲)	1,998.15	2,743
– A 类(港币)	21,258,769.71	32,318,329
– A 类派息(港币)	1,994.42	2,570
– C 类(美元)	15,731,239.27	159,500,000
– I 类(美元)	28,825,752.15	353,698,432
– I 类派息(美元)	515,978.12	6,000,000
– I 类(人民币)	8,037,479.06	11,201,714
– I 类(港币)	959,014.01	1,463,273
– R 类(美元)	27,124,278.21	26,186,400
– R 类(人民币)	7,756,607,874.98	1,299,425,984
– R 类(人民币)(对冲)	3,726,741,846.89	531,707,445
	11,591,236,997.41	2,445,907,467
赎回的基金份额		
– A 类(美元)	(702,194.03)	(8,268,622)
– A 类(人民币)	(5,574,346.21)	(9,430,095)
– A 类派息(人民币)	(1,982.13)	(2,829)
– A 类(港币)	(10,078,892.45)	(15,322,250)
– C 类(美元)	(8,356,149.10)	(85,854,647)
– C 类(人民币)	(1,000.00)	(1,376)
– C 类(人民币)(对冲)	(1,000.00)	(1,376)
– I 类(美元)	(26,304,722.37)	(323,572,214)
– I 类派息(美元)	(516,022.50)	(6,000,000)
– I 类(人民币)	(4,976,090.55)	(6,951,655)
– R 类(美元)	(5,172,143.18)	(5,048,529)
– R 类(人民币)	(3,509,084,298.94)	(602,203,997)
– R 类(人民币)(对冲)	(1,128,670,499.26)	(159,905,596)
	(4,699,439,340.72)	(1,222,563,186)
基金份额持有人应占资产净值增加	-	110,661,593
2025 年 12 月 31 日	8,479,850,437.72	1,869,341,452

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 2025 年 12 月 31 日止年度

	2025	2024
已发行基金份额数目		
-A 类(美元)	2,004,452.96	1,210,029.90
-A 类派息(美元)	1,992.89	不适用 ¹
-A 类(人民币)	3,508,840.63	5,155,009.65
-A 类派息(人民币)	2,003.14	不适用 ¹
-A 类派息(人民币)(对冲)	1,998.15	不适用 ¹
-A 类(港币)	15,814,731.33	4,634,854.07
-A 类派息(港币)	1,994.42	不适用 ¹
-C 类(美元)	7,376,090.17	1,000.00
-C 类(人民币)	-	1,000.00
-C 类(人民币)(对冲)	-	1,000.00
-I 类(美元)	18,752,106.09	16,231,076.31
-I 类派息(美元)	5,004,258.96	5,004,303.34
-I 类(人民币)	3,061,388.51	不适用 ¹
-I 类(港币)	3,127,372.94	2,168,358.93
-R 类(美元)	32,524,349.03	10,572,214.00
-R 类(人民币)	5,054,855,068.12	807,331,492.08
-R 类(人民币)(对冲)	3,333,813,790.38	735,742,442.75
	<u>8,479,850,437.72</u>	<u>1,588,052,781.03</u>
份额净值		
-A 类(美元)	美元 12.1544	美元 11.5057
-A 类派息(美元)	美元 10.3914	不适用 ¹
-A 类(人民币)	人民币 12.2112	人民币 12.1474
-A 类派息(人民币)	人民币 9.9763	不适用 ¹
-A 类派息(人民币)(对冲)	人民币 9.9762	不适用 ¹
-A 类(港币)	港币 12.0928	港币 11.4224
-A 类派息(港币)	港币 10.3825	不适用 ¹
-C 类(美元)	美元 10.6390	美元 10.0080
-C 类(人民币)	-	人民币 10.0534
-C 类(人民币)(对冲)	-	人民币 10.0534
-I 类(美元)	美元 13.0157	美元 12.2671
-I 类派息(美元)	美元 12.2129	美元 11.6588
-I 类(人民币)	人民币 10.2367	人民币 11.3961
-I 类(港币)	港币 12.1133	不适用 ¹
-R 类(美元)	美元 0.9948	美元 0.9417
-R 类(人民币)	人民币 1.2322	人民币 1.2252
-R 类(人民币)(对冲)	人民币 1.0406	人民币 1.0039

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 2025 年 12 月 31 日止年度

	附注	2025 美元	2024 美元
经营活动产生的现金流量			
税前利润		110,686,657	1,611,537
调整项:			
银行存款利息收入		(70,086,600)	(7,310,170)
向份额持有人分派		767,010	-
		<u>41,367,067</u>	<u>(5,698,633)</u>
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产增加		(1,306,448,390)	(402,483,447)
定期存款增加		(10,563)	-
预付款项减少		-	1,704
应收基金管理人款项增加		(25,887)	(83,475)
应收经纪人款项增加		(2,025,467)	-
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 (减少)/增加		(2,279,807)	2,662,438
应付管理费增加		2,719,556	431,940
应付受托人费用增加		117,034	38,795
应计费用和其他应付款(减少)/增加		(11,612)	4,886
应付经纪人款项(减少)/增加		(4,688)	4,688
经营活动使用的现金流量		<u>(1,266,602,757)</u>	<u>(405,121,104)</u>
已收利息		54,757,134	3,432,621
已付税款		(25,437)	-
经营活动使用的现金流量净额		<u>(1,211,871,060)</u>	<u>(401,688,483)</u>
筹资活动产生的现金流量			
认购基金份额的收益		2,393,579,890	461,173,482
赎回基金份额支付的款项		(1,156,865,154)	(39,849,537)
向份额持有人分派		(767,010)	-
筹资活动产生的现金流量净额		<u>1,235,947,726</u>	<u>421,323,945</u>
现金及现金等价物增加净额		<u>24,076,666</u>	<u>19,635,462</u>
年初现金及现金等价物		<u>21,097,829</u>	<u>1,462,367</u>
年末现金及现金等价物		<u>45,174,495</u>	<u>21,097,829</u>
现金及现金等价物余额分析			
银行存款	8	45,174,495	21,087,829
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	8	-	10,000
		<u>45,174,495</u>	<u>21,097,829</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2025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2025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
华夏精选离岸人民币收益债券基金	2025年9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。

2025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。

缺乏可兑换性——对《国际会计准则第21号》的修订

对于自2025年1月1日或之后开始的年度报告期间,《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。

该等修订对本子基金的财务报表并无产生重大影响。

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2025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:

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。

2025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 (续)

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。

金融工具分类和计量准则的修订——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、社会和治理及其他类似特征的金融资产的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。

国际财务报告准则会计准则年度改进——第11卷

2024年7月，国际会计准则理事会发布了九项窄范围修订，作为其定期维护工作的一部分。国际财务报告准则。该等修订包括澄清、简化、更正或变更，旨在提升《国际财务报告准则第1号——首次采用国际财务报告准则》(IFRS 1)、《国际财务报告准则第7号——金融工具：披露》及其配套《实施国际财务报告准则第7号指南》、《国际财务报告准则第9号——金融工具》、《国际财务报告准则第10号——合并财务报表》以及《国际会计准则第7号——现金流量表》的一致性。

该修订将于2026年1月1日或之后开始的报告期间生效。此前允许申请，但必须予以披露。

预计该等修订不会对子基金的财务报表产生重大影响。

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商业模式及
- 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、应收基金管理人款项以及应收经纪人款项)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。

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。

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以抵销, 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。

2025年12月31日

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。

2025年12月31日

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。

2025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。

2025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2025年12月31日止年度所产生的管理费为12,805,932美元（2024年：1,230,386美元）。截至2025年12月31日，应付基金管理人的管理费为3,330,413美元（2024年：美元）。

2025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 2025 年 12 月 31 日止年度所产生的受托人费用为 1,794,782 美元 (2024 年: 250,225 美元)。截至 2025 年 12 月 31 日, 应付受托人的受托人费用为 168,755 美元 (2024 年: 51,721 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 2025 年 12 月 31 日止年度所产生的保管费为 510,195 美元 (2024 年: 77,713 美元)。截至 2025 年 12 月 31 日, 并无应付保管人的保管费 (2024 年: 无)。

截至 2025 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 14,890 美元 (2024 年: 6,129 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 2025 年 12 月 31 日止年度的交易手续费为 29,610 美元 (2024 年: 20,595 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 (2024 年: 660 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, 45,174,330 美元 (2023 年: 21,087,664 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 2025 年 12 月 31 日止的期间内, 利息收入达 37,610 美元 (2024 年: 8,196 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

2025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 %
2025				
中信证券经纪(香港)有限公司	43,616,194	-	0.70%	-
中信银行(国际)有限公司	79,294,369	-	1.28%	-
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%	-

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 %
2025				
中国银行(香港)有限公司	15,442,497	-	0.25%	-
中银国际英国保诚信托有限公司	1,047,474,210	-	16.93%	-
中银国际证券有限公司	279,583	-	0.01%	-
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%	-

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

2025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) 本基金的基金份额持有情况

本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。截至2025年12月31日及2024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：

2025年12月31日

	2025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	2025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类派息(美元)基金份额	5,004,303	515,978	(516,022)	5,004,259
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	735,742,443	3,726,741,847	(1,128,670,499)	3,333,813,791
R类(人民币)基金份额	807,331,492	7,756,607,875	(3,509,084,299)	5,054,855,068
R类(美元)基金份额	10,572,214	27,124,278	(5,172,143)	32,524,349
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	-	(813,505)	8,168,132
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	574,119	(1,309,011)	-
由 Security Nominees Limited 持有的				
A类(美元)基金份额	2,072	2,459	(1,234)	3,297
A类(港币)基金份额	8,911	21,645	(14,163)	16,393
A类(人民币)基金份额	98,196	-	(33,000)	65,196
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)	-
A类派息(港币)基金份额	-	1,994	-	1,994
A类派息(美元)基金份额	-	1,993	-	1,993
A类派息(人民币)基金份额	-	1,998	-	1,998
A类派息(人民币)(对冲)基金份额	-	1,998	-	1,998

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

2025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)

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类派息(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

2025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)

(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2025年12月31日和2024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:

	2025 USD	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	96,431,281	42,467,952
华夏精选亚洲债券基金	59,409,967	10,965,454
华夏精选人民币投资级别收益基金	175,302,331	33,106,154
华夏精选离岸人民币收益债券基金	4,540,905	-
华夏全球精选收益基金	13,447,484	10,653,464

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2025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(2024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938,697美元(2024年: 240,790美元)。截至2025年12月31日, 应收基金管理人的管理费回佣为233,642美元(2024年: 207,755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	2025 美元	2024 美元
投资			
中国银行(香港)有限公司	6	1,466,649,719	404,591,241
中银国际英国保诚信托有限公司	6	349,131,968	107,420,234

(j) 与基金管理人管理的基金及授权之间的交易

截至2025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634,500,00美元及412,974,210美元(2024年: 72,099,976美元及5,418,274美元)。

4. 软佣金安排

在截至2025年12月31日止年度及截至2024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。

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

2025年12月31日

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。

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 2025 年 12 月 31 日止年度，未就证券所得收入计提中国内地税费（2024 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”）。截至 2025 年 12 月 31 日止年度，本子基金并无应缴分配税为（2024 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	2025 美元	2024 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		1,466,649,719	404,591,241
- 集合投资计划		349,131,968	107,420,234
- 远期外汇合约	7	<u>2,952,943</u>	<u>274,765</u>
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>1,818,734,630</u>	<u>512,286,240</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	<u>459,973</u>	<u>2,739,780</u>
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>459,973</u>	<u>2,739,780</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。

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

2025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)

本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。

如果无法观察一项完全相同的资产或负债的价格，则本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对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
2025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	-	1,466,649,719	-	1,466,649,719
-集合投资计划	-	349,131,968	-	349,131,968
-远期外汇合约	-	2,952,943	-	2,952,943
	-	<u>1,818,734,630</u>	-	<u>1,818,734,630</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	-	(459,973)	-	(459,973)
	-	<u>(459,973)</u>	-	<u>(459,973)</u>

华夏精选固定收益配置基金
（华夏精选基金的子基金）

财务报表附注

2025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
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
	<u>-</u>	<u>512,286,240</u>	<u>-</u>	<u>512,286,240</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	-	(2,739,780)	-	(2,739,780)
	<u>-</u>	<u>(2,739,780)</u>	<u>-</u>	<u>(2,739,780)</u>

截至2025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2025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（2024年：无）。

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

2025年12月31日

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2025年12月31日及2024年12月31日尚未结算的衍生工具合约如下

2025年12月31日

	<u>名义金额</u>		<u>空头敞口</u>	<u>公允价值</u>	
	<u>多头敞口</u>			<u>资产</u>	<u>负债</u>
				<u>美元</u>	<u>美元</u>
美元	1,155,343	欧元	1,000,000	-	(20,139)
美元	581,540	欧元	500,000	-	(6,315)
美元	4,544,999	人民币	32,000,000	-	(49,302)
美元	114,082	人民币	800,000	-	(1,008)
美元	37,927,385	人民币	266,000,000	-	(340,036)
美元	2,161,033	欧元	1,838,000	-	(4,721)
美元	1,434,149	澳元	2,170,000	-	(15,242)
美元	7,146,502	人民币	50,000,000	-	(23,210)
人民币	3,102,663,530	美元	443,787,756	2,952,934	-
人民币	10,000	美元	1,430	9	-

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

2025年12月31日

7. 衍生金融工具 (续)

远期外汇合约 (续)

2024年12月31日

	名义金额		空头敞口	公允价值	
	多头敞口			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)

8. 现金及现金等价物

	2025 美元	2024 美元
银行存款	45,174,495	21,087,829
定期存款	10,563	10,000
小计	45,185,058	21,097,829
减: 原始期限超过三个月的定期存款	(10,563)	-
	45,174,495	21,097,829

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。

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

2025年12月31日

9. 应收/应付经纪人款项

截至2025年12月31日，本子基金存在应收经纪人款项指针对截至报告日期已签约但尚未交割的证券应收款项及存放于经纪人的现金（2024年：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）。

	附注	2025 美元	2024 美元
<i>应收经纪人款项</i>			
- 保证金		2,023,973	-
- 已售出但尚未交割证券的应收款项		1,494	-
		<u>2,025,467</u>	<u>-</u>
<i>应付经纪人款项</i>			
- 已购买但尚未交割证券的应付款项		-	4,688
		<u>-</u>	<u>4,688</u>

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。

资本管理

本子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，以满足本子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：

	2025 美元	2024 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）	1,869,947,790	520,040,553
未结算资本交易的调整	<u>(606,338)</u>	<u>15,295,025</u>
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）	<u>1,869,341,452</u>	<u>535,335,578</u>

华夏精选固定收益配置基金
(华夏精选基金的子基金)

财务报表附注

2025年12月31日

10. 基金份额持有人应占资产净值 (续)

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)	2025	2024
A类(美元)	美元 12.1544	美元 11.5057
A类派息(美元)	美元 10.3914	不适用 ¹
A类(人民币)	人民币 12.2112	人民币 12.1474
A类派息(人民币)	人民币 9.9763	不适用 ¹
A类派息(人民币)(对冲)	人民币 9.9762	不适用 ¹
A类(港币)	港币 12.0928	港币 11.4224
A类派息(港币)	港币 10.3825	不适用 ¹
C类(美元)	美元 10.6390	美元 10.0080
C类(人民币)	-	人民币 10.0534
C类(人民币)(对冲)	-	人民币 10.0534
I类(美元)	美元 13.0157	美元 12.2671
I类派息(美元)	美元 12.2129	美元 11.6588
I类(人民币)	人民币 10.2367	不适用 ¹
I类(港币)	港币 12.1133	港币 11.3961
R类(美元)	美元 0.9948	美元 0.9417
R类(人民币)	人民币 1.2322	人民币 1.2252
R类(人民币)(对冲)	人民币 1.0406	人民币 1.0039
(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)	2025	2024
A类(美元)	美元 12.1544	美元 11.5057
A类派息(美元)	美元 10.3914	不适用 ¹
A类(人民币)	人民币 12.2112	人民币 12.1474
A类派息(人民币)	人民币 9.9763	不适用 ¹
A类派息(人民币)(对冲)	人民币 9.9762	不适用 ¹
A类(港币)	港币 12.0928	港币 11.4224
A类派息(港币)	港币 10.3825	不适用 ¹
C类(美元)	美元 10.6390	美元 10.0080
C类(人民币)	-	人民币 10.0534
C类(人民币)(对冲)	-	人民币 10.0534
I类(美元)	美元 13.0157	美元 12.2671
I类派息(美元)	美元 12.2129	美元 11.6588
I类(人民币)	人民币 10.2367	不适用 ¹
I类(港币)	港币 12.1133	港币 11.3961
R类(美元)	美元 0.9948	美元 0.9417
R类(人民币)	人民币 1.2322	人民币 1.2252
R类(人民币)(对冲)	人民币 1.0406	人民币 1.0039

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)

财务报表附注

2025年12月31日

11. 向份额持有人的派息

	美元
于 2025 年 1 月 1 日的未分配收益	-
份额持有人应占资产净值增加	110,661,593
加：财务费用—向份额持有人的收益分配	767,010
分配前收益	<u>111,428,603</u>
于 2025 年 10 月 31 日支付以下收益分配（于 2025 年 10 月 17 日宣告）	
每单位 A 类派息（人民币）支付 0.0255 人民币	(14)
每单位 A 类派息（人民币）（对冲）支付 0.0255 人民币	(7)
每单位 A 类派息（港币）支付 0.0435 港币	(11)
每单位 I 类派息（美元）支付 0.0512 美元	(256,219)
每单位 A 类派息（美元）支付 0.0436 美元	(87)
于 2025 年 11 月 28 日支付以下收益分配（于 2025 年 11 月 17 日宣告）	
每单位 A 类派息（人民币）支付 0.0254 人民币	(14)
每单位 A 类派息（人民币）（对冲）支付 0.0254 人民币	(7)
每单位 A 类派息（港币）支付 0.0434 港币	(11)
每单位 I 类派息（美元）支付 0.0510 美元	(255,218)
每单位 A 类派息（美元）支付 0.0434 美元	(86)
于 2025 年 12 月 31 日支付以下收益分配（于 2025 年 12 月 16 日宣告）	
每单位 A 类派息（人民币）支付 0.0251 人民币	(14)
每单位 A 类派息（人民币）（对冲）支付 0.0251 人民币	(7)
每单位 A 类派息（港币）支付 0.0433 港币	(11)
每单位 I 类派息（美元）支付 0.0510 美元	(255,218)
每单位 A 类派息（美元）支付 0.0434 美元	(86)
转入资本	<u>(110,661,593)</u>
于 2025 年 12 月 31 日的非分配收入	<u>-</u>

基金管理人可全权酌情在每个财政年度确定其认为适当的时间或时间向单位持有人分配收益，或决定在任何财政年度不进行分配。拟向单位持有人分配的金额（如有）将源自子基金的资本/总收入。

截至 2025 年 12 月 31 日止年度已宣布及支付股息总额为 767,010 美元。2024 年 12 月 31 日止年度无已宣布及支付的派息。

2025年12月31日

12. 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2025年12月31日和2024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

2025年12月31日

12. 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
2025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	349,131,968	19	1 (1)	3,491,320 (3,491,320)
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)

(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。

2025年12月31日

12. 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 2025 年 12 月 31 日至 2024 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
2025		
债券	25	(9,889,437)
债券	(25)	9,889,437
2024		
债券	25	(2,822,435)
债券	(25)	2,822,435

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 2025 年 12 月 31 日至 2024 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。

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

2025年12月31日

12. 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 2025 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					
入当期损益的金融资产	-	1,818,734,630	-	-	1,818,734,630
应收利息	-	8,554,110	6,051,467	5,607,175	20,212,752
应收认购款	-	53,039,281	-	-	53,039,281
应收基金管理人款项	-	-	233,642	-	233,642
应收经纪人款项	2,025,467	-	-	-	2,025,467
定期存款	-	-	10,563	-	10,563
现金及现金等价物	45,174,495	-	-	-	45,174,495
金融资产合计	47,199,962	1,880,328,021	6,295,672	5,607,175	1,939,430,830
<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					
入当期损益的金融负债	459,973	-	-	-	459,973
应付管理费	-	3,330,413	-	-	3,330,413
应付受托人费用	-	168,755	-	-	168,755
其他应付款	-	23,861	-	-	23,861
应付赎回	-	66,106,376	-	-	66,106,376
应占资产净值*	1,869,341,452	-	-	-	1,869,341,452
金融负债合计	1,869,801,425	66,629,405	-	-	1,939,430,830

* 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

2025年12月31日

12. 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	21,097,829	514,723,046	1,796,563	1,569,376	539,186,814
<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	535,335,578	3,819,050	-	31,813	539,186,441

* 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。

2025年12月31日

12. 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，定期存款，应收经纪人款项、应收基金管理人的款项，应收认购款及应收利息。截至 2025 年 12 月 31 日，现金及现金等价物，定期存款，应收经纪人款项、应收基金管理人的款项，应收认购款及应收利息共计 120,969,200 美元，且并未计提任何损失准备（2024 年：共计 26,900,574 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著增加。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。

2025年12月31日

12. 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：

2025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	45,174,330	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	10,563	BBB-	标准普尔
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

¹ 评级代表平安银行股份有限公司的评级。
² 评级代表中国渤海银行股份有限公司的评级。

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级别。

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

2025年12月31日

12. 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：

<u>2025年12月31日</u>	美元	信用评级	信用评级来源
<u>保管人</u>			
中国银行(香港)有限公司	1,469,602,662	A+	标准普尔
<u>2024年12月31日</u>			
<u>保管人</u>			
中国银行(香港)有限公司	407,727,250	A+	标准普尔
JPM Chase Bank ¹	138,756	A	标准普尔

¹评级代表 JPMorgan Chase & Co.的评级

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。

抵销及受主净额结算安排和类似协议约束的金额

该子基金按总额列示其衍生资产和负债的公允价值，且此类资产或负债未在财务状况表中抵销。若干衍生金融工具受具有强制执行力的主净额结算安排约束。相关安排允许在发生违约事件后进行抵销，但不在正常业务过程中进行抵销；本子基金无意以净额基础结算这些交易，亦无意同时结算资产与负债。

下表列出了截至 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日，受上述安排约束的已确认金融资产和负债的账面金额，以及针对这些资产和负债所持有或质押的抵押品：

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

2025年12月31日

12. 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)

抵销及受主净额结算安排和类似协议约束的金额 (续)

	账面总额 美元	符合抵销条 件抵消的金 额 美元	列于财务状 况表的金额 美元	于财务状况表内不符 抵销条件而没有抵消 的- 所持有的现金及 非现金抵押品 美元	净风险 美元
2025年12月31日					
金融资产					
保证金账户	2,023,973	-	2,023,973	(459,974)	1,563,999
衍生金融工具	2,592,944	-	2,592,944		2,592,944
金融资产合计	4,976,917	-	4,976,917	(459,974)	4,156,943
金融负债					
衍生金融工具	(459,974)	-	(459,974)	459,974	-
金融负债合计	(459,974)	-	(459,974)	459,974	-
2024年12月31日					
金融资产					
衍生金融工具	274,765	-	274,765	(274,765)	-
金融资产合计	274,765	-	274,765	(274,765)	-
金融负债					
衍生金融工具	(2,739,779)	-	(2,739,779)	274,765	(2,465,014)
金融负债合计	(2,739,779)	-	(2,739,779)	274,765	(2,465,014)

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

2025年12月31日

13. 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 18,679,154 份，赎回 14,264,805 份；对于 A 类（人民币）份额，认购 23,692 份，赎回 1,310,695 份；对于 A 类（美元）份额，认购 502,068 份，赎回 629,994 份；对于 A 类派息（港币）份额，认购 191,366 份，无赎回份额；对于 A 类派息（人民币）份额，无认购份额，赎回 5 份；对于 R 类（人民币）份额，认购 338,304,952 份，赎回 2,617,830,112 份；对于 R 类（人民币）（对冲）份额，认购 2,540,889,161 份，赎回 282,181,188 份；对于 R 类（美元）份额，认购 5,032,206 份，无赎回份额；对于 I 类（人民币）份额，无认购份额，赎回 3,061,389 份；对于 I 类（美元）份额，认购 519,443 份，赎回 377,448 份；对于 I 类派息（美元）份额，认购 20,761 份，赎回 1,574,114 份；对于 C 类（人民币）份额，赎回 6,818 份，无赎回份额；对于 C 类（人民币）（对冲）份额，认购 6,808 份，无赎回份额；对于 C 类（美元）份额，认购 4,690,212 份，赎回 1,694,795 份。

14. 财务报表的批准

本财务报表经受托人和基金管理人于 2026 年 4 月 27 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)

2025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			
Australia & New Zealand Banking Group LTD 2.57% S/A 25NOV2035 REGS	2,000,000	1,802,320	0.10%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UK 6.75% S/A PERP REGS	7,000,000	7,075,460	0.38%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 4.423% S/A 14MAR2028	500,000	506,670	0.03%
NBN CO LTD 4.15% S/A 16SEP2030 REGS	1,500,000	1,497,270	0.08%
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.239% S/A 10NOV2037	260,000	2,602,002	0.14%
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.875% S/A 17JUN2046	12,152,000	12,217,255	0.65%
WESTPAC BANKING CORP/NEW ZEALAND 5% S/A PERP	4,750,000	4,761,543	0.25%
保加利亚			
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.75% S/A 02JUL2035	5,000,000	5,307,200	0.28%
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.875% S/A PERP	7,800,000	7,893,911	0.42%
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 8.25% S/A 17JUL2031	1,800,000	2,044,782	0.11%
巴西			
CAIXA ECONOMICA FEDERAL 5.625% S/A 13MAY2030 REGS	300,000	304,770	0.02%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	1,000,000	1,002,820	0.05%
BK OF NOVA SCOTIA 3.625% Q 27OCT2081	5,000,000	4,844,400	0.26%
ENBRIDGE INC 4.9% S/A 20 JUN 2030	200,000	204,492	0.01%
ENBRIDGE INC 5.55% S/A 20 JUN 2035	300,000	311,211	0.02%
ENBRIDGE INC 5.95% S/A 05APR2054	500,000	508,515	0.03%
ENBRIDGE INC 6% S/A 15NOV2028	2,000,000	2,103,180	0.11%
TORONTO-DOMINION BANK 5.146% S/A 10SEP2034	1,000,000	1,014,820	0.05%
TORONTO-DOMINION BANK 8.125% Q 31OCT2082	9,639,000	10,155,169	0.54%
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	12,271,000	12,163,629	0.65%
ABQ FINANCE LTD 2% S/A 25MAR2030	2,700,000	2,759,346	0.15%
BSF FINANCE 5.761% 03SEP2035	3,600,000	3,604,536	0.19%
CDBL FUNDING 1 4.75% S/A 27MAY2030	1,000,000	10,17,090	0.05%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.925% S/A 29NOV2028	1,000,000	1,035,630	0.06%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.05% S/A 10JAN2028	2,400,000	2,476,128	0.13%
CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD 2.3% S/A 30JUL2035	1,600,000	221,705	0.01%
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 2.125% S/A 14JUL2026	7,200,000	7,109,496	0.38%
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 4.875% S/A 10JUL2030	1,500,000	1,495,005	0.08%
CHINA RESOURCES LAND LTD 4.125% S/A 20NOV2028	4,600,000	4,589,190	0.25%
CK HUTCHISON INTL 25 LTD 4.25% S/A 26SEP2030	2,000,000	1,997,940	0.11%

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)

2025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			
开曼群岛 (续)			
ENN ENERGY HLDGS LTD 4.625% S/A 17MAY2027 REGS	1,847,000	1,852,633	0.10%
FWD GROUP HOLDINGS LTD 5.836% S/A 22SEP2035	2,000,000	2,018,100	0.11%
FWD GROUP LTD 5.252% S/A 22SEP2030	4,000,000	4,018,720	0.21%
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	2,500,000	2,770,725	0.15%
HAIDILAO INTL HLDG LTD 2.15% S/A 14JAN2026	700,000	699,174	0.04%
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% S/A 17SEP2026	3,875,000	3,801,763	0.20%
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	1,000,000	972,510	0.05%
JD.COM INC 3.875% S/A 29APR2026	1,040,000	1,038,825	0.06%
MEITUAN 3.1% S/A 05NOV2035	7,800,000	1,095,934	0.06%
MEITUAN 4.5% S/A 2APR2028 REGS	4,400,000	4,416,500	0.24%
MEITUAN 5.125% S/A 05NOV2035 REGS	1,100,000	1,090,298	0.06%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	2,800,000	2,611,560	0.14%
MEITUAN DIANPING 4.5% S/A 05MAY2031 REGS	400,000	396,104	0.02%
MEITUAN DIANPING 4.625% S/A 02OCT2029 REGS	2,300,000	2,306,739	0.12%
MEITUAN DIANPING 4.75% S/A 05NOV2032 REGS	400,000	395,668	0.02%
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.375% S/A 04DEC2029 REGS	1,000,000	987,940	0.05%
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	250,000	264,763	0.01%
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	4,000,000	4,047,280	0.22%
QIC CAYMAN LTD 6.15% S/A PERP	1,500,000	1,524,780	0.08%
SANDS CHINA LTD 2.3% S/A 08MAR2027	5,634,000	5,499,742	0.29%
SANDS CHINA LTD 2.85% S/A 08MAR2029	500,000	474,505	0.03%
SANDS CHINA LTD 3.8% S/A 08JAN2026	7,500,000	7,498,125	0.40%
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.225% S/A 18FEB2030	2,000,000	2,051,460	0.11%
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.489% S/A 18FEB2035 REGS	2,000,000	2,082,540	0.11%
SNB FUNDING LTD 6% S/A 24JUN2035	1,900,000	1,956,658	0.10%
SRC SUKUK LTD 5% S/A 27FEB2028	2,350,000	2,380,127	0.13%
SRC SUKUK LTD 5.375% S/A 27FEB2035	1,100,000	1,144,737	0.06%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	10,109,000	10,192,601	0.55%
TENCENT HLDGS LTD 1.81% S/A 26JAN2026 REGS	6,085,000	6,075,082	0.32%
TENCENT HLDGS LTD 3.29% S/A 03JUN2060 REGS	1,000,000	682,070	0.04%
TENCENT HLDGS LTD 3.595% S/A 19JAN2028 REGS	2,000,000	1,990,080	0.11%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	2,000,000	1,807,120	0.10%
WEIBO CORP 3.375% S/A 08JUL2030	8,000,000	7,590,800	0.41%
智利			
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.33% S/A 13JAN2035 REGS	250,000	266,365	0.01%
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	700,000	721,210	0.04%
REP OF CHILE 5.65% S/A 13JAN2037	200,000	211,758	0.01%
中国大陆			
CHENGDU INLAND PORT HUB 4.9% S/A 20AUG2028 REGS	4,000,000	572,408	0.03%
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.375% A 25NOV2029	500,000	585,121	0.03%

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)

2025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)			
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.625% A 25NOV2032	500,000	584,370	0.03%
GANSU PROVINCIAL HIGHWAY AVIATION TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 3.9% S/A 27SEP2026	2,000,000	290,106	0.02%
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT HLDG GROUP CO LTD 2.85% S/A 19JAN2027	400,000	391,652	0.02%
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT HLDG GROUP CO LTD 4.4% S/A 28NOV2027	4,500,000	4,502,070	0.24%
GANZHOU TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 2.85% S/A 19 AUG2028	5,000,000	716,779	0.04%
HUAXIA BANK CO LTD 0% A 16JAN2026	50,000,000	7,043,227	0.38%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD 3.2% S/A PERP	500,000	496,130	0.03%
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 2.9% S/A 25JUL2028	2,500,000	358,855	0.02%
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	300,000	307,935	0.02%
NANNING COMMUNICATIONS INVESTMENT GROUP CO LTD 7.3% S/A 30APR2027	2,400,000	2,466,000	0.13%
NANYANG URBAN INVESTMENT HOLDINGS CO LTD 5.4% S/A 29SEP2028	5,000,000	717,753	0.04%
SUZHOU CITY CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP (HOLDING) CO LTD 5% S/A 15JUL2028	1,500,000	1,507,320	0.08%
SX FENGXI DEVELOPMENT GR 4.95% S/A 28SEP2026	2,000,000	293,328	0.02%
SZ YINTONG AM INV S/A 4.5% 30JUL2028	2,000,000	294,058	0.02%
WUHAN METRO GROUP CO LTD 4.45% S/A 22OCT2027	1,000,000	1,004,800	0.05%
WUHAN OPTICAL VALLEY FINANCIAL HOLDING GROUP CO LTD 3.5% S/A 03JUL2028	20,000,000	2,884,672	0.15%
ZHANGZHOU TRANSPORTATION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.1% 09APR2028	1,700,000	1,715,079	0.09%
ZHENGZHOU REAL ESTATE GROUP CO LTD 2.7% S/A 22JUL2028	10,000,000	1,436,006	0.08%
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	15,581,000	15,576,326	0.83%
ZHUZHOU CITY CONSTRUCTION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.3% S/A 18 MAR 2028	1,000,000	1,014,620	0.05%
爱沙尼亚			
BANCO SANTANDER SA 5.365% S/A 15JUL2028	1,000,000	1,019,680	0.05%
BANCO SANTANDER SA 5.439% S/A 15JUL2031	1,000,000	1,051,660	0.06%
法国			
BNP PARIBAS SA 3.6% A 17AUG2031	100,000,000	14,441,118	0.77%
BNP PARIBAS SA 4.625% S/A PERP REGS	200,000	198,528	0.01%
BNP PARIBAS SA 5.176% S/A 09JAN2030 REGS	3,000,000	3,078,150	0.16%
BNP PARIBAS SA 6.875% S/A PERPETUAL	1,000,000	1,002,350	0.05%
BNP PARIBAS SA 7.45% S/A PERPETUAL REGS	900,000	940,743	0.05%
BNP PARIBAS SA 8.5% S/A PERP REGS	1,000,000	1,064,830	0.06%
CREDIT AGRICOLE SA 7.125% S/A PERPETUAL	3,750,000	3,897,038	0.21%
L'OREAL SA 5% S/A 20MAY2035 REGS	1,750,000	1,796,095	0.10%
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	8,000,000	7,961,680	0.43%

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)

2025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			
德国			
ALLIANZ SE 3.2% A PERP	10,000,000	9,433,300	0.51%
ALLIANZ SE 6.55% A PERP	4,000,000	4,152,400	0.22%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	500,000	519,765	0.03%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	1,067,180	0.06%
中国香港			
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	21,441,000	2,131,2140	1.15%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.85% Q 14JAN2035	3,300,000	490,790	0.03%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 3.4% S/A 14JAN2055 REGS	2,500,000	396,892	0.02%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.75% S/A 15JUL2028	3,000,000	3,074,400	0.16%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 4.875% S/A 15JUL2030 REGS	1,200,000	1,250,364	0.07%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 5.125% S/A 15JAN 2035 REGS	500,000	533,045	0.03%
BANK OF COMMUNICATIONS HONG KONG LTD 2.304% S/A 08JUL2031	10,000,000	9,901,700	0.53%
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	6,764,000	6,763,932	0.36%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	6,950,000	6,976,688	0.37%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 15MAR2027	4,361,000	4,378,924	0.23%
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	8,450,000	8,868,782	0.47%
BLOSSOM JOY LTD 2.2% S/A 21OCT2030	1,000,000	918,480	0.05%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	6,330,000	6,625,801	0.35%
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	5,500,000	5,666,540	0.30%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 5% S/A 08OCT2035	3,000,000	3,001,950	0.16%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 6.125% S/A 16MAY2034	484,000	522,952	0.03%
CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS CO LTD 6.4% S/A PERP	1,000,000	1,047,210	0.06%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.75% S/A 07APR2032	250,000	249,750	0.01%
CHIYU BANKING CORP LTD 8% S/A PERP	500,000	521,010	0.03%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	3,000,000	2,959,140	0.16%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% S/A 19JUL2027	1,100,000	1,101,045	0.06%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	3,000,000	3,063,390	0.16%
DAH SING BANK LTD 3% S/A 02NOV2031	4,460,000	4,388,105	0.23%
DAH SING BANK LTD 7.375% S/A 15NOV2033	11,950,000	12,704,762	0.68%
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 14FEB2028	30,000,000	4,389,950	0.23%
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 26OCT2026	8,977,000	8,932,295	0.48%
FAR EAST HORIZON LTD 5.875% S/A 5MAR2028	3,257,000	3,308,200	0.18%
FAR EAST HORIZON LTD 6% S/A 01OCT2028	6,435,000	6,580,882	0.35%
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	11,500,000	11,754,725	0.63%
HONG KONG XIANGYU INVESTMENT CO LTD 3.15% S/A 15JUL2028	10,000,000	1,425,423	0.08%
HPHT FINANCE LTD 5% S/A 21FEB2030	2,454,000	2,493,804	0.13%
LENOVO GROUP LTD 3.421% S/A 02NOV2030 REGS	500,000	476,810	0.03%
LENOVO GROUP LTD 6.536% S/A 27JUL2032 REGS	1,300,000	1,422,135	0.08%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6% S/A 6AUG2034	250,000	258,675	0.01%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6.5% S/A PERP	10,000,000	10,213,900	0.55%

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)

2025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			
中国香港 (续)			
SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 6.375% S/A 28FEB2033	1,000,000	1,029,860	0.06%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.4% S/A 30OCT2028	1,000,000	999,710	0.05%
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.4% S/A 03SEP2029	2,000,000	293,113	0.02%
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.45% S/A 22JUL2035	1,000,000	145,202	0.01%
WESTWOOD GROUP HLDGS LTD 2.8% S/A 20JAN2026	2,800,000	2,791,236	0.15%
XIAOMI BEST TIME INTL LTD 2.875% S/A 14JUL2031 REGS	1,000,000	924,650	0.05%
ZHEJIANG SEAPORT INTL CO LTD 1.98% S/A 17MAR2026	1,000,000	994,850	0.05%
印度			
AXIS BANK LTD/GIFT CITY 4.1% S/A PERP REGS	2,000,000	1,975,760	0.11%
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 02MAR2030 REGS	500,000	508,325	0.03%
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 23APR2029 REGS	400,000	406,904	0.02%
REC LTD 4.75% S/A 27SEP2029	1,000,000	1,011,400	0.05%
TATA CAPITAL LTD 5.389% S/A 21JUL2028	1,500,000	1,531,350	0.08%
印度尼西亚			
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.5% S/A 31OCT2030	7,000,000	1,002,717	0.05%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.9% S/A 31OCT2035	9,300,000	1,332,063	0.07%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 11JAN2028	3,000,000	2,971,620	0.16%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.9% S/A 16APR2036	3,000,000	2,998,620	0.16%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 15JAN2030	500,000	518,970	0.03%
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	500,000	508,670	0.03%
PERTAMINA HUTU ENERGI PT 5.25% S/A 21MAY2030	1,500,000	1,531,230	0.08%
REPUBLIC OF INDONESIA 5.6% S/A 15JAN2035	1,300,000	1,380,704	0.07%
爱尔兰			
CLOVERIE PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 5.625% A 24JUN2046	5,400,000	5,428,296	0.29%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.7% A 11NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 5.75% A 12NOV2034	7,000,000	7,000,000	0.37%
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 6.03% A 21JAN2035 (CALLED)	5,000,000	5,000,000	0.27%
日本			
ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO 6.9% S/A PERP	800,000	834,432	0.04%
CHUGOKU ELECTRIC POWER CO INC 5.742% S/A 14JAN2035	700,000	733,509	0.04%

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)

2025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			
日本 (续)			
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 4% S/A PERP REGS	17,506,000	17,453,657	0.93%
DENSO CORP 4.282% S/A 17SEP2030 REGS	2,000,000	2,003,940	0.11%
KANSAI ELECTRIC POWER CO INC 5.037% S/A 26FEB2030	500,000	513,335	0.03%
MARUBENI CORP 5.383% S/A 01APR2035	300,000	310,875	0.02%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.159% S/A 24APR2031	900,000	930,609	0.05%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.197% S/A 16JAN2031	1,300,000	1,343,641	0.07%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.574% S/A 16JAN2036	2,000,000	2,101,440	0.11%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP	1,000,000	1,095,560	0.06%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.13% Q 12SEP2031	5,000,000	5,021,050	0.27%
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.48% Q 24APR2031	1,600,000	1,629,520	0.09%
MITSUMI & CO LTD 4.398% S/A 03SEP2030	2,500,000	2,516,050	0.13%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.098% S/A 13MAY2031	500,000	515,000	0.03%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.08% Q 13MAY2031	1,500,000	1,503,975	0.08%
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.25% Q 08JUL2031	900,000	908,640	0.05%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4% S/A 19SEP2047 REGS	10,000,000	9,939,000	0.53%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4.114% A 23JAN2055	300,000	322,236	0.02%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4.7% S/A 20JAN2046 (CALLED)	12,874,000	12,878,505	0.69%
NOMURA HLDGS INC 1.653% S/A 14JUL2026	300,000	296,316	0.02%
NOMURA HLDGS INC 2.329% S/A 22JAN2027	4,000,000	392,8800	0.21%
NOMURA HLDGS INC 3.103% S/A 16JAN2030	1,500,000	142,7205	0.08%
NOMURA HLDGS INC 4.904% S/A 01JUL2030	800,000	813,544	0.04%
NOMURA HLDGS INC 5.043% S/A 10JUN2036	4,200,000	4,162,956	0.22%
NOMURA HLDGS INC 5.491% S/A 29JUN2035	400,000	413,968	0.02%
NOMURA HLDGS INC 7% S/A PERPETUAL	3,800,000	3,888,654	0.21%
NORINCHUKIN BANK 5.094% S/A 16OCT2029 REGS	200,000	204,370	0.01%
NTT FINANCE CORP 2.906% A 16MAR2029 REGS	250,000	293,749	0.02%
NTT FINANCE CORP 3.678% A 16JUL2033 REGS	350,000	413,381	0.02%
NTT FINANCE CORP 4.091% A 16JUL2037 REGS	250,000	296,887	0.02%
NTT FINANCE CORP 4.567% S/A 16JUL2027 REGS	1,900,000	1,916,568	0.10%
NTT FINANCE CORP 4.62% S/A 16JUL2028 REGS	3,000,000	3,041,160	0.16%
NTT FINANCE CORP 4.876% S/A 16JUL2030 REGS	2,200,000	2,243,802	0.12%
NTT FINANCE CORP 5.171% S/A 16JUL2032 REGS	4,000,000	4,115,000	0.22%
NTT FINANCE CORP 5.502% S/A 16JUL2035 REGS	1,500,000	1,558,965	0.08%
NTT FINANCE CORP S+1.08% Q 16JUL2028 REGS	2,900,000	2,927,869	0.16%
NTT FINANCE CORP S+1.31% Q 16JUL2030 REGS	3,500,000	3,557,995	0.19%
OLYMPUS CORP 2.143% S/A 08DEC2026 REGS	3,345,000	3,284,489	0.18%
RESONA BANK LTD 4.983% S/A 22JAN2028	250,000	254,070	0.01%
SEKISUI HOUSE LTD 4.7% S/A 23FEB2030	1,000,000	1,017,010	0.05%
SOFTBANK GROUP CORP 6.5% S/A 29OCT2062	500,000	543,104	0.03%
SOFTBANK GROUP CORP 7.625% S/A 29APR2061	1,000,000	941,550	0.05%
SOFTBANK GROUP CORP 8.25% S/A 29OCT2065	750,000	705,503	0.04%
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.236% S/A 01MAY2030	500,000	515,570	0.03%

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)

2025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			
日本 (续)			
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.836% S/A 09JUL2044	450,000	467,897	0.03%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 6.45% S/A PERP REGS	1,200,000	1,218,312	0.07%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.05% Q 15APR2030	1,000,000	1,003,410	0.05%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.45% S/A 10SEP2027	900,000	908,388	0.05%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.5% S/A 13MAR2028 REGS	700,000	707,574	0.04%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.75% Q 11SEP2028	2,900,000	2,906,554	0.16%
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.99% Q 13MAR2030	2,700,000	2,731,941	0.15%
SUMITOMO MITSUI TRUST GROUP INC 5.416% S/A 11SEP2036 REGS	900,000	907,722	0.05%
哈萨克斯坦			
DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN JSC 3.5% A 01SEP2028	4,000,000	576,138	0.03%
KAZMUNAVGAS NATIONAL CO 2.95% S/A 30OCT2030	6,300,000	891,466	0.05%
韩国			
GS CALTEX CORP 4.25% S/A 28OCT2030	400,000	397,072	0.02%
HANA BANK 3.5% S/A PERP REGS	10,651,000	10,537,778	0.56%
HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	524,805	0.03%
HANA SECURITIES CO LTD 5% S/A 30APR2028	1,900,000	1,931,939	0.10%
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 3.379% S/A 04FEB2032 REGS	1,000,000	986,120	0.05%
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 6.3% S/A 24JUN2055	4,100,000	4,261,991	0.23%
KB CAPITAL CO LTD 4.25% S/A 01OCT2030	500,000	494,420	0.03%
KEB HANA BANK 4% S/A 21OCT2030 REGS	500,000	499,995	0.03%
KEB HANBA BANK S+0.6% Q 21OCT2028	250,000	250,565	0.01%
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	750,000	763,395	0.04%
KOOKMIN BANK 4.375% S/A 08MAY2028 REGS	750,000	758,160	0.04%
KOOKMIN BANK 4.625% S/A 08MAY2030 REGS	650,000	665,470	0.04%
KOREA DEVELOPMENT BANK S+0.76% Q 03FEB2030	750,000	756,008	0.04%
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4.125% S/A 12NOV2030	300,000	300,339	0.02%
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4.75% S/A 13FEB2028 REGS	250,000	254,083	0.01%
KOREA ELECTRIC POWER CORP S+0.62% Q 12NOV2028	400,000	399,944	0.02%
KOREA HOUSING FINANCE CORP 5.125% S/A 21JAN2030 REGS	1,200,000	1,249,500	0.07%
KOREA HOUSING FINANCE CORP S+0.9% Q 21JAN2030 REGS	1,200,000	1,211,268	0.06%
KOREA INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 06NOV2026	1,900,000	1,938,551	0.10%
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.83% Q 03APR2027	750,000	752,505	0.04%

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)

2025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)			
KOREA NATIONAL OIL CORP 3M S+0.9% Q 30SEP2027	500,000	502,765	0.03%
KOREA NATIONAL OIL CORP S+0.67% Q 29SEP2028	500,000	500,415	0.03%
KOREA OCEAN BUSINESS CORP 4.625% S/A 09MAY2030	1,300,000	1,325,207	0.07%
KOREA TOBACCO & GINSENG CORP 5% S/A 02MAY2028	250,000	255,023	0.01%
KOREA WATER RESOURCES CORP 4.375% S/A 21MAY2027	500,000	503,390	0.03%
KYOBO LIFE INSURANCE CO 5.9% S/A PERP REGS	7,200,000	7,306,920	0.39%
LG ENERGY SOLUTION 5.25% S/A 02APR2028 REGS	1,250,000	1,274,625	0.07%
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02APR2030 REGS	4,250,000	4,370,445	0.23%
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	500,000	507,840	0.03%
LG ENERGY SOLUTION 5.875% S/A 02APR2035 REGS	2,250,000	2,329,898	0.12%
LOTTE PROPERTY & DEVELOPMENT CO LTD 4.375% S/A 14JUL2028	1,000,000	1,007,280	0.05%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 4.375% S/A 14OCT2028	1,000,000	1,000,260	0.05%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.5% S/A 31JUL2027	500,000	508,895	0.03%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 5.875% S/A 26JAN2027	200,000	203,256	0.01%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6% S/A 26JAN2029	700,000	729,519	0.04%
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 6.875% S/A 26JUL2026	1,500,000	1,521,255	0.08%
NH INVESTMENT & SECS 4.625% S/A 10JUL2028	250,000	252,735	0.01%
POSCO HOLDINGS INC 5.125% S/A 07MAY2030 REGS	500,000	512,145	0.03%
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	1,000,000	1,051,610	0.06%
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	5,500,000	5,450,060	0.29%
SK HYNIX INC 6.25% S/A 17JAN2026 REGS	520,000	520,374	0.03%
SK HYNIX INC 6.375% S/A 17JAN2028 REGS	800,000	834,896	0.04%
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 6.25% S/A 07MAY2035	4,500,000	4,675,140	0.25%
WOORI BANK 6.375% S/A PERP REGS	200,000	208,228	0.01%
卢森堡			
ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 5.524% A PERP	4,930,000	4,975,701	0.27%
NEXA RESOURCES SA 6.6% S/A 08APR2037 REGS	1,300,000	1,342,692	0.07%
RAIZEN FUELS FINANCE 6.25% S/A 08JUL2032	500,000	421,960	0.02%
马来西亚			
AFFIN BANK BHD 5.112% S/A 04JUN2030	1,000,000	1,020,940	0.05%
PETRONAS CAPITAL LTD 4.95% S/A 03JAN2031 REGS	1,500,000	1,551,555	0.08%
PETRONAS CAPITAL LTD 5.34% S/A 03APR2035	1,000,000	1,042,590	0.06%
毛里求斯			
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 7.25% S/A 27SEP2028 REGS	1,100,000	1,111,726	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)

2025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			
墨西哥			
BBVA BANCOMER SA/TEXAS 7.625% S/A 11FEB2035 REGS	200,000	210,406	0.01%
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 13MAY2030	500,000	524,980	0.03%
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.875% S/A 13MAY2037	1,000,000	1,068,650	0.06%
荷兰			
DEMETER INVESTMENTS BV FOR SWISS RE LTD 5.625% A 15AUG2052	1,100,000	1,114,575	0.06%
EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.98% S/A 11FEB2035	200,000	212,552	0.01%
ING GROEP NV 5.75% S/A PERP	5,600,000	5,632,648	0.30%
ING GROEP NV 7.25% S/A PERP	1,000,000	1,064,460	0.06%
ING GROEP NV S+1.01% Q 25MAR2029	1,500,000	1,504,425	0.08%
MERRILL LYNCH BV 2.7% A 25JUL2035	3,000,000	429,633	0.02%
PROSUS NV 3.68% S/A 21JAN2030 REGS	800,000	768,496	0.04%
秘鲁			
PERUVIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.2% S/A 30JUN2055	500,000	515,715	0.03%
卡塔尔			
QIB TIER 1 SUKUK LLC 5.45% S/A PERP	500,000	502,490	0.03%
沙特阿拉伯			
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.625% S/A 13JAN2035 REGS	1,600,000	1,698,192	0.09%
新加坡			
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	900,000	957,024	0.05%
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD 5.332% S/A 02APR2030	700,000	722,925	0.04%
MEDCO CYPRESS TREE PTE LTD 8.625% S/A 19MAY2030	250,000	263,920	0.01%
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% S/A 11SEP2034	200,000	198,750	0.01%
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.875% S/A 17MAR2041	400,000	402,956	0.02%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	200,000	207,096	0.01%
SHIN KONG LIFE SG PTE 6.95% S/A 26JUN2035	1,000,000	1,077,080	0.06%
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	800,000	840,520	0.04%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.05% S/A 30JUL2035	10,000,000	1,395,735	0.07%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.55% S/A 30JUL2055 REGS	13,000,000	1,770,779	0.09%
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.1% S/A 28AUG2054	3,000,000	460,236	0.02%
西班牙			
BANCO SANTANDER SA 4.551% S/A 06NOV2030	1,000,000	1,002,860	0.05%
BANCO SANTANDER SA 4.75% Q PERP	4,400,000	4,371,928	0.23%
BANCO SANTANDER SA 5.565% S/A 17JAN2030	3,400,000	3,546,438	0.19%
多边国家			
AFRICAN DEVELOPMENT BANK A 5.875% PERP CORP ANDINA DE FOMENTO 6.75% S/A PERP	1,800,000	1,801,332	0.10%
	400,000	411,868	0.02%

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)

2025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			
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 6.75% S/A PERP	1,000,000	1,039,100	0.06%
瑞士			
JULIUS BAER GROUP LTD 7.5% S/A PERP	400,000	414,548	0.02%
UBS GROUP AG 3.875% S/A PERP REGS	2,917,000	2,899,031	0.16%
UBS GROUP AG 4.875% S/A PERP REGS	2,000,000	1,983,500	0.11%
UBS GROUP AG 5.125% A PERP	4,500,000	4,492,935	0.24%
UBS GROUP AG 7% S/A PERP REGS	1,000,000	1,023,100	0.05%
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	400,000	439,604	0.02%
UBS GROUP AG S+1.06% Q 23SEP2031	3,000,000	2,998,410	0.16%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.6% S/A PERP	1,750,000	1,778,980	0.10%
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	400,000	469,688	0.03%
泰国			
BANGKOK BANK PCL 3.466% S/A 23SEP2036 REGS	500,000	455,420	0.02%
BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 3.733% S/A 25SEP2034 REGS	3,159,000	3,001,619	0.16%
土耳其			
TVF VARLIK KIRALAMA AS 6.95% S/A 23JAN2030	400,000	416,176	0.02%
阿联酋			
DAE SUKUK DIFC LTD 4.5% S/A 16OCT2030 REGS	600,000	594,102	0.03%
EMIRATES NBD BANK PJSC 5.141% S/A 26NOV2029	900,000	929,196	0.05%
英国			
BARCLAYS PLC 4.375% Q PERP	3,000,000	2,901,930	0.16%
BARCLAYS PLC S+1.01% Q 11NOV2029	800,000	803,736	0.04%
CSL FINANCE PLC 4.25% S/A 27APR2032	1,000,000	983,630	0.05%
CSL FINANCE PLC 4.75% S/A 27APR2052	1,280,000	1,106,483	0.06%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.03% Q 03MAR2029	1,600,000	1,605,328	0.09%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.04% Q 19NOV2028	1,000,000	1,004,750	0.05%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.19% Q 06NOV2031	1,300,000	1,305,226	0.07%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.29% Q 03MAR2031	1,200,000	1,210,224	0.06%
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.57% Q 13MAY2031	1,400,000	1,427,090	0.08%
HSBC HLDGS PLC 4.619% S/A 06NOV2031	1,300,000	1,305,486	0.07%
HSBC HLDGS PLC 5.741% S/A 10SEP2036	1,400,000	1,443,736	0.08%
HSBC HLDGS PLC 6.875% S/A PERP	800,000	827,248	0.04%
HSBC HLDGS PLC 6.95% S/A PERP	500,000	519,160	0.03%
HSBC USA INC 4.65% S/A 06JUN2028	2,000,000	2,031,820	0.11%
MITSUBISHI HC CAPITAL UK PLC 5.302% S/A 23JAN2028	550,000	561,352	0.03%
NATWEST GROUP PLC 5.115% S/A 23MAY2031	3,800,000	3,905,411	0.21%
SANTANDER UK GROUP HLDGS PLC 6.534% S/A 10JAN2029	3,000,000	3,135,720	0.17%
STANDARD CHARTERED PLC 5.005% S/A 15OCT2030 REGS	1,000,000	1,021,250	0.05%
STANDARD CHARTERED PLC 5.545% S/A 21JAN2029	1,000,000	1,026,450	0.05%
STANDARD CHARTERED PLC 7.625% S/A PERP REGS	1,500,000	1,600,665	0.09%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	350,000	363,605	0.02%
STANDARD CHARTERED PLC L+1.51% Q PERP	1,000,000	969,220	0.05%

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)

2025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			
英国 (续)			
STANDARD CHARTERED PLC S+1.24% Q 21JAN2029 REGS	3,000,000	3,022,530	0.16%
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	1,006,810	0.05%
美国			
BANK OF NEW YORK MELLON 4.587% S/A 20APR2027	1,000,000	1,001,340	0.05%
BANK OF NEW YORK MELLON 4.729% S/A 20APR2029	1,000,000	1,016,880	0.05%
BOC AVIATION USA CORP 4.75% S/A 14JAN2028	2,500,000	2,534,275	0.14%
BRIGHT FOOD SINGAPORE HLDGS PTE CO LTD 3.25% A 09JUL2030	1,000,000	1,179,200	0.06%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.5% S/A 06AUG2030	6,000,000	856,809	0.05%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.75% S/A 06AUG2035	4,000,000	561,061	0.03%
CHUBB INA HOLDINGS LLC 3.05% S/A 06AUG2055	4,000,000	553,620	0.03%
CIGNA GROUP/THE 6% S/A 15JAN2056	1,800,000	1,852,560	0.10%
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.718% S/A 23JUL2032	1,300,000	1,364,116	0.07%
DELL INTL LLC/EMC CORP 4.75% S/A 06OCT2032	1,000,000	999,470	0.05%
GENERAL MOTORS CO 5.625% S/A 15APR2030	500,000	521,435	0.03%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5% S/A 15JUL2027	1,500,000	1,520,010	0.08%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.45% S/A 15JUL2030	2,250,000	2,336,985	0.13%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.8% S/A 07JAN2029	1,500,000	1,564,350	0.08%
HANWHA FUTUREPROOF CORP 4.75% S/A 30APR2028 (EXCHANGED)	500,000	491,795	0.03%
HCA INC 4.3% S/A 15NOV2030	300,000	298,956	0.02%
HCA INC 5% S/A 01MAR2028	1,000,000	1,018,990	0.05%
HCA INC 5.25% S/A 01MAR2030	1,000,000	1,033,670	0.06%
JOHNSON & JOHNSON S/A 3.4% 15JAN2038	1,700,000	1,497,751	0.08%
KIB SUKUK LTD 5.535% S/A	500,000	503,320	0.03%
KIMCO REALTY OP LLC 5.3% S/A 01FEB2036	400,000	410,108	0.02%
KOMATSU FINANCE AMERICA INC 4.196% S/A 18SEP2030	1,000,000	995,660	0.05%
KUBOTA CREDIT CORP USA 4.791% S/A 28MAY2028	500,000	506,640	0.03%
META PLATFORMS INC 4.875% S/A 15NOV2035	1,500,000	1,496,670	0.08%
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% S/A 22OCT2028	3,200,000	3,196,095	0.17%
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	1,207,752	0.06%
NORTHROP GRUMMAN CORP 4.65% S/A 15JUL2030	1,800,000	1,831,518	0.10%
NORTHROP GRUMMAN CORP 5.25% S/A 15JUL2035	1,600,000	1,659,104	0.09%
ORACLE CORP 4.8% S/A 26SEP2032	500,000	483,245	0.03%
PROLOGIS LP 3.25% S/A 11SEP2029	5,000,000	728,028	0.04%
PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING 4.772% S/A 09DEC2029	400,000	407,108	0.02%
RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC/RWLV CAPITAL INC 4.625% S/A 16APR2029 REGS	1,000,000	889,240	0.05%
SHELL FINANCE US INC S+0.78% S/A 06NOV2030	2,000,000	2,002,220	0.11%
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% 02JAN2026	10,000,000	9,998,150	0.53%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.55% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%

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)

2025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 (续)			
WP CAREY INC 4.65% S/A 15JUL2030	1,000,000	1,007,680	0.05%
乌兹别克斯坦			
NAVOI MINING & METALLURGICAL COMBINAT 6.7% S/A 17OCT2028 REGS	400,000	426,772	0.02%
英属维尔京群岛			
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% S/A 22AUG2029	2,520,000	2,504,930	0.13%
CENTRAL INTL DEVELOPMENT BVI LTD 5.1% S/A 19AUG2027	500,000	504,195	0.03%
CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD 7.15% S/A 21MAR2028	550,000	550,006	0.03%
CFAMC II CO LTD 4.875% S/A 22NOV2026	11,798,000	11,852,625	0.63%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 6.25% S/A 26MAR2028	3,200,000	3,286,592	0.18%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 6.8% S/A 25JUN2027	5,000,000	5,142,250	0.28%
CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 4.375% S/A 21DEC2027	5,700,000	5,711,286	0.31%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.875% S/A 20JAN2026	3,639,000	3,635,507	0.19%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 2.58% S/A 25JUN2028	20,000,000	2,870,179	0.15%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3.25% S/A 28JAN2027	10,000,000	9,899,900	0.53%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 4.375% S/A 13NOV2028	900,000	904,185	0.05%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	1,000,000	1,038,990	0.06%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD S+1% Q 13NOV2030	600,000	601,992	0.03%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.75% S/A 21FEB2029	1,000,000	1,010,530	0.05%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	2,000,000	1,987,700	0.11%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 6.375% S/A 02JAN2028	3,100,000	3,214,700	0.17%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 7.15% S/A PERP	600,000	624,204	0.03%
CHINA RESOURCES LAND LTD 2.4% S/A 20NOV2030	18,100,000	2,555,935	0.14%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4.8% S/A 15JAN2028	600,000	605,922	0.03%
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	2,000,000	2,061,000	0.11%
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 2.625% S/A 17SEP2030	910,000	849,330	0.05%
FORTUNE STAR BVI LTD 5% S/A 18MAY2026	1,000,000	997,930	0.05%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.05% S/A 27JAN2027	2,750,000	2,697,200	0.14%
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% S/A 09SEP2029	1,300,000	1,282,359	0.07%
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% S/A 19MAY2028	1,000,000	1,026,520	0.05%
HUAFA 2024 I CO LTD 3.05% S/A	5,000,000	707,348	0.04%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.25% S/A 07NOV2027	13,500,000	13,397,940	0.72%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% S/A 27APR2027	15,128,000	15,141,918	0.81%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	13,641,000	12,962,224	0.69%

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)

2025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 3.625% S/A 30SEP2030	3,800,000	3,620,260	0.19%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% S/A 13NOV2029	4,100,000	3,986,717	0.21%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.5% S/A 29MAY2029	8,180,000	8,141,227	0.44%
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625% S/A 03JUN2026	20,441,000	20,445,906	1.10%
JOY DELIGHT INTERNATIONAL LTD 3.3% S/A 03NOV2028	10,000,000	1,416,343	0.08%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 4.3% S/A 04DEC2028	1,600,000	1,600,656	0.09%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 5.5% S/A 1FEB2027	5,700,000	5,756,544	0.31%
JUNFENG INTERNATIONAL CO LTD 5.6% S/A 21OCT2027	1,500,000	1,526,040	0.08%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.625% S/A PERP	5,600,000	5,657,904	0.30%
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	471,165	0.03%
TENCENT HOLDINGS LTD 3.1% S/A 23SEP2055	2,000,000	289,687	0.02%
YIELDKING INVESTMENT LTD 2.8% S/A 18AUG2026	5,000,000	4,930,350	0.26%
YUEXIU REIT MTN CO LTD 2.65% S/A 02FEB2026	2,000,000	1,988,900	0.11%
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	1,010,160	0.05%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.59% Q 08DEC2028 REGS	2,000,000	2,004,540	0.11%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.62% Q 18JUN2028 REGS	1,200,000	1,204,836	0.06%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.68% Q 08DEC2030 REGS	4,000,000	4,007,080	0.21%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.85% Q 16DEC2029 REGS	1,000,000	1,010,640	0.05%
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/NEW YORK 3.919% S/A 08DEC2028	500,000	501,735	0.03%
BHP BILLITON FINANCE USA LIMITED 5% S/A 15FEB2036	1,000,000	1,015,860	0.05%
BHP BILLITON FINANCE USA LIMITED 5.75% S/A 05SEP2055	600,000	616,452	0.03%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.929% S/A 14MAR2046	1,000,000	1,027,420	0.05%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.78% Q 01OCT2030 REGS	2,000,000	2,012,600	0.11%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.81% Q 14MAR2030 REGS	600,000	605,094	0.03%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 4.15% S/A 01OCT2030	2,500,000	2,509,525	0.13%
MACQUARIE BANK LTD S+0.74% Q 12JUN2028 REGS	500,000	502,330	0.03%
MACQUARIE BANK LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	503,300	0.03%
MACQUARIE BANK LTD/LONDON 6.125% S/A PERP REGS	3,000,000	3,047,520	0.16%

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)

2025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			
澳大利亚 (续)			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.902% S/A 14JAN2036 REGS	2,000,000	2,110,360	0.11%
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD S+0.79% Q 14JAN2030	1,350,000	1,360,125	0.07%
NATL AUST BK/NY 4.901% S/A 14JAN2030	2,400,000	2,477,400	0.13%
SANTOS FINANCE LTD 5.75% S/A 13NOV2035 REGS	2,600,000	2,598,856	0.14%
SCENTRE GROUP TRUST 2 5.125% S/A 24SEP2080 REGS	17,023,000	17,140,459	0.92%
WOODSIDE FINANCE LTD 5.4% S/A 19MAY2030	600,000	617,526	0.03%
WOODSIDE FINANCE LTD 6% S/A 19MAY2035	1,500,000	1,564,575	0.08%
巴西			
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.625% S/A 15MAR2035	750,000	773,295	0.04%
FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.5% S/A 06NOV2030	500,000	508,685	0.03%
加拿大			
BANK OF MONTREAL 6.875 Q 26NOV2085	6,000,000	6,166,680	0.33%
BANK OF NOVA SCOTIA 3M TS+2.90961% Q PERP	900,000	896,895	0.05%
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 4.862% S/A 13JAN2028	2,000,000	2,016,040	0.11%
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.245% S/A 13JAN2031	2,000,000	2,064,520	0.11%
ENBRIDGE INC 4.6% S/A 20JUN2028	300,000	303,381	0.02%
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD 5.75% S/A 20MAY2035	3,300,000	3,434,871	0.18%
GILDAN ACTIVEWEAR INC 4.7% S/A 7OCT2030	400,000	398,492	0.02%
GILDAN ACTIVEWEAR INC 5.4% S/A 7OCT2035	400,000	399,504	0.02%
开曼群岛			
MA'ADEN SUKUK LTD 5.25% S/A 13FEB2030	600,000	616,002	0.03%
MELCO RESORTS FINANCE LTD 7.625% S/A 17APR2032 REGS	2,000,000	2,102,960	0.11%
智利			
AES ANDES SA 6.25% S/A 14MAR2032	500,000	521,035	0.03%
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	750,000	812,513	0.04%
芬兰			
NORDEA BANK ABP 6.75% S/A PERP	1,900,000	1,949,609	0.10%
法国			
BNP PARIBAS SA 5.786% S/A 13JAN2033 REGS	7,000,000	7,360,850	0.39%
CREDIT AGRICOLE SA 4.75% Q PERP REGS	2,850,000	2,756,748	0.15%
CREDIT AGRICOLE SA 4.818% S/A 25SEP2033	2,500,000	2,501,975	0.13%
CREDIT AGRICOLE SA 5.222% S/A 27MAY2031	1,500,000	1,543,320	0.08%
CREDIT AGRICOLE SA 5.23% S/A 09JAN2029	2,100,000	2,145,066	0.11%
CREDIT AGRICOLE SA 5.862% S/A 09JAN2036	2,000,000	2,116,740	0.11%
CREDIT AGRICOLE SA S+1.13% Q 09JAN2029 REGS	2,100,000	2,107,392	0.11%
ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.75% S/A 13JAN2035	1,500,000	1,580,040	0.08%
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.375% S/A 13JAN2055	1,000,000	1,048,180	0.06%
SOCIETE GENERALE SA 5.249% S/A 22MAY2029 REGS	1,500,000	1,530,675	0.08%

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)

2025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			
法国 (续)			
SOCIETE GENERALE SA 5.439% S/A 03OCT2036 REGS	8,000,000	8,046,400	0.43%
SOCIETE GENERALE SA 5.5% S/A 13APR2029 REGS	7,000,000	7,175,280	0.38%
SOCIETE GENERALE SA 5.512% S/A 22MAY2031 REGS	1,300,000	1,343,563	0.07%
SOCIETE GENERALE SA 6.1% S/A 13APR2033 REGS	2,800,000	2,961,560	0.16%
SOCIETE GENERALE SA 8.125% S/A PERP	950,000	1,000,331	0.05%
德国			
ALLIANZ SE 5.6% S/A 3SEP2054 REGS	3,000,000	3,072,450	0.16%
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.353% S/A 10JAN2029	3,900,000	3,982,836	0.21%
印度尼西亚			
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.4% S/A 14AUG2030	1,000,000	654,563	0.04%
REPUBLIC OF INDONESIA 5.3% S/A 14AUG2035	1,200,000	786,838	0.04%
爱尔兰			
CRH SMW FINANCE DAC 5.125% S/A 09JAN2030	500,000	515,880	0.03%
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.1% S/A 01APR2030 REGS	750,000	768,398	0.04%
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.55% S/A 3APR2034 REGS	1,600,000	1,654,160	0.09%
意大利			
SNAM SPA 5.75% S/A 28MAY2035	900,000	942,048	0.05%
日本			
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 6.35% S/A PERP	5,000,000	5,072,450	0.27%
RAKUTEN GROUP INC 11.25% S/A 15FEB2027	500,000	534,270	0.03%
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	3,604,000	3,578,916	0.19%
韩国			
LG ENERGY SOLUTION S+1.7% Q 02APR2030	400,000	407,640	0.02%
卢森堡			
CHILE ELECTRICITY LUX 5.672% S/A 20OCT2035 REGS	500,000	503,334	0.03%
NESTLE FINANCE INTL LTD 2.8% A 29MAY2035 REGS	14,000,000	2,017,546	0.11%
墨西哥			
BANCO SANTANDER MEXICO SA 5.621% S/A 10DEC2029 REGS	900,000	934,686	0.05%
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.45% S/A 24JAN2035	900,000	925,776	0.05%
荷兰			
ING GROEP NV 7% S/A PERP	1,200,000	1,251,420	0.07%
SIEMENS FUNDING BV 4.9% S/A 28MAY2032	700,000	721,490	0.04%
SYNGENTA FINANCE NV 5.182% S/A 24APR2028 REGS	300,000	303,846	0.02%

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)

2025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			
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	500,000	457,430	0.02%
BANK OF NEW ZEALAND 5.698% S/A 28JAN2035 REGS	3,000,000	3,103,710	0.17%
WESTPAC NEW ZEALAND LTD 4.938% S/A 27FEB2030 REGS	1,000,000	1,026,300	0.05%
秘鲁			
BANCO DE CREDITO DEL PERU 6.45% S/A 30JUL2035 REGS	1,800,000	1,879,434	0.10%
PERUVIAN GOVERNMENT INTL BOND 5.5% S/A 30MAR2036	1,000,000	1,022,110	0.05%
沙特阿拉伯			
SAUDI ARABIAN OIL CO 6.375% S/A 02JUN2055 REGS	1,000,000	1,047,210	0.06%
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.125% S/A 13JAN2028 REGS	3,400,000	3,472,522	0.19%
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.375% S/A 13JAN2031 REGS	2,000,000	2,094,380	0.11%
新加坡			
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 2.82% A 28JUL2035	20,000,000	2,864,222	0.15%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.4% A 11DEC2034	6,000,000	6,000,000	0.32%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.8% A 10FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 6.06% A 21JAN2035 (CALLED)	5,000,000	5,000,000	0.27%
西班牙			
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	1,000,000	1,007,430	0.05%
多边国家			
INTL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 4.75% A 21AUG2035	5,000,000	5,004,100	0.27%
瑞典			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	1,003,970	0.05%
阿联酋			
BURGAN SENIOR SPC LTD 4.875% S/A 16OCT2030	900,000	907,614	0.05%
EMIRATES NBD BANK PJSC 2.98% A 11JUL2035	10,000,000	1,429,017	0.08%
英国			
BARCLAYS PLC 5.2% S/A 12MAY2026	2,000,000	2,007,020	0.11%
HSBC BANK PLC 5.5% A 14NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
HSBC BANK PLC 5.5% A 18NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
HSBC BANK PLC 5.5% A 21NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
HSBC BANK PLC 5.75% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
HSBC HLDGS PLC 5.24% S/A 13MAY2031	900,000	928,359	0.05%
HSBC HLDGS PLC 5.79% S/A 13MAY2036	1,000,000	1,058,600	0.06%
HSBC HLDGS PLC 7.05% S/A PERP	3,350,000	3,485,809	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)

2025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			
英国 (续)			
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 5.537% S/A 14JUL2036 REGS	700,000	724,570	0.04%
RIO TINTO FINANCE USA PLC 4.875% S/A 14MAR2030	1,000,000	1,028,100	0.05%
RIO TINTO FINANCE USD PLC S+0.84% Q 14MAR2028	2,500,000	2,520,925	0.13%
美国			
7-ELEVEN INC 0.95% S/A 10FEB2026 REGS	1,000,000	996,580	0.05%
ABBVIE INC 4.65% S/A 15MAR2028	3,500,000	3,559,115	0.19%
ABBVIE INC 4.875% S/A 15MAR2030	2,500,000	2,576,600	0.14%
ALLY FINANCIAL INC 6.646% S/A 17JAN2040	500,000	503,710	0.03%
ALPHABET INC 4.1% S/A 15NOV2030	1,000,000	1,003,760	0.05%
ALPHABET INC 4.375% S/A 15NOV2032	700,000	702,870	0.04%
AMPHENOL CORP 5.3% S/A 15NOV2055	1,000,000	957,270	0.05%
ARES CAPITAL CORP 5.8% S/A 08MAR2032	700,000	707,413	0.04%
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	820,360	0.04%
ARROW ELECTRONICS INC 5.15% S/A 21AUG2029	350,000	358,148	0.02%
ATHENE GLOBAL FUNDING 4.95% S/A 07JAN2027 REGS	3,000,000	3,023,970	0.16%
ATHENE GLOBAL FUNDING 5.526% S/A 07JAN2030	2,500,000	2,560,325	0.14%
ATMOS ENERGY CORP 5.2% S/A 15AUG2035	1,800,000	1,858,698	0.10%
AUTODESK INC 5.3% S/A 15JUN2035	350,000	359,793	0.02%
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 5.316% S/A 06JUN2036	600,000	622,332	0.03%
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	300,000	318,435	0.02%
BOOZ ALLEN HAMILTON INC 5.95% S/A 15APR2035	700,000	727,874	0.04%
BOSTON GAS CO 5.843% S/A 10JAN2035	300,000	318,033	0.02%
BROADCOM INC 4.2% S/A 15OCT2030	1,000,000	998,980	0.05%
BROADCOM INC 4.6% S/A 15JUL2030 REGS	500,000	508,145	0.03%
BROADCOM INC 5.2% S/A 15APR2032	700,000	726,649	0.04%
BROADCOM INC 5.2% S/A 15JUL2035	1,500,000	1,538,145	0.08%
BROWN & BROWN INC 4.6% S/A 23DEC2026	1,000,000	1,005,200	0.05%
BROWN & BROWN INC 4.9% S/A 23JUN2030	500,000	507,175	0.03%
BROWN & BROWN INC 5.25% S/A 23JUN2032	500,000	511,460	0.03%
BROWN & BROWN INC 5.55% S/A 23JUN2035	250,000	256,710	0.01%
BROWN & BROWN INC 6.25% S/A 23JUN2055	250,000	260,335	0.01%
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	500,000	508,420	0.03%
CATERPILLAR INC 5.2% S/A 15MAY2035	1,000,000	1,038,180	0.06%
CBRE SERVICES INC 4.8% S/A 15JUN2030	1,500,000	1,522,275	0.08%
CBRE SERVICES INC 5.5% S/A 15JUN2035	1,500,000	1,551,390	0.08%
CENCORA INC 4.625% S/A 15DEC2027	500,000	506,750	0.03%
CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELECTRIC LLC 4.8% S/A 15MAR2030	500,000	512,830	0.03%
CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.55% S/A 30OCT2035	250,000	256,718	0.01%
CHEVRON USA INC 4.475% S/A 26FEB2028	1,800,000	1,828,512	0.10%
CITADEL LP 6% S/A 23JAN2030 REGS	350,000	365,743	0.02%
CITIBANK NA 4.838% S/A 06AUG2029	1,000,000	1,023,300	0.05%
CITIBANK NA 4.929% S/A 06AUG2026	1,000,000	1,005,280	0.05%
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	1,000,000	1,058,990	0.06%
CITIGROUP INC 4.542% S/A 19SEP2030	2,000,000	2,016,060	0.11%
CITIGROUP INC S+0.87% Q 04MAR2029	738,000	738,531	0.04%
CITIGROUP INC S+1.171% Q 11SEP2031	2,900,000	2,908,265	0.16%
CVS HEALTH CORP 5.45% S/A 15SEP2035	1,000,000	1,025,200	0.05%

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)

2025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 (续)			
CVS HEALTH CORP 7% S/A 10MAR2055	500,000	524,700	0.03%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.95% S/A 13JAN2028	1,800,000	1,825,614	0.10%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.25% S/A 13JAN2030	6,000,000	6,173,400	0.33%
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	550,000	551,139	0.03%
DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 13JAN2032	5,500,000	5,671,545	0.30%
DEERE & CO 5.45% S/A 16JAN2035	700,000	739,137	0.04%
DTE ENERGY CO 5.2% S/A 01APR2030	3,500,000	3,614,520	0.19%
DUKE ENERGY CORP 6.45% S/A 01SEP2054	300,000	314,847	0.02%
EIDP INC 5.125% S/A 15MAY2032	900,000	924,363	0.05%
ELI LILLY & CO 4.75% S/A 12FEB2030	1,600,000	1,644,384	0.09%
ELI LILLY & CO 4.9% S/A 12FEB2032	1,500,000	1,553,640	0.08%
ELI LILLY & CO 5.1% S/A 12FEB2035	1,000,000	1,034,690	0.06%
ENERGY TRANSFER LP 5.2% S/A 01APR2030	500,000	515,520	0.03%
ENERGY TRANSFER LP 6.5% S/A 15FEB2056	900,000	897,300	0.05%
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 5.2% S/A 15JAN2036	500,000	509,460	0.03%
EOG RESOURCES INC 5% S/A 15JUL2032	1,800,000	1,845,432	0.10%
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.875% S/A 07NOV2029	2,000,000	2,053,280	0.11%
GENERAL MOTORS CO 5.35% S/A 15APR2028	1,100,000	1,127,181	0.06%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.9% S/A 06OCT2029	500,000	508,585	0.03%
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.35% S/A 07JAN2030	1,000,000	1,032,320	0.06%
GLENCORE FUNDING LLC 4.907% S/A 01APR2028 REGS	500,000	508,840	0.03%
GLENCORE FUNDING LLC 5.186% S/A 01APR2030 REGS	250,000	256,650	0.01%
GLENCORE FUNDING LLC 5.673% S/A 01APR2035 REGS	1,500,000	1,567,455	0.08%
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.207% S/A 28JAN2031	1,500,000	1,549,725	0.08%
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.536% S/A 28JAN2036	2,400,000	2,494,440	0.13%
GOODMAN US FINANCE FIVE LLC 4.625% S/A 04MAY2032 REGS	1,000,000	992,540	0.05%
GOODMAN US FINANCE SIX LLC 5.125% S/A 07OCT2034 REGS	2,500,000	2,517,000	0.13%
HERSHEY CO 4.55% S/A 24FEB2028	1,000,000	1,016,030	0.05%
HERSHEY CO 4.75% S/A 24FEB2030	1,000,000	1,026,400	0.05%
HP INC 5.4% S/A 25APR2030	2,000,000	2,074,600	0.11%
HP INC 6.1% S/A 25APR2035	1,300,000	1,374,750	0.07%
HPS CORPORATE LENDING FUND 5.45% S/A 14JAN2028	1,500,000	1,516,200	0.08%
HSBC USA INC 3M S+0.97% Q 03JUN2028	1,500,000	1,510,920	0.08%
HYATT HOTELS CORP 5.05% S/A 30MAR2028	1,000,000	1,018,380	0.05%
HYATT HOTELS CORP 5.4% S/A 15DEC2035	1,400,000	1,404,480	0.08%
HYATT HOTELS CORP 5.75% S/A 30MAR2032	1,000,000	1,048,720	0.06%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.875% S/A 23 JUN 2027 REGS	1,500,000	1,516,440	0.08%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.9% S/A 23 JUN 2028 REGS	2,000,000	2,031,740	0.11%

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)

2025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 (续)			
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.1% S/A 24JUN2030 REGS	1,500,000	1,532,475	0.08%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% S/A 23JUN2032 REGS	1,000,000	1,033,000	0.06%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.30% Q 18SEP2030	5,300,000	5,335,563	0.29%
INTEL CORP 5.6% S/A 21FEB2054	1,000,000	925,120	0.05%
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUNDING 5.35% S/A 13JAN2030	5,000,000	5,164,450	0.28%
JBS USA LUX SA/JBS USA FOOD CO/JBS USA FINANCE INC 5.95% S/A 20APR2035 REGS	1,500,000	1,577,715	0.08%
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.65% S/A 07JAN2028	2,000,000	2,035,220	0.11%
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.5% 01MAR2027	1,000,000	1,010,380	0.05%
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.55% 01MAR2028	2,000,000	2,037,020	0.11%
JPMORGAN CHASE & CO 4.505% S/A 22OCTFEB2028	1,000,000	1,010,210	0.05%
JPMORGAN CHASE & CO 4.979% S/A 22JUL2028	500,000	507,620	0.03%
JPMORGAN CHASE & CO 5.012% S/A 23JAN2030	400,000	410,780	0.02%
JPMORGAN CHASE & CO 5.103% S/A 22APR2031	800,000	826,536	0.04%
JPMORGAN CHASE & CO 5.14% S/A 24JAN2031	1,000,000	1,033,780	0.06%
JPMORGAN CHASE & CO 5.502% S/A 24JAN2036	2,000,000	2,094,780	0.11%
JPMORGAN CHASE & CO 5.572% S/A 22APR2036	800,000	840,200	0.04%
JPMORGAN CHASE & CO S+0.8% Q 24JAN2029	1,000,000	1,002,120	0.05%
JPMORGAN CHASE & CO S+0.86% Q 22OCT2028	2,000,000	2,008,800	0.11%
JPMORGAN CHASE BANK 5.8% A 23JAN2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
JPMORGAN CHASE BANK 5.88% A 23JAN2035 (CALLED)	5,000,000	5,000,000	0.27%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.7% A 20FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.8% A 20FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.82% A 19FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
JPMORGAN CHASE BK NA 5.88% A 24FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
KINDER MORGAN INC 5.15% S/A 01JUN2030	500,000	517,280	0.03%
KINDER MORGAN INC 5.85% S/A 01JUN2035	250,000	265,048	0.01%
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.2% S/A 15MAR2032	500,000	514,740	0.03%
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.4% S/A 15MAR2035	500,000	514,365	0.03%
MCKESSON CORP 4.95% S/A 30MAY2032	1,700,000	1,744,047	0.09%
MCKESSON CORP 5.25% S/A 30MAY2035	2,100,000	2,169,888	0.12%
MERCK & CO INC 4.75% S/A 04DEC2035	1,500,000	1,496,220	0.08%
MERCK & CO INC 5.7% S/A 04DEC2065	1,000,000	991,280	0.05%
MERRILL LYNCH BV 5.6% A 26JUN2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
META PLATFORMS INC 4.6% S/A 15NOV2032	900,000	907,974	0.05%
METLIFE INC 6.35% S/A 15MAR2055	1,500,000	1,580,445	0.08%
MICRON TECHNOLOGY INC 5.8% S/A 15JAN2035	300,000	316,296	0.02%
MORGAN STANLEY 4.994% S/A 12APR2029	800,000	815,984	0.04%
ORACLE CORP 4.45% S/A 26SEP2030	1,500,000	1,467,870	0.08%
ORACLE CORP 5.2% S/A 26SEP2035	500,000	480,110	0.03%
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	202,796	0.01%
PACIFICORP 7.375% S/A 15SEP2055	500,000	509,320	0.03%
PAYCHEX INC 5.35% S/A 15APR2032	400,000	414,692	0.02%
PHILIP MORRIS INTL INC 3.875% S/A 27OCT2028	400,000	399,404	0.02%
PHILIP MORRIS INTL INC 4% S/A 29OCT2030	400,000	395,984	0.02%
PHILIP MORRIS INTL INC 4.25% S/A 29OCT2032	400,000	393,652	0.02%
QUALCOMM INC 4.5% S/A 20MAY2030	2,000,000	2,034,760	0.11%
QUALCOMM INC 5% S/A 20MAY2035	1,000,000	1,017,000	0.05%
RALPH LAUREN CORP 5% S/A 15JUN2032	1,000,000	1,027,370	0.05%
RANDE PROPERTY 6.65% S/A 01JUN2055	600,000	613,218	0.03%
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 5.25% S/A 09JAN2030	1,500,000	1,550,895	0.08%

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)

2025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 (续)			
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 6.65% S/A 15SEP2055	400,000	413,516	0.02%
RYDER SYSTEM INC 4.85% S/A 15JUN2030	250,000	254,865	0.01%
SOUTHWEST AIRLINES CO 4.375% S/A 15NOV2028	1,000,000	1,001,800	0.05%
SYSCO CORP 5.1% S/A 23SEP2030	750,000	774,473	0.04%
SYSCO CORP 5.4% S/A 23MAR2035	300,000	311,214	0.02%
T-MOBILE USA INC 5.05% S/A 15JUL2033 REGS	1,000,000	1,021,280	0.05%
T-MOBILE USA INC 5.125% S/A 15MAY2032	1,800,000	1,854,054	0.10%
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.5% S/A 14MAY2027	2,000,000	2,020,160	0.11%
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.8% S/A 15MAY2030	500,000	513,000	0.03%
TRUIST FINANCIAL CORP 5.071% S/A 20MAY2031	2,500,000	2,569,900	0.14%
UNITED PARCEL SERVICE INC 5.25% S/A 14MAY2035	1,000,000	1,037,590	0.06%
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.3% S/A 15JUN2035	250,000	259,020	0.01%
VERISK ANALYTICS INC 4.5% S/A 15AUG2030 (CALLED)	500,000	504,990	0.03%
VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 6% S/A 15FEB2056	1,500,000	1,509,855	0.08%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 3.125% S/A 12MAY2023 REGS	700,000	708,827	0.04%
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	762,548	0.04%
WALMART INC 4.35% S/A 28APR2030	500,000	508,390	0.03%
WALMART INC 4.9% S/A 28APR2035	2,500,000	2,571,350	0.14%
WASTE CONNECTIONS INC 5.25% S/A 01SEP2035	300,000	310,995	0.02%
WELLS FARGO & CO 5.244% S/A 24JAN2031	500,000	517,680	0.03%
WELLS FARGO & CO S+0.78% Q 24JAN2028	1,500,000	1,502,535	0.08%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.6% A 26JUN2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.7% A 22NOV2034	5,000,000	5,000,000	0.27%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.8% A 19FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.9% A 19FEB2035	5,000,000	5,000,000	0.27%
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	300,000	313,815	0.02%
集合投资计划			
香港			
CHINAAMC GLOBAL INVESTMENT GRADE BOND FUND-I DIS USD A	7,669,101	96,431,281	5.17%
CHINAAMC SELECT ASIA BOND FUND-I ACC USD	6,086,339	59,409,967	3.19%
CHINAAMC SELECT OFFSHORE RMB INCOME BOND FUND I USD HEDGED ACC	450,000	4,540,905	0.24%
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	15,088,726	175,302,331	9.39%
卢森堡			
CHINAAMC GLOBAL SELECTED INCOME FUND-I A USD	1,105,879	13,447,484	0.72%

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)

2025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
远期外汇合约			
Buy USD 1,434,149 Sell AUD 2,170,000	-	(15,242)	0.00%
Buy USD 7,146,502 Sell CNY 50,000,000	-	(23,210)	0.00%
Buy USD 4,544,999 Sell CNY 32,000,000	-	(49,302)	0.00%
Buy USD 114,082 Sell CNY 800,000	-	(1,008)	0.00%
Buy USD 37,927,385 Sell CNY 266,000,000	-	(340,036)	-0.02%
Buy USD 1,155,343 Sell EUR 1,000,000	-	(20,139)	0.00%
Buy USD 581,540 Sell EUR 500,000	-	(6,315)	0.00%
Buy USD 2,161,033 Sell EUR 1,838,000	-	(4,721)	0.00%
Buy CNY 3,102,663,530 Sell USD 443,787,756	-	2,952,934	0.16%
Buy CNY 10,000 Sell USD 1,430	-	9	0.00%
总投资组合		1,818,274,657	97.27%
其他资产净值		51,066,795	2.73%
资产净值总额		1,869,341,452	100.00%
投资总额 (按成本计量)		1,772,605,076	

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
7-ELEVEN INC 0.95% S/A 10FEB2026 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	2,280,000	9,991,000	-	-	12,271,000
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	-	-	-	-	-
ABBVIE INC 4.65% S/A 15MAR2028	-	3,500,000	-	-	3,500,000
ABBVIE INC 4.875% S/A 15MAR2030	-	2,500,000	-	-	2,500,000
ABQ FINANCE LTD 2% S/A 25MAR2030	-	2,700,000	-	-	2,700,000
ABBVIE INC 5.4% S/A 15MAR2054	-	-	-	-	-
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC 0.08% S/A PERP	-	-	-	-	-
ABU DHABI DEVELOPMENTAL HOLDING CO PJSC 4.375% S/A 02OCT2031	-	-	-	-	-
ABU DHABI DEVELOPMENTAL HOLDING CO PJSC 5.25% S/A 02OCT2054	500,000	-	-	(500,000)	-
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC/AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 4.875% S/A 01APR2028	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
AES ANDES SA 6.25% S/A 14MAR2032	-	500,000	-	-	500,000
AFFIN BANK BHD 5.112% S/A 04JUN2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
AFRICAN DEVELOPMENT BANK A 5.875% PERP	-	1,800,000	-	-	1,800,000
AIA GROUP LTD 2.7% S/A PERP	1,000,000	20,441,000	-	-	21,441,000
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	500,000	-	-	(500,000)	-
AIA GROUP LTD 5.375% S/A 15APR2034 REGS	-	-	-	-	-
AIA GROUP LTD 5.4% S/A 30SEP2054 REGS	500,000	-	-	(500,000)	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 3.6% S/A 28NOV2024	-	-	-	-	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 4.875% S/A 26MAY2030	-	-	-	-	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 5.25% S/A 26MAY2035	600,000	1,500,000	-	(2,100,000)	-
ALIBABA GROUP HLDG LTD 5.625% S/A 26NOV2054	-	-	-	-	-
ALLIANZ SE 3.2% A PERP	-	10,000,000	-	-	10,000,000
ALLIANZ SE 3.5% A PERP (CALLED)	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
ALLIANZ SE 6.55% A PERP	-	4,000,000	-	-	4,000,000
ALLIANZ SE 5.6% S/A 3SEP2054 REGS	1,400,000	1,600,000	-	-	3,000,000
ALLY FINANCIAL INC 5.543% S/A 17JAN2031	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
ALLY FINANCIAL INC 6.646% S/A 17JAN2040	500,000	-	-	-	500,000
ALPHABET INC 3.875% S/A 15NOV2028	-	700,000	-	(700,000)	-
ALPHABET INC 4% S/A 15MAY2030	-	500,000	-	(500,000)	-
ALPHABET INC 4.1% S/A 15NOV2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
ALPHABET INC 4.375% S/A 15NOV2032	-	700,000	-	-	700,000
ALPHABET INC 4.7% S/A 15NOV2035	-	600,000	-	(600,000)	-
ALPHABET INC 5.25% S/A 15MAY2055	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
ALPHABET INC 5.3% S/A 15MAY2065	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
ALPHABET INC 5.45% S/A 15NOV2055	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ALPHABET INC 5.7% S/A 15NOV2075	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
AMERICA MOVIL SAB DE CV 5% S/A 20JAN2033	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
AMERICAN WATER CAPITAL CORP 5.25% S/A 01MAR2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
AMPHENOL CORP 5.3% S/A 15NOV2055	--	2,200,000	-	(1,200,000)	-
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	50,000	-	-	(50,000)	-
ARES CAPITAL CORP 7% S/A 15JAN2027	800,000	-	-	-	800,000
ARES CAPITAL CORP 5.8% S/A 08MAR2032	-	700,000	-	-	700,000
ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 5.524% A PERP	-	4,930,000	-	-	4,930,000
ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 5.75% A 15AUG2050 (CALLED)	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
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
AT&T INC 5.7% S/A 01NOV2054	-	500,000	-	(500,000)	-
ATHENE GLOBAL FUNDING 4.95% S/A 07JAN2027 REGS	-	5,600,000	-	(2,600,000)	3,000,000
ATHENE GLOBAL FUNDING 5.526% S/A 07JAN2030	-	2,500,000	-	-	2,500,000
ATHENE GLOBAL FUNDING S+0.85% Q 07JAN2027	-	5,600,000	-	(5,600,000)	-

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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息 处置	
ATMOS ENERGY CORP 5.2% S/A 15AUG2035	-	1,800,000	-	1,800,000
AUST & NZ BANK GRP 5.691% S/A 14AUG2040	-	500,000	(500,000)	-
AUST & NZ BANK GRP 6.171% S/A 14AUG2045	-	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 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	-	-	-	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.57% S/A 25NOV2035 REGS	-	2,000,000	-	2,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 5.816% S/A 18JUN2036	-	1,400,000	(1,400,000)-	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD NEW YORK 4.362% S/A 18JUN2028	-	1,200,000	(1,200,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.59% Q 08DEC2028 REGS	-	2,000,000	-	2,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.62% Q 18JUN2028 REGS	-	1,200,000	-	1,200,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.68% Q 08DEC2030 REGS	-	4,000,000	-	4,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/NEW YORK 3.919% S/A 08DEC2028	-	500,000	-	500,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UK 6.75% S/A PERP REGS	-	7,000,000	-	7,000,000
AUTODESK INC 5.3% S/A 15JUN2035	-	350,000	-	350,000
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 4.9% S/A 10OCT2030	-	2,300,000	(2,300,000)	-
AXIS BANK LTD/GIFT CITY 4.1% S/A PERP REGS	-	2,000,000	-	2,000,000
BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2% S/A 16MAR2024	-	-	-	-
BAIDU INC 3.075% S/A 07APR2025	200,000	-	-	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 6.5% Q PERP (CALLED)	-	5,000,000	(5,000,000)	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 7.75% Q PERP	-	1,800,000	(1,800,000)	-
ATMOS ENERGY CORP 5.2% S/A 15AUG2035	-	1,800,000	-	1,800,000
AUST & NZ BANK GRP 5.691% S/A 14AUG2040	-	500,000	(500,000)	-
AUST & NZ BANK GRP 6.171% S/A 14AUG2045	-	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 S+0.85% Q 16DEC2029 REGS	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/NEW YORK 3.919% S/A 30SEP2027	-	-	-	-	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 2.57% S/A 25NOV2035 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 5.816% S/A 18JUN2036	-	1,400,000	-	(1,400,000)-	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD NEW YORK 4.362% S/A 18JUN2028	-	1,200,000	-	(1,200,000)	-
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.59% Q 08DEC2028 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.62% Q 18JUN2028 REGS	-	1,200,000	-	-	1,200,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD S+0.68% Q 08DEC2030 REGS	-	4,000,000	-	-	4,000,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/NEW YORK 3.919% S/A 08DEC2028	-	500,000	-	-	500,000
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UK 6.75% S/A PERP REGS	-	7,000,000	-	-	7,000,000
AUTODESK INC 5.3% S/A 15JUN2035	-	350,000	-	-	350,000
AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 4.9% S/A 10OCT2030	-	2,300,000	-	(2,300,000)	-
AXIS BANK LTD/GIFT CITY 4.1% S/A PERP REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2% S/A 16MAR2024	-	-	-	-	-
BAIDU INC 3.075% S/A 07APR2025	200,000	-	-	-	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 6.5% Q PERP (CALLED)	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 7.75% Q PERP	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
BANCO DE CREDITO DEL PERU 6.45% S/A 30JUL2035 REGS	-	1,800,000	-	-	1,800,000
BANCO SANTANDER MEXICO SA 5.621% S/A 10DEC2029 REGS	900,000	-	-	-	900,000
BANCO SANTANDER SA 5.365% S/A 15JUL2028	1,000,000	-	-	-	1,000,000
BANCO SANTANDER SA 5.439% S/A 15JUL2031	1,000,000	-	-	-	1,000,000
BANCO SANTANDER SA 4.551% S/A 06NOV2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
BANCO SANTANDER SA 4.75% Q PERP	-	4,400,000	-	-	4,400,000
BANCO SANTANDER SA 5.127% S/A 06NOV2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANCO SANTANDER SA 5.565% S/A 17JAN2030	-	3,400,000	-	-	3,400,000
BANCO SANTANDER SA S+1.38% Q 14MAR2028	1,000,000	-	-	-	(1,000,000)
BANGKOK BANK PCL 3.466% S/A 23SEP2036 REGS	-	500,000	-	-	500,000
BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 3.733% S/A 25SEP2034 REGS	-	3,159,000	-	-	3,159,000
BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 6.056% S/A 25MAR2040 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
BANGKOK BANK PLC/HONG KONG 5% S/A PERP REGS	-	7,182,000	-	(7,182,000)	-
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 4.9% S/A 24MAR2028	-	1,150,000	-	(1,150,000)	-
BANK OF AMERICA CORP 6.25% Q PERP	-	500,000	-	(500,000)	-
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD 3.8% A PERP (CALLED)	-	6,000,000	-	(6,000,000)	-
BANK OF COMMUNICATIONS HONG KONG LTD 2.304% S/A 08JUL2031	-	10,000,000	-	-	10,000,000
BANK OF EAST ASIA LTD 4% S/A 29MAY2030	3,000,000	5,000,000	-	(8,000,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 4.875% S/A 22APR2032	520,000	6,244,000	-	-	6,764,000
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 15MAR2027	-	4,361,000	-	-	4,361,000
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	5,900,000	11,866,000	-	(17,766,000)	-
BANK OF EAST ASIA LTD 6.625% S/A 13MAR2027	1,500,000	5,450,000	-	-	6,950,000
BANK OF EAST ASIA LTD 6.75% S/A 27JUN2034	200,000	8,250,000	-	-	8,450,000
BANK OF MONTREAL 4.8% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
BANK OF MONTREAL 6.875 Q 26NOV2085	-	10,000,000	-	(4,000,000)	6,000,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
BANK OF NEW YORK MELLON 4.587% S/A 20APR2027	-	1,000,000	-	1,000,000
BANK OF NEW YORK MELLON 4.729% S/A 20APR2029	-	1,000,000	-	1,000,000
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 4.441% S/A 09JUN2028	-	2,000,000	(2,000,000)	-
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 5.316% S/A 06JUN2036	-	600,000	-	600,000
BANK OF NEW YORK MELLON CORP 6.3% S/A PERP	-	700,000	(700,000)	-
BANK OF NEW ZEALAND 2.87% S/A 27JAN2032 REGS	500,000	-	-	500,000
BANK OF NEW ZEALAND 5.698% S/A 28JAN2035 REGS	-	3,000,000	-	3,000,000
BANK OF NOVA SCOTIA 3M TS+2.90961% Q PERP	900,000	-	-	900,000
BARCLAYS PLC 4.375% Q PERP	-	3,000,000	-	3,000,000
BARCLAYS PLC 4.47% S/A 11NOV2029	-	800,000	(800,000)	-
BARCLAYS PLC 5.086% S/A 25FEB2029	-	500,000	(500,000)	-
BARCLAYS PLC 5.2% S/A 12MAY2026	-	2,000,000	-	2,000,000
BARCLAYS PLC 5.367% S/A 25FEB2031	-	1,000,000	(1,000,000)	-
BARCLAYS PLC 5.86% S/A 11AUG2046	-	1,000,000	(1,000,000)	-
BARCLAYS PLC 7.625% Q PERP	-	1,700,000	(1,700,000)	-
BARCLAYS PLC S+1.01% Q 11NOV2029	-	800,000	-	800,000
BARCLAYS PLC 6.125% Q PERP	1,000,000	13,100,000	(14,100,000)	-
BARCLAYS PLC 8% Q PERP (CALLED)	-	-	-	-
BAT CAPITAL CORP 5.834% S/A 20FEB2031	300,000	-	-	300,000
BBVA BANCOMER SA/TEXAS 7.625% S/A 11FEB2035 REGS	-	200,000	-	200,000
BECTON DICKINSON AND CO 5.11% S/A 08FEB2034	-	-	-	-
BHP BILLITON FINANCE USA LIMITED 5% S/A 15FEB2036	-	1,000,000	-	1,000,000
BHP BILLITON FINANCE USA LIMITED 5.75% S/A 05SEP2055	-	600,000	-	600,000
BK OF NOVA SCOTIA 3.625% Q 27OCT2081	-	5,000,000	-	5,000,000
BLOSSOM JOY LTD 2.2% S/A 21OCT2030	-	1,000,000	-	1,000,000
BLOSSOM JOY LTD 3.1% S/A PERP (CALLED)	-	16,004,000	(16,004,000)	-
BMW US CAPITAL LLC S+0.78% Q 19MAR2027 REGS	-	1,000,000	(1,000,000)	-
BMW US CAPITAL LLC S+0.78% Q 19MAR2027 REGS	-	1,000,000	(1,000,000)	-
BMW US CAPITAL LLC 4.75% S/A 21MAR2028	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
BMW US CAPITAL LLC 5.05% S/A 21MAR2030 REGS	-	500,000	(500,000)	-
BMW US CAPITAL LLC S+0.92% Q 21MAR2028 REGS	-	1,000,000	(1,000,000)	-
BNP PARIBAS SA 3.6% A 17AUG2031 BNP PARIBAS SA 4.625% S/A PERP REGS	- 200,000	100,000,000 -	- -	100,000,000 200,000
BNP PARIBAS SA 5.176% S/A 09JAN2030 REGS	-	3,000,000	-	3,000,000
BNP PARIBAS SA 5.894% S/A 05DEC2034 REGS	500,000	-	(500,000)	-
BNP PARIBAS SA 6.625% S/A PERP REGS (CALLED)	-	-	-	-
BNP PARIBAS SA 5.786% S/A 13JAN2033 REGS	-	7,000,000	-	7,000,000
BNP PARIBAS SA 6.875% S/A PERPETUAL	-	1,000,000	-	1,000,000
BNP PARIBAS SA 7.375% S/A PERP REGS (CALLED)	-	11,200,000	-	-
BNP PARIBAS SA 7.45% S/A PERPETUAL REGS	-	900,000	-	900,000
BNP PARIBAS SA 8.5% S/A PERP REGS	-	1,000,000	-	1,000,000
BP CAPITAL MARKETS PLC 6.45% S/A PERP	750,000	-	(750,000)	-
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	-	7,408,000	-	-
BOC AVIATION LTD 4.25% S/A 04MAR2031 REGS	-	2,000,000	-	-
BOC AVIATION USA CORP 4.75% S/A 14JAN2028	-	2,500,000	-	2,500,000
BOOZ ALLEN HAMILTON INC 5.95% S/A 15APR2035	-	700,000	-	700,000
BOSTON GAS CO 5.843% S/A 10JAN2035	-	300,000	-	300,000
BP CAPITAL MARKETS PLC 4.375% S/A PERP (CALLED)	-	6,580,000	(6,580,000)	-
BRAZILIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.625% S/A 15MAR2035	-	1,050,000	-	-
BRIGHT FOOD SINGAPORE HLDGS PTE CO LTD 3.25% A 09JUL2030	-	1,000,000	-	1,000,000
BROADCOM INC 4.2% S/A 15OCT2030	-	1,000,000	-	1,000,000
BROADCOM INC 4.6% S/A 15JUL2030 REGS	-	500,000	-	500,000
BROADCOM INC 4.8% S/A 15APR2028	-	1,300,000	-	-
BROADCOM INC 5.05% S/A 15APR2030	-	700,000	-	-
BROADCOM INC 5.2% S/A 15APR2032	-	700,000	-	700,000
BROADCOM INC 5.2% S/A 15JUL2035	-	1,500,000	-	1,500,000
BROWN & BROWN INC 4.6% S/A 23DEC2026	-	1,000,000	-	1,000,000
BROWN & BROWN INC 4.9% S/A 23JUN2030	-	500,000	-	500,000
BROWN & BROWN INC 5.25% S/A 23JUN2032	-	500,000	-	500,000
BROWN & BROWN INC 5.55% S/A 23JUN2035	-	250,000	-	250,000
BROWN & BROWN INC 6.25% S/A 23JUN2055	-	250,000	-	250,000
BSF FINANCE 5.761% 03SEP2035	-	5,000,000	-	3,600,000
BURGAN SENIOR SPC LTD 4.875% S/A 16OCT2030	-	900,000	-	900,000
CAIXA ECONOMICA FEDERAL 5.625% S/A 13MAY2030 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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
CAIXABANK SA 4.634% S/A 03JUL2029	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CAIXABANK SA 4.885% S/A 03JUL2031	-	2,100,000	-	(2,100,000)	-
CAIXABANK SA 5.581% S/A 03JUL2036	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 4.862% S/A 13JAN2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.245% S/A 13JAN2031	-	2,000,000	-	-	2,000,000
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE S+0.72% Q 13JAN2028	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
CAS CAPITAL NO 1 LTD 4% S/A PERP	-	2,588,000	-	(2,588,000)	-
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 5% S/A 14MAY2027	500,000	-	-	-	500,000
CATERPILLAR INC 5.2% S/A 15MAY2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
CATHAYLIFE SINGAPORE PTE LTD 5.95% S/A 05JUL2034	900,000	-	-	-	900,000
CBRE SERVICES INC 4.8% S/A 15JUN2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000
CBRE SERVICES INC 5.5% S/A 15JUN2035	-	1,500,000	-	-	1,500,000
CDBL FUNDING 1 4.75% S/A 27MAY2030	-	3,800,000	-	(2,800,000)	1,000,000
CELESTIAL DYNASTY LTD 6.375% S/A 22AUG2029	-	2,520,000	-	-	2,520,000
CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELECTRIC LLC 4.8% S/A 15MAR2030	-	500,000	-	-	500,000
CENTRAL PLAZA DEVELOPMENT LTD 7.15% S/A 21MAR2028	-	550,000	-	-	550,000
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
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 6.8% S/A 25JUN2027	-	5,000,000	-	-	5,000,000
CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 4.375% S/A 21DEC2027	-	5,700,000	-	-	5,700,000
CHENGDU INLAND PORT HUB 4.9% S/A 20AUG2028 REGS	-	4,000,000	-	-	4,000,000
CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.55% S/A 30OCT2035	-	250,000	-	-	250,000
CHEVRON CORP 4.687% S/A 15APR2030	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
CHEVRON CORP 4.98% S/A 15APR2035	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
CHEVRON USA INC 4.405% S/A 26FEB2027	-	2,800,000	-	(2,800,000)	-
CHEVRON USA INC 4.475% S/A 26FEB2028	-	1,800,000	-	-	1,800,000
CHEVRON USA INC 4.819% S/A 15APR2032	-	7,000,000	-	(7,000,000)	-
CHILE ELECTRICITY LUX 5.672% S/A 20OCT2035 REGS	-	514,565	-	(14,565)	500,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.875% S/A 20JAN2026	-	3,639,000	-	-	3,639,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 2.5% S/A 18MAR2025	-	650,000	-	(650,000)	-
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 2.58% S/A 25JUN2028	-	20,000,000	-	-	20,000,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 3.25% S/A 28JAN2027	-	10,000,000	-	-	10,000,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 4.375% S/A 13NOV2028	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息 处置	
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD S+1% Q 13NOV2030	-	600,000	-	600,000
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 5.75% S/A 28MAY2029	1,000,000	-	-	1,000,000
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.75% S/A 21FEB2029	-	1,000,000	-	1,000,000
CHINA CINDA FINANCE 2015 I LTD 4.25% S/A 23APR2025 REGS	2,150,000	11,482,000	(13,632,000)	-
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.375% S/A 08FEB2025	1,500,000	395,000	(1,895,000)	-
CHINA CITIC BANK INTL LTD 6% S/A 05DEC2023	880,000	5,450,000	-	6,330,000
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 5% A 17JAN2025 FXCD	4,000,000	-	(4,000,000)	-
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.45% S/A 24JUN2030 (CALLED)	-	12,739,000	(12,739,000)	-
CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 2.875% S/A 28SEP2030 (CALLED)	-	17,392,000	(17,392,000)	-
CHINA GEZHOUBA OVERSEAS INVESTMENT CO LTD 4.15% S/A PERP (called)	-	5,700,000	(5,700,000)	-
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.375% A 25NOV2029	-	500,000	-	500,000
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 2.625% A 25NOV2032	-	500,000	-	500,000
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 3.625% S/A 13NOV2028	-	2,000,000	(2,000,000)	-
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 3.75% S/A 13NOV2030	-	400,000	(400,000)	-
CHINA GOVT BOND 1.43% S/A 23JUL2027 REGS	-	50,000,000	(50,000,000)	-
CHINA GOVT BOND 1.55% S/A 23JUI2030 REGS	-	40,000,000	(40,000,000)	-
CHINA GOVT BOND 1.72% S/A 23JUL2035 REGS	-	20,000,000	(20,000,000)	-
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	2,000,000	-	-	2,000,000
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS VI LTD 6.375% S/A 02JAN2028	-	3,100,000	-	3,100,000
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	-	-	-
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.925% S/A 29NOV2028	-	1,000,000	-	1,500,000
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.05% S/A 10JAN2028	-	2,400,000	-	2,400,000
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.75% S/A 27MAR2025	700,000	29,116,000	(29,816,000)	-
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDGS LTD 4.15% S/A PERP	-	400,000	(400,000)	-
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 5.35% S/A 15AUG2033	1,000,000	4,500,000	-	5,500,000
CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD 2.3% S/A 30JUL2035	-	1,600,000	-	1,600,000
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 2.125% S/A 14JUL2026	-	7,200,000	-	7,200,000

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VI LTD 5.95% S/A 08MAY2024	-	-	-	-	-
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.375% S/A 02MAR2025	500,000	-	-	(500,000)	-
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 5% S/A 08OCT2035	-	3,000,000	-	-	3,000,000
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 5% S/A 08OCT2035	-	484,000	-	-	484,000
CHINA RESOURCES LAND LTD 2.4% S/A 20NOV2030	-	18,100,000	-	-	18,100,000
CHINA RESOURCES LAND LTD 4.125% S/A 20NOV2028	-	4,600,000	-	-	4,600,000
CHINA RESOURCES LAND LTD 6% S/A 27FEB2024	-	-	-	-	-
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)	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-
CHIYU BANKING CORP LTD 8% S/A PERP	500,000	-	-	-	-
CHONG HING BANK LTD 5.5% S/A PERP (CALLED)	-	3,553,000	-	(3,553,000)	-
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4% S/A 18FEB2025	9,740,000	22,205,000	-	(31,945,000)	-
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4.8% S/A 15JAN2028	-	600,000	-	-	600,000
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.5% S/A 06AUG2030	-	6,000,000	-	-	6,000,000
CHUBB INA HOLDINGS LLC 2.75% S/A 06AUG2035	-	4,000,000	-	-	4,000,000
CHUBB INA HOLDINGS LLC 3.05% S/A 06AUG2055	-	4,000,000	-	-	4,000,000
CHUGOKU ELECTRIC POWER CO INC 5.742% S/A 14JAN2035	-	700,000	-	-	700,000
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD S+0.95% Q 18JAN2027	-	4,400,000	-	(4,400,000)	-
CIGNA GROUP/THE 5.25% S/A 15JAN2036	-	7,000,000	-	(7,000,000)	-
CIGNA GROUP/THE 6% S/A 15JAN2056	-	1,800,000	-	-	1,800,000
CITADEL LP 6% S/A 23JAN2030 REGS	-	700,000	-	(350,000)	350,000
CITIBANK NA 4.838% S/A 06AUG2029	1,000,000	-	-	-	1,000,000
CITIBANK NA 4.876% S/A 19NOV2027	-	-	-	-	-
CITIBANK NA 4.929% S/A 06AUG2026	1,000,000	-	-	-	1,000,000
CITIBANK NA 5.438% S/A 30APR2026	-	-	-	-	-
CITIBANK NA 5.57% S/A 30APR2034	1,000,000	-	-	-	1,000,000
CITIGROUP INC 6.625% Q PERPETUAL	-	900,000	-	(900,000)	-
CITIGROUP INC 6.95% Q PERPETUAL	-	2,400,000	-	(2,400,000)	-
CITIGROUP INC S+0.87% Q 04MAR2029	-	738,000	-	-	738,000
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 S+1.171% Q 11SEP2031	-	2,900,000	-	-	2,900,000
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 5.718% S/A 23JUL2032	1,300,000	-	-	-	-

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
CK HUTCHISON INTL 25 LTD 4.25% S/A 26SEP2030	-	2,800,000	-	(800,000)	2,000,000
CLOVERIE PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 5.625% A 24JUN2046	-	5,400,000	-	-	5,400,000
CLP POWER HK 5.45% S/A PERP	-	10,000,000	-	(10,000,000)	-
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	1,700,000	-	-	(1,700,000)	-
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 2% S/A 22SEP2025	-	7,118,000	-	(7,118,000)	-
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	-	3,000,000	-	-	3,000,000
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% S/A 14MAR2025	-	1,100,000	-	-	1,100,000
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	-	3,000,000	-	-	3,000,000
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% S/A 14MAR2025	15,000,000	2,082,000	-	(17,082,000)	-
CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 3.5% S/A 05MAY2025	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
COASTAL EMERALD LTD 4.1% S/A 15JUN2022	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
COASTAL EMERALD LTD 6.5% S/A PERP	2,000,000	-	-	-	2,000,000
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 4.608% S/A 14MAR2030 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 5.929% S/A 14MAR2046	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.64% Q 14MAR2028 REGS	-	800,000	800,000	-
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 4.608% S/A 14MAR2030 REGS	-	2,000,000	(2,000,000)	-
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.78% Q 01OCT2030 REGS	-	600,000	-	600,000
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 4.15% S/A 01OCT2030	-	2,500,000	-	2,500,000
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 4.423% S/A 14MAR2028	-	500,000	-	500,000
COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.45% S/A 24JAN2035	900,000	-	-	900,000
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 1.875% S/A 17SEP2025	-	7,300,000	(7,300,000)	-
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 2.625% S/A 17SEP2030	-	910,000	-	910,000
CORP ANDINA DE FOMENTO 6.75% S/A PERP	-	400,000	-	400,000
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.33% S/A 13JAN2035 REGS	-	250,000	-	250,000
CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 6.44% S/A 26JAN2036 REGS	750,000	-	-	750,000
CREDIT AGRICOLE SA 4.75% Q PERP REGS	-	2,850,000	-	2,850,000
CREDIT AGRICOLE SA 4.818% S/A 25SEP2033	-	2,500,000	-	2,500,000
CREDIT AGRICOLE SA 5.222% S/A 27MAY2031	-	1,500,000	-	1,500,000
CREDIT AGRICOLE SA 5.23% S/A 09JAN2029	-	2,100,000	-	2,100,000
CREDIT AGRICOLE SA 5.862% S/A 09JAN2036	-	4,000,000	(2,000,000)	2,000,000
CREDIT AGRICOLE SA 7.125% S/A PERPETUAL	-	5,250,000	(1,500,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA 8.125% Q PERP REGS (CALLED)	-	24,820,000	(24,820,000)	-
CREDIT AGRICOLE SA S+1.13% Q 09JAN2029 REGS	-	2,100,000	-	2,100,000
CRH SMW FINANCE DAC 5.125% S/A 09JAN2030	-	500,000	-	500,000
CSL FINANCE PLC 4.25% S/A 27APR2032	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
CSL FINANCE PLC 4.75% S/A 27APR2052	-	1,280,000	-	1,280,000
CSX CORP 5.05% S/A 15JUN2035	-	1,000,000	(1,000,000)	-
CVS HEALTH CORP 5.45% S/A 15SEP2035	-	1,000,000	-	1,000,000
CVS HEALTH CORP 6.2% S/A 15SEP2055	-	350,000	(350,000)	-
CVS HEALTH CORP 7% S/A 10MAR2055	500,000	-	-	500,000
DAE SUKUK DIFC LTD 4.5% S/A 16OCT2030 REGS	-	600,000	-	600,000
DAH SING BANK LTD 3% S/A 02NOV2031	-	4,460,000	-	4,460,000
DAH SING BANK LTD 7.375% S/A 15NOV2033	1,500,000	11,450,000	(1,000,000)	11,950,000
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 4% S/A PERP REGS	-	17,506,000	-	17,506,000
DAI-ICHI LIFE INSURANCE CO LTD 6.2% S/A PERP REGS	-	2,200,000	(2,200,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 4.95% S/A 13JAN2028	-	1,800,000	-	1,800,000
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.25% S/A 13JAN2030	-	6,000,000	-	6,000,000
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.84% Q 13JAN2028	-	1,800,000	(1,800,000)	-
DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC S+0.96% Q 25SEP2027	550,000	-	-	-
DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.375% S/A 13JAN2032	-	7,500,000	(2,000,000)	5,500,000
DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERICA LLC 5.625% S/A 13JAN2035	-	7,500,000	(7,500,000)	-
DANSKE BANK A/S 7% S/A PERP (CALLED)	-	15,000,000	(15,000,000)	-
DBS GROUP HLDGS LTD 3.3% S/A PERP (CALLED)	-	11,411,000	(11,411,000)	-
DEERE & CO 5.45% S/A 16JAN2035	-	700,000	-	700,000
DEERE & CO 5.7% S/A 19JAN2055	-	500,000	(500,000)	-
DELL INTL LLC/EMC CORP 4.75% S/A 06OCT2032	-	1,000,000	-	1,000,000
DELL INTL LLC/EMC CORP 5.1% S/A 15FEB3036	-	1,000,000	(1,000,000)	-
DEMETER INVESTMENTS BV FOR SWISS RE LTD 5.625% A 15AUG2052	-	1,100,000	-	1,100,000
DENSO CORP 4.282% S/A 17SEP2030 REGS	-	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
DEUTSCHE BANK AG 6.25% A PERP	2,000,000	1,000,000	-	(3,000,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 3M S+1.21% Q 10JAN2029	-	6,000,000	-	(6,000,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 4.95% S/A 04AUG2031	-	800,000	-	(800,000)	-
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.414% S/A 10MAY2029	500,000	-	-	-	500,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 5.353% S/A 10JAN2029	-	3,900,000	-	-	3,900,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK 6.819% S/A 20NOV2029	1,000,000	-	-	-	1,000,000
DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK S+1.3% Q 04AUG2031	-	1,800,000	-	(1,800,000)	-
DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN JSC 3.5% A 01SEP2028	-	4,000,000	-	-	4,000,000
DP WORLD SALAAM 6% S/A PERP (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
DTE ENERGY CO 5.2% S/A 01APR2030	-	3,500,000	-	-	3,500,000
DUKE ENERGY CORP 6.45% S/A 01SEP2054	300,000	-	-	-	300,000
EIDP INC 5.125% S/A 15MAY2032	-	900,000	-	-	900,000
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.1% S/A PERP	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 7.2% S/A PERP	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE S/A 6.627% S/A 28AUG2045	-	250,000	--	(250,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.636% S/A 28AUG2035	-	500,000	-	(500,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 5.75% S/A 13JAN2035	-	1,500,000	-	-	1,500,000
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6% S/A 22APR2064	-	500,000	-	(500,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6% S/A 22APR2064 (CALLED)	-	500,000	-	(500,000)	-
ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.375% S/A 13JAN2055	-	1,000,000	-	-	1,000,000
ELI LILLY & CO 4.55% S/A 12FEB2028	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
ELI LILLY & CO 4.75% S/A 12FEB2030	-	3,300,000	-	(1,700,000)	1,600,000
ELI LILLY & CO 4.9% S/A 12FEB2032	-	3,000,000	-	(1,500,000)	1,500,000
ELI LILLY & CO 5.1% S/A 12FEB2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
ELI LILLY & CO 5.1% S/A 12FEB2065	-	700,000	-	(700,000)	-
ELI LILLY & CO 5.5% S/A 12FEB2055	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息 处置	
EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.98% S/A 11FEB2035	-	200,000	-	200,000
EMIRATES NBD BANK PJSC 2.98% A 11JUL2035	-	10,000,000	-	10,000,000
EMIRATES NBD BANK PJSC 5.141% S/A 26NOV2029	900,000	-	-	900,000
ENBRIDGE INC 4.6% S/A 20JUN2028	-	300,000	-	300,000
ENBRIDGE INC 4.9% S/A 20 JUN 2030	-	200,000	-	200,000
ENBRIDGE INC 5.55% S/A 20 JUN 2035	-	300,000	-	300,000
ENBRIDGE INC 5.95% S/A 05APR2054	-	500,000	-	500,000
ENBRIDGE INC 6% S/A 15NOV2028	-	2,000,000	-	2,000,000
ENERGY TRANSFER LP 5.2% S/A 01APR2030	-	500,000	-	500,000
ENERGY TRANSFER LP 6.5% S/A 15FEB2056	-	900,000	-	900,000
ENN ENERGY HLDGS LTD 4.625% S/A 17MAY2027 REGS	-	1,847,000	-	1,847,000
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.6% S/A 15JAN2031	-	500,000	-	(500,000)
ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 5.2% S/A 15JAN2036	-	500,000	-	500,000
EOG RESOURCES INC 4.4% S/A 15JUL2028	-	700,000	-	(700,000)
EOG RESOURCES INC 5% S/A 15JUL2032	-	1,800,000	-	1,800,000
EOG RESOURCES INC 5.35% S/A 15JAN2036	-	1,500,000	-	(1,500,000)
EOG RESOURCES INC 5.95% S/A 15JUL2055	-	700,000	-	(700,000)
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD 5.75% S/A 20MAY2035	-	6,600,000	-	(3,300,000)
FAR EAST HORIZON LTD 3.375% S/A 18FEB2025	5,861,000	2,000,000	-	(7,861,000)
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 26OCT2026	4,100,000	4,877,000	-	8,977,000
FAR EAST HORIZON LTD 4.25% S/A 14FEB2028	-	30,000,000	-	30,000,000
FAR EAST HORIZON LTD 6.625% S/A 16APR2027	3,000,000	8,500,000	-	11,500,000
FAR EAST HORIZON LTD 5.875% S/A 5MAR2028	-	3,257,000	-	3,257,000
FAR EAST HORIZON LTD 6% S/A 01OCT2028	-	6,435,000	-	6,435,000
FED REPUBLIC OF BRAZIL 5.5% S/A 06NOV2030	-	500,000	-	500,000
FORD MOTOR CO 5.125% S/A 16JUN2026	-	1,000,000	-	(1,000,000)
FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.875% S/A 07NOV2029	-	3,500,000	-	(1,500,000)
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	2,000,000	-	2,750,000
FORTUNE STAR BVI LTD 5.95% S/A 19OCT2025	2,000,000	4,100,000	-	(6,100,000)
FORTUNE STAR BVI LTD 6.8% S/A 09SEP2029	-	1,300,000	-	1,300,000
FORTUNE STAR BVI LTD 8.5% S/A 19MAY2028	1,000,000	-	-	1,000,000
FUBON LIFE SINGAPORE PTE LTD 5.45% 10DEC2035	-	200,000	-	(200,000)
FUJIAN ZHANGLONG GROUP CO LTD 4.8% S/A 20JUN2025	-	2,600,000	-	(2,600,000)

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
FWD GROUP HOLDINGS LTD 5.836% S/A 22SEP2035	-	2,000,000	-	-	2,000,000
FWD GROUP HOLDINGS LTD 8.4% S/A 5APR2029	-	3,634,000	-	(3,634,000)	-
FWD GROUP LTD 5.252% S/A 22SEP2030	-	4,000,000	-	-	4,000,000
FWD GROUP LTD 7.635% S/A 02JUL2031	1,500,000	1,000,000	-	-	2,500,000
GACI FIRST INVESTMENT CO 5% S/A 15SEP2035	-	2,350,000	-	(2,350,000)	-
GANSU PROVINCIAL HIGHWAY AVIATION TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 3.9% S/A 27SEP2026	-	8,200,000	-	(6,200,000)	5,000,000
GANZHOU TOURISM INVESTMENT GROUP CO LTD 2.85% S/A 19 AUG2028	-	5,000,000	-	-	-
GANZHOU URBAN INVESTMENT HLDG GROUP CO LTD 6% S/A 14SEP2025	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
GC TREASURY CENTER CO LTD 6.5% S/A PERP REGS	-	4,300,000	-	(4,300,000)	-
GC TREASURY CENTER CO LTD 7.125% S/A PERP REGS	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
GEELY FINANCE HONG KONG LTD 3% S/A 05MAR2025	-	13,800,000	-	(13,800,000)	-
GENERAL MOTORS CO 5.35% S/A 15APR2028	-	1,100,000	-	-	1,100,000
GENERAL MOTORS CO 5.625% S/A 15APR2030	-	1,200,000	-	(700,000)	500,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.9% S/A 06OCT2029	500,000	-	-	-	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5% S/A 15JUL2027	-	1,500,000	-	-	1,500,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.35% S/A 07JAN2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.45% S/A 15JUL2030	-	2,250,000	-	-	2,250,000
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.8% S/A 07JAN2029	-	1,500,000	-	-	1,500,000

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.9% S/A 07JAN2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC S+1.29% Q 07JAN2030	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
GEORGIA POWER CO 4.85% S/A 15MAR2031	-	500,000	-	(500,000)	-
GILDAN ACTIVEWEAR INC 4.7% S/A 7OCT2030	-	400,000	-	-	400,000
GILDAN ACTIVEWEAR INC 5.4% S/A 7OCT2035	-	400,000	-	-	400,000
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 3M S+0.5% Q 12MAR2027	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 4.315% S/A 12MAR2027	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 4.5% S/A 15APR2030	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 4.875% S/A 15APR2035	-	700,000	-	(700,000)	-
GLENCORE FUNDING LLC 4.907% S/A 01APR2028 REGS	-	500,000	-	-	500,000
GLENCORE FUNDING LLC 5.186% S/A 01APR2030 REGS	-	250,000	-	-	250,000
GLENCORE FUNDING LLC 5.673% S/A 01APR2035 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.692% S/A 23OCT2030	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.207% S/A 28JAN2031	-	1,500,000	-	-	1,500,000
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.536% S/A 28JAN2036	-	2,400,000	-	-	2,400,000
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.734% S/A 28JAN2056	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
GOLDMAN SACHS GROUP INC S+1.08% Q 28JAN2031	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
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	-	-	-	2,500,000
GREAT EASTERN LIFE ASSURANCE CO LTD/THE 5.398% S/A PERP	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 7.25% S/A 27SEP2028 REGS	-	1,100,000	-	-	1,100,000
GREENTOWN CHINA HLDGS LTD 4.7% S/A 29APR2025	-	250,000	-	(250,000)	-
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)	-
GS CALTEX CORP 4.25% S/A 28OCT2030	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT HLDG GROUP CO LTD 2.85% S/A 19JAN2027	-	400,000	-	400,000
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT HLDG GROUP CO LTD 4.4% S/A 28NOV2027	-	4,500,000	-	4,500,000
GUANGZHOU DEVELOPMENT DISTRICT INVESTMENT GROUP CO 4.5% S/A 28JUL2025	-	3,000,000	(3,000,000)	-
HAIDILAO INTL HLDG LTD 2.15% S/A 14JAN2026	-	700,000	-	700,000
HAITONG INTL FINANCE HLDGS 2015 LTD 2.107% S/A 12MAR2025	5,200,000	10,000,000	(15,200,000)	-
HALCYON AGRI CORP LTD 3.8% S/A PERP (CALLED)	-	3,400,000	(3,400,000)	-
HANA BANK 3.5% S/A PERP REGS HANA BANK 5.75% S/A 24OCT2028 REGS	500,000	-	-	500,000
HANA SECURITIES CO LTD 5% S/A 30APR2028	-	1,900,000	-	1,900,000
HANWHA ENERGY USA HLDGS CORP 4.375% S/A 02JUL2028 REGS	-	1,200,000	(1,200,000)	-
HANWHA FUTUREPROOF CORP 4.75% S/A 30APR2028 (EXCHANGED)	-	500,000	-	500,000
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 3.379% S/A 04FEB2032 REGS	-	1,000,000	-	1,000,000
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 6.3% S/A 24JUN2055	-	4,100,000	-	4,100,000
HARBOUR ENERGY PLC 6.327% S/A 01APR2035	-	1,350,000	(1,350,000)	-
HCA INC 4.3% S/A 15NOV2030 HCA INC 4.9% S/A 15NOV2035	-	300,000	(400,000)	300,000
HCA INC 5% S/A 01MAR2028	-	1,000,000	-	1,000,000
HCA INC 5.25% S/A 01MAR2030 HENAN RAILWAY CONSTRUCTION & INVESTMENT GROUP 2.2% S/A 26JAN2025	-	1,000,000	-	1,000,000
HENAN WATER CONSERVANCY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.8% S/A 18SEP2025	-	3,000,000	(3,000,000)	-
HENAN WATER CONSERVANCY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.8% S/A 18SEP2025	-	2,000,000	(2,000,000)	-
HERSHEY CO 4.55% S/A 24FEB2028	-	1,000,000	-	1,000,000
HERSHEY CO 4.75% S/A 24FEB2030	-	1,000,000	-	1,000,000
HERSHEY CO 4.95% S/A 24FEB2032	-	1,000,000	(1,000,000)	-
HERSHEY CO 5.1% S/A 24FEB2035 HKT CAPITAL NO 2 LTD 3.625% S/A 02APR2025 REGS	-	1,000,000	(1,000,000)	-
HOKKAIDO ELECTRIC POWER CO INC 4.587% S/A 04SEP2030	-	3,725,000	(3,725,000)	-
HONG KONG XIANGYU INVESTMENT CO LTD 3.15% S/A 15JUL2028	-	2,250,000	(2,250,000)	-
HONGKONG INTL QINGDAO CO LTD 4.8% S/A 08JUL2025	-	10,000,000	-	10,000,000
HP INC 5.4% S/A 25APR2030 HP INC 6.1% S/A 25APR2035	-	800,000	(800,000)	-
HPHT FINANCE 21 II LTD 1.5% S/A 17SEP2026	-	2,000,000	-	2,000,000
HPHT FINANCE LTD 5% S/A 21FEB2030	-	1,300,000	-	1,300,000
	-	3,875,000	-	3,875,000
	-	2,454,000	-	2,454,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
HPS CORPORATE LENDING FUND 5.45% S/A 14JAN2028	-	1,500,000	-	1,500,000
HPS CORPORATE LENDING FUND 5.45% S/A 14JAN2028 (EXCHANGED)	-	1,500,000	(1,500,000)	-
HPS CORPORATE LENDING FUND 5.85% S/A 05JUN2030	-	350,000	(350,000)	-
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 3M S+1.03% Q 03MAR2029	-	1,600,000	-	1,600,000
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.04% Q 19NOV2028	1,000,000	-	-	1,000,000
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.19% Q 06NOV2031	-	1,300,000	-	1,300,000
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.29% Q 03MAR2031	-	1,200,000	-	1,200,000
HSBC HLDGS PLC 3M S+1.57% Q 13MAY2031	-	1,400,000	-	1,400,000
HSBC HLDGS PLC 4.619% S/A 06NOV2031	-	1,300,000	-	1,300,000
HSBC HLDGS PLC 4.899% S/A 03MAR2029	-	1,200,000	(1,200,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.13% S/A 03MAR2031	-	1,200,000	(1,200,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.133% S/A 06NOV2036	-	1,500,000	(1,500,000)	-
HSBC HLDGS PLC 5.24% S/A 13MAY2031	-	900,000	-	900,000
HSBC HLDGS PLC 5.45% S/A 03MAR2036	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
HSBC HLDGS PLC 5.741% S/A 10SEP2036	-	1,400,000	-	1,400,000
HSBC HLDGS PLC 5.79% S/A 13MAY2036	-	1,000,000	-	1,000,000
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HSBC HLDGS PLC 6.375% S/A PERP (CALLED)	-	-	-	-
HSBC HLDGS PLC 6.875% S/A PERP	800,000	-	-	800,000
HSBC HLDGS PLC 6.95% S/A PERP	-	-	-	-
HSBC HLDGS PLC 6.95% S/A PERP	-	3,500,000	(3,000,000)	500,000
HSBC HLDGS PLC 7.05% S/A PERP	-	3,350,000	-	3,350,000
HSBC USA INC 3M S+0.97% Q 03JUN2028	-	1,500,000	-	1,500,000
HSBC USA INC 4.65% S/A 06JUN2028	-	2,000,000	-	2,000,000
HUAFA 2020 I CO LTD 2.8% S/A 04NOV2025	2,700,000	4,100,000	(6,800,000)	-
HUAFA 2021 I CO LTD 2.95% S/A 28FEB2025	-	4,500,000	(4,500,000)	-
HUAFA 2024 I CO LTD 3.05% S/A	-	5,000,000	-	5,000,000
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.25% S/A 07NOV2027	5,000,000	8,500,000	-	13,500,000
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.75% S/A 27APR2027	3,000,000	12,128,000	-	15,128,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.625% S/A 30SEP2030	-	3,800,000	-	3,800,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	200,000	13,441,000	-	13,641,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3M S+1.51161% Q 24FEB2025	-	25,655,000	(25,655,000)	-
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% S/A 13NOV2029	2,000,000	2,100,000	-	4,100,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.5% S/A 29MAY2029	-	8,180,000	-	8,180,000
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.25% S/A PERP	4,030,000	23,950,000	(27,980,000)	-
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625% S/A 03JUN2026	3,000,000	17,441,000	-	20,441,000
HUARONG FINANCE II CO LTD 5% S/A 19NOV2025	2,000,000	13,400,000	(15,400,000)	-
HUARONG FINANCE II CO LTD 5.5% S/A 16JAN2025	15,134,000	-	(15,134,000)	-

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
HUAXIA BANK CO LTD 0% A 16JAN2026	-	50,000,000	-	-	50,000,000
HUAXIN CEMENT INTL FINANCE CO LTD 2.25% S/A 19NOV2025	2,955,000	4,150,000	-	(7,105,000)	-
HUBEI UNITED DEVELOPMENT INVESTMENT GROUP CO LTD 3.1% S/A 04MAR2025	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
HUNGARY GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 26SEP2035 REGS	-	650,000	-	(650,000)	-
HUNGARY GOVERNMENT INTL BOND 6.75% S/A 23SEP2055 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
HYATT HOTELS CORP 5.05% S/A 30MAR2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HYATT HOTELS CORP 5.4% S/A 15DEC2035	-	1,400,000	-	-	1,400,000
HYATT HOTELS CORP 5.75% S/A 30MAR2032	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.875% S/A 23 JUN 2027 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.04% Q 19MAR2027	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 4.9% S/A 23 JUN 2028 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.1% S/A 24JUN2030 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 5.4% S/A 23JUN2032 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
HYUNDAI CAPITAL AMERICA S+1.30% Q 18SEP2030	-	5,300,000	-	-	5,300,000
ICBCIL FINANCE CO LTD 1.75% S/A 25AUG2025	-	200,000	-	(200,000)	-
IND BK OF KOREA 4.375% S/A 24JUN2030 REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
IND BK OF KOREA S+0.58% Q 24JUN2028 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	-	-	-	-	-
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 4.75% S/A 15MAY2025 REGS	-	13,417,000	-	(13,417,000)	-
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.5% S/A 31OCT2030	-	7,000,000	-	-	7,000,000
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 2.9% S/A 31OCT2035	-	9,300,000	-	-	9,300,000
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 11JAN2028	-	3,000,000	-	-	3,000,000
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.4% S/A 14AUG2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.9% S/A 16APR2036	-	3,000,000	-	-	3,000,000

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 5.25% S/A 15JAN2030	-	500,000	-	-	500,000
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD 3.2% S/A PERP	-	6,000,000	-	(5,500,000)	500,000
ING GROEP NV 5.525% S/A 25MAR2036	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
ING GROEP NV 5.75% S/A PERP	-	5,600,000	-	-	5,600,000
ING GROEP NV 6.5% S/A PERP (CALLED)	-	30,025,000	-	(30,025,000)	-
ING GROEP NV 7% S/A PERP	-	1,200,000	-	-	1,200,000
ING GROEP NV 6.75% S/A PERP (CALLED)	-	-	-	-	-
ING GROEP NV 7.25% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
ING GROEP NV S+1.01% Q 25MAR2029	-	1,500,000	-	-	1,500,000
INTEL CORP 5.6% S/A 21FEB2054	-	1,000,000	-	-	1,000,000
INTL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 4.75% A 21AUG2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
INVERSIONES CMPC SA 6.125% S/A 26FEB2034 REGS	700,000	-	-	-	700,000
JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUNDING 5.35% S/A 13JAN2030	-	5,000,000	-	-	5,000,000
JBS USA LUX SA/JBS USA FOOD CO/JBS USA FINANCE INC 5.95% S/A 20APR2035 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
JD.COM INC 3.875% S/A 29APR2026	-	1,040,000	-	-	1,040,000
JERA CO INC 4.544% S/A 02SEP2030	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 2.9% S/A 25JUL2028	-	2,500,000	-	-	2,500,000
JIUJIANG MUNICIPAL DEVELOPMENT GROUP CO LTD 6.55% S/A 8MAY2027	300,000	-	-	-	300,000
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.375% S/A 15OCT2030	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.65% S/A 07JAN2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
JOHN DEERE CAPITAL CORP S+0.5% Q 06MAR2028	-	1,700,000	-	(1,700,000)	-
JOHNSON & JOHNSON S/A 3.4% 15JAN2038	-	1,700,000	-	-	1,700,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.5% 01MAR2027	-	1,000,000	-	1,000,000
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.55% 01MAR2028	-	2,000,000	-	2,000,000
JOHNSON & JOHNSON S/A 4.55% 01MAR2028	-	3,000,000	(3,000,000)	-
JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD 5.332% S/A 02APR2030	-	700,000	-	700,000
JOY DELIGHT INTERNATIONAL LTD 3.3% S/A 03NOV2028	-	10,000,000	-	10,000,000
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 4.3% S/A 04DEC2028	-	1,600,000	-	1,600,000
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 5.5% S/A 1FEB2027	-	5,700,000	-	5,700,000
JPMORGAN CHASE & CO 4.505% S/A 22OCTFEB2028	1,000,000	-	-	-
JPMORGAN CHASE & CO 4.915% S/A 24JAN2029	-	2,500,000	(2,500,000)	-
JPMORGAN CHASE & CO 4.979% S/A 22JUL2028	500,000	-	-	500,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.012% S/A 23JAN2030	400,000	-	-	400,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.103% S/A 22APR2031	-	800,000	-	800,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.14% S/A 24JAN2031	-	1,000,000	-	1,000,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.502% S/A 24JAN2036	-	2,000,000	-	2,000,000
JPMORGAN CHASE & CO 5.572% S/A 22APR2036	-	800,000	-	800,000
JPMORGAN CHASE & CO S+0.8% Q 24JAN2029	-	1,000,000	-	1,000,000
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	-	-	-	-
JPMORGAN CHASE BANK 5.8% A 23JAN2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE BANK 5.88% A 23JAN2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE BK NA 5.7% A 20FEB2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE BK NA 5.8% A 20FEB2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE BK NA 5.82% A 19FEB2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE BK NA 5.88% A 24FEB2035	-	5,000,000	-	5,000,000
JPMORGAN CHASE FINANCIAL 5.8% A 14NOV2034	5,000,000	-	(5,000,000)	-

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
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)	-
JULIUS BAER GROUP LTD 7.5% S/A PERP	-	400,000	-	-	400,000
JUNFENG INTERNATIONAL CO LTD 5.6% S/A 21OCT2027	1,500,000	-	-	-	1,500,000
KAZMUNAVGAS NATIONAL CO 2.95% S/A 30OCT2030	-	6,300,000	-	-	6,300,000
KB CAPITAL CO LTD 4.25% S/A 01OCT2030	-	500,000	-	-	500,000
KEB HANA BANK 4% S/A 21OCT2030 REGS	-	500,000	-	-	500,000
KEB HANBA BANK S+0.6% Q 21OCT2028	-	250,000	-	-	250,000
KEURIG DR PEPPER INC 4.6% S/A 15MAY2030	-	3,200,000	-	(3,200,000)	-
KEURIG DR PEPPER INC 5.15% S/A 15MAY2035	-	1,100,000	-	(1,100,000)	-
KIB SUKUK LTD 5.535% S/A	-	500,000	-	-	500,000
KIMCO REALTY OP LLC 5.3% S/A 01FEB2036	-	400,000	-	-	400,000
KINDER MORGAN INC 5.15% S/A 01JUN2030	-	500,000	-	-	500,000
KINDER MORGAN INC 5.85% S/A 01JUN2035	-	250,000	-	-	250,000
KODIT GLOBAL 2024-1 LTD 5.357 S/A 29MAY2027	750,000	-	-	-	750,000
KOMATSU FINANCE AMERICA INC 4.196% S/A 18SEP2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
KOOKMIN BANK 4.375% S/A 08MAY2028 REGS	-	750,000	-	-	750,000
KOOKMIN BANK 4.625% S/A 08MAY2030 REGS	-	650,000	-	-	650,000
KOREA DEVELOPMENT BANK 2% S/A 24FEB2025	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
KOREA DEVELOPMENT BANK 3M S+0.7% Q 23OCT2026	600,000	-	-	(600,000)	-
KOREA DEVELOPMENT BANK S+0.76% Q 03FEB2030	-	750,000	-	-	750,000
KOREA EAST-WEST POWER CO LTD 4% S/A 04MAY2031	-	300,000	-	(300,000)	-
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4.125% S/A 12NOV2030	-	300,000	-	-	300,000
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4.75% S/A 13FEB2028 REGS	-	250,000	-	-	250,000
KOREA ELECTRIC POWER CORP S+0.62% Q 12NOV2028	-	400,000	-	-	400,000
KOREA GAS CORP 4.25% S/A 10JUL2030 REGS	-	700,000	-	(700,000)	-
KOREA HOUSING FINANCE CORP 5.125% S/A 21JAN2030 REGS	-	1,200,000	-	-	1,200,000

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
KOREA HOUSING FINANCE CORP S+0.9% Q 21JAN2030 REGS	-	1,200,000	-	-	1,200,000
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 LAND & HOUSING CORP 4.25% S/A 28MAY2027	-	500,000	-	(500,000)	-
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% S/A 29SEP2028 REGS	-	250,000	-	(250,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.125% S/A 29SEP2030	-	250,000	-	(250,000)	-
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 4.625% S/A 31MAR2028	-	500,000	-	(500,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP 4.75% S/A 31MAR2030	-	500,000	-	(500,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP S+0.65% Q 10JUL2028	-	900,000	-	(900,000)	-
KOREA NATIONAL OIL CORP S+0.67% Q 29SEP2028	-	500,000	-	-	500,000
KOREA NATIONAL OIL CORP S+0.77% Q 31MAR2028	-	500,000	-	(500,000)	-
KOREA OCEAN BUSINESS CORP 4.625% S/A 09MAY2030	-	1,300,000	-	-	1,300,000
KOREA TOBACCO & GINSENG CORP 5% S/A 02MAY2028	-	250,000	-	-	250,000
KOREA WATER RESOURCES CORP 3.5% S/A 27APR2025	-	750,000	-	750,000	-
KOREA WATER RESOURCES CORP 4.375% S/A 21MAY2027	-	500,000	-	-	500,000
KOREAN AIR LINES CO LTD 4% S/A 30SEP2030	-	1,000,000	-	1,000,000	-
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.2% S/A 15MAR2032	-	500,000	-	-	500,000
KRAFT HEINZ FOODS CO 5.4% S/A 15MAR2035	-	500,000	-	-	500,000
KRAKATAU POSCO PT 6.375% S/A 11JUN2027	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
KSA IJARAH SUKUK LTD 4.875% S/A 09SEP2035 REGS	-	3,500,000	-	(3,500,000)	-
KT CORP 4.375% S/A 03JAN2029	-	250,000	-	(250,000)	-
KUBOTA CREDIT CORP USA 4.791% S/A 28MAY2028	-	500,000	-	-	500,000
KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD 8.5% S/A 07DEC2025	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
KYOBO LIFE INSURANCE CO 5.9% S/A PERP REGS	-	7,200,000	-	-	7,200,000
KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC 5.246% S/A 09SEP2035	-	500,000	-	(500,000)	-
LENOVO GROUP LTD 3.421% S/A 02NOV2030 REGS	-	500,000	-	-	500,000
LENOVO GROUP LTD 5.875% S/A 24APR2025	-	30,739,000	-	(30,739,000)	-
LENOVO GROUP LTD 6.536% S/A 27JUL2032 REGS	-	1,300,000	-	-	1,300,000
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02JUL2027 REGS	500,000	-	-	-	500,000
LG ENERGY SOLUTION 5.25% S/A 02APR2028 REGS	-	1,250,000	-	-	1,250,000
LG ENERGY SOLUTION 5.375% S/A 02APR2030 REGS	-	4,250,000	-	-	4,250,000
LG ENERGY SOLUTION 5.875% S/A 02APR2035 REGS	-	2,250,000	-	-	2,250,000
LG ENERGY SOLUTION S+1.7% Q 02APR2030	-	400,000	-	-	400,000
LLOYDS BANKING GROUP PLC 6.625% Q PERP	-	3,700,000	-	-	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.679% S/A 05JAN2035	-	-	-	-	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP	2,500,000	3,000,000	-	(5,500,000)	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC 7.5% Q PERP (CALLED)	-	-	-	-	-
LLOYDS BANKING GROUP PLC S+1.06% Q 26NOV2028	2,000,000	-	-	(2,000,000)	-
L'OREAL SA 5% S/A 20MAY2035 REGS	-	1,750,000	-	-	1,750,000
LOTTE PROPERTY & DEVELOPMENT CO LTD 4.375% S/A 14JUL2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MA'ADEN SUKUK LTD 5.25% S/A 13FEB2030	-	600,000	-	-	600,000
MA'ADEN SUKUK LTD 5.5% S/A 13FEB2035	-	500,000	-	(500,000)	-
MACQUARIE BANK LTD 4.875% S/A 10JUN2025 REGS	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动			2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	处置	
MACQUARIE BANK LTD 5.642% S/A 13AUG2036 REGS	-	800,000	(800,000)	-
MACQUARIE BANK LTD S+0.74% Q 12JUN2028 REGS	-	500,000	-	500,000
MACQUARIE GROUP LTD S+1.2% Q 07DEC2026 REGS	500,000	-	-	500,000
MACQUARIE BANK LTD/LONDON 6.125% S/A PERP REGS	-	3,000,000	-	3,000,000
MACQUARIE BK LTD 4.331% S/A 12JUN2028	-	900,000	(900,000)	-
MARRIOTT INTL INC 5.1% S/A 15APR2032	-	300,000	(300,000)	-
MARRIOTT INTL INC 5.5% S/A 15APR2037	-	1,000,000	(1,000,000)	-
MARUBENI CORP 5.383% S/A 01APR2035	-	300,000	-	300,000
MASTERCARD INC 4.55% S/A 15MAR2028	-	3,000,000	(3,000,000)	-
MCKESSON CORP 4.95% S/A 30MAY2032	-	1,700,000	-	1,700,000
MCKESSON CORP 5.25% S/A 30MAY2035	-	2,100,000	-	2,100,000
MDGH GMTN RSC LTD 4.625% S/A 16OCT2035 REGS	-	2,500,000	(2,500,000)	-
MDGH SUKUK LTD 5% S/A 04JUN2035	-	1,000,000	(1,000,000)	-
MEDCO CYPRESS TREE PTE LTD 8.625% S/A 19MAY2030	-	250,000	-	250,000
MEIJI YASUDA LIFE INSURANCE CO 5.2% S/A 20OCT2045 REGS (CALLED)	-	12,300,000	(12,300,000)	-
MEITUAN 3.1% S/A 05NOV2035	-	7,800,000	-	7,800,000
MEITUAN 5.125% S/A 05NOV2035 REGS	-	1,100,000	-	1,100,000
MEITUAN DIANPING 4.5% S/A 05MAY2031 REGS	-	400,000	-	400,000
MEITUAN DIANPING 4.75% S/A 05NOV2032 REGS	-	400,000	-	400,000
MEITUAN 4.5% S/A 2APR2028 REGS	1,400,000	3,000,000	-	4,400,000
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	1,300,000	1,500,000	-	2,800,000
MEITUAN DIANPING 4.625% S/A 02OCT2029 REGS	500,000	1,800,000	-	2,300,000
MELCO RESORTS FINANCE LTD 4.875% S/A 06JUN2025 REGS	3,280,000	-	(3,280,000)	-
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.375% S/A 04DEC2029 REGS	-	1,000,000	-	1,000,000
MELCO RESORTS FINANCE LTD 7.625% S/A 17APR2032 REGS	-	2,000,000	-	2,000,000
MERCK & CO INC 4.15% S/A 15SEP2030	-	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	增加	持有量的变动		2025年12月 31日
			红利/股息	处置	
MERCK & CO INC 4.75% S/A 04DEC2035	-	1,500,000	-	-	1,500,000
MERCK & CO INC 4.95% S/A 15SEP2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
MERCK & CO INC 5.7% S/A 04DEC2065	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MERCK & CO INC 5.7% S/A 15SEP2055	-	3,800,000	-	(3,800,000)	-
MERRILL LYNCH BV 2.7% A 25JUL2035	-	3,000,000	-	-	3,000,000
MERRILL LYNCH BV 5.6% A 26JUN2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
META PLATFORMS INC 4.875% S/A 15NOV2035	-	900,000	-	-	900,000
META PLATFORMS INC 4.875% S/A 15NOV2035	-	1,500,000	-	-	1,500,000
META PLATFORMS INC 5.5% S/A 15NOV2045	-	600,000	-	(600,000)	-
METLIFE INC 6.35% S/A 15MAR2055	-	1,500,000	-	-	-
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6% S/A 13MAY2030	-	500,000	-	-	500,000
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 6.875% S/A 13MAY2037	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 7.375% S/A 13MAY2055	-	500,000	-	(500,000)	-
MGM CHINA HLDGS LTD 7.125% S/A 01FEB2027 REGS	250,000	-	-	-	-
MICRON TECHNOLOGY INC 5.8% S/A 15JAN2035	-	300,000	-	-	300,000
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD 4.75% S/A 30JUL2025	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
MINOR INTL PCL 2.7% S/A PERP	-	1,620,000	-	(1,620,000)	-
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 2.625% S/A 30JUL2025	-	1,510,000	-	(1,510,000)	-
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 4.375% S/A 14OCT2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 1.375% S/A 07JUL2024	-	-	-	-	-
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 CORP 4.875% S/A 09SEP2035 REGS	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
MITSUBISHI ESTATE CO LTD 4.352% S/A 02OCT2030	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MITSUBISHI HC CAPITAL UK PLC 5.302% S/A 23JAN2028	-	550,000	-	-	550,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 4.527% S/A 12SEP2031	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.159% S/A 24APR2031	-	900,000	-	-	900,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.188% S/A 12SEP2036	-	2,000,000	-	(2,000,000)	2,000,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.197% S/A 16JAN2031	-	1,300,000	-	-	1,300,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.574% S/A 16JAN2036	-	3,000,000	-	(1,000,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.615% S/A 24APR2036	-	900,000	-	(900,000)	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 6.35% S/A PERP	-	5,000,000	-	-	-
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 8.2% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.13% Q 12SEP2031	-	5,000,000	-	-	5,000,000
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC S+1.48% Q 24APR2031	-	1,600,000	-	-	1,600,000
MITSUI & CO LTD 4.398% S/A 03SEP2030	-	2,500,000	-	-	2,500,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.098% S/A 13MAY2031	-	500,000	-	-	500,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.422% S/A 13MAY2036	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.08% Q 13MAY2031	-	1,500,000	-	-	1,500,000
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+1.25% Q 08JUL2031	-	900,000	-	-	900,000
MOMENTIVE PERFORMANCE MATERIALS INC 4.125% S/A 22OCT2028	-	6,400,000	-	(3,200,000)	3,200,000
MORGAN STANLEY 4.994% S/A 12APR2029	-	800,000	-	-	800,000
MORGAN STANLEY BANK NA S+1.165% Q 30OCT2026	1,200,000	-	-	-	1,200,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
MTR CORP (CI) LTD 5.625% S/A PERPETUAL	-	5,500,000	-	(5,500,000)	-
MTR CORP CI LTD 4.875% S/A PERP	-	3,500,000	-	(3,500,000)	-
MTR CORP LTD 4.375% S/A 01APR2030	-	700,000	-	(700,000)	-
MTR CORP LTD 4.875% S/A 01APR2035	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
MTR CORP LTD 5.25% S/A 01APR2055	-	2,400,000	-	(2,400,000)	-
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 02MAR2030 REGS	-	500,000	-	-	500,000
MUTHOOT FINANCE LTD 6.375% S/A 23APR2029 REGS	-	400,000	-	-	400,000
NANNING COMMUNICATIONS INVESTMENT GROUP CO LTD 7.3% S/A 30APR2027	-	2,400,000	-	-	2,400,000
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.45% S/A 11SEP2034	200,000	-	-	-	200,000
NANSHAN LIFE PTE LTD 5.875% S/A 17MAR2041	-	400,000	-	-	400,000
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6% S/A 6AUG2034	250,000	-	-	-	250,000
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 6.5% S/A PERP	-	10,000,000	-	-	10,000,000
NANYANG URBAN INVESTMENT HOLDINGS CO LTD 5.4% S/A 29SEP2028	-	5,000,000	-	-	5,000,000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.902% S/A 14JAN2036 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD S+0.79% Q 14JAN2030	-	1,350,000	-	-	1,350,000
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 4.649% S/A 14JUL2029 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 5.537% S/A 14JUL2036 REGS	-	700,000	-	-	700,000
NATL AUST BK/NY 4.901% S/A 14JAN2030	-	2,400,000	-	-	2,400,000
NATWEST GROUP PLC 5.115% S/A 23MAY2031	-	3,800,000	-	-	3,800,000
NATWEST GROUP PLC 8% Q PERP (CALLED)	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
NATWEST GROUP PLC S+1.1% Q 23MAY2029	-	500,000	-	(500,000)	-
NAVOI MINING & METALLURGICAL COMBINAT 6.7% S/A 17OCT2028 REGS	400,000	-	-	-	400,000
NBN CO LTD 4.15% S/A 16SEP2030 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
NESTLE FINANCE INTL LTD 2.8% A 29MAY2035 REGS	-	14,000,000	-	-	14,000,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
NEXA RESOURCES SA 6.6% S/A 08APR2037 REGS	-	2,300,000	-	(1,000,000)	(1,000,000)
NH INVESTMENT & SECS 4.625% S/A 10JUL2028	-	250,000	-	-	250,000
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD 4.75% S/A 10JUL2030	-	250,000	-	(250,000)	-
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4% S/A 19SEP2047 REGS	-	10,000,000	-	-	10,000,000
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4.114% A 23JAN2055	-	300,000	-	-	300,000
NIPPON LIFE INSURANCE CO 4.7% S/A 20JAN2046	-	12,874,000	-	-	12,874,000
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 HLDGS INC 1.653% S/A 14JUL2026	-	300,000	-	-	300,000
NOMURA HLDGS INC 2.329% S/A 22JAN2027	-	4,000,000	-	-	4,000,000
NOMURA HLDGS INC 3.103% S/A 16JAN2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000
NOMURA HLDGS INC 4.904% S/A 01JUL2030	-	800,000	-	-	800,000
NOMURA HLDGS INC 5.043% S/A 10JUN2036	-	4,200,000	-	-	4,200,000
NOMURA HLDGS INC 5.491% S/A 29JUN2035	-	400,000	-	-	400,000
NOMURA HLDGS INC 7% S/A PERPETUAL	-	3,800,000	-	-	3,800,000
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 2.82% A 28JUL2035	-	20,000,000	-	-	20,000,000
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.4% A 11DEC2034	6,000,000	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 5.8% A 10FEB2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
NOMURA INTERNATIONAL FUNDING PTE LTD 6.06% A 21JAN2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
NONGHYUP BANK 4.375% S/A 21JUL2030 REGS	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
NONGHYUP BANK Q S+0.68 21JAN2029 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
NORDEA BANK ABP 6.75% S/A PERP	-	1,900,000	-	-	1,900,000
NORFOLK SOUTHERN CORP 5.1% S/A 01MAY2035	-	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
NORINCHUKIN BANK 5.094% S/A 16OCT2029 REGS	200,000	-	-	-	200,000
NORTHROP GRUMMAN CORP 4.65% S/A 15JUL2030	-	1,800,000	-	-	1,800,000
NORTHROP GRUMMAN CORP 5.25% S/A 15JUL2035	-	1,600,000	-	-	1,600,000
NTT FINANCE CORP 2.906% A 16MAR2029 REGS	-	250,000	-	-	250,000
NTT FINANCE CORP 3.678% A 16JUL2033 REGS	-	350,000	-	-	350,000
NTT FINANCE CORP 4.091% A 16JUL2037 REGS	-	250,000	-	-	250,000
NTT FINANCE CORP 4.567% S/A 16JUL2027 REGS	-	1,900,000	-	-	1,900,000
NTT FINANCE CORP 4.62% S/A 16JUL2028 REGS	-	3,000,000	-	-	3,000,000
NTT FINANCE CORP 4.876% S/A 16JUL2030 REGS	-	2,200,000	-	-	2,200,000
NTT FINANCE CORP 5.171% S/A 16JUL2032 REGS	-	4,000,000	-	-	4,000,000
NTT FINANCE CORP 5.502% S/A 16JUL2035 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
NTT FINANCE CORP S+1.08% Q 16JUL2028 REGS	-	2,900,000	-	-	2,900,000
NTT FINANCE CORP S+1.31% Q 16JUL2030 REGS	-	3,500,000	-	-	3,500,000
OLYMPUS CORP 2.143% S/A 08DEC2026 REGS	-	3,345,000	-	-	3,345,000
ORACLE CORP 4.45% S/A 26SEP2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000
ORACLE CORP 4.8% S/A 26SEP2032	-	500,000	-	-	500,000
ORACLE CORP 5.2% S/A 26SEP2035	-	500,000	-	-	500,000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC 5.75% S/A 20NOV2026	200,000	-	-	-	200,000
ORIX CORP 4.45% S/A 09SEP2030	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 1.832% S/A 10SEP2030 REGS (CALLED)	-	23,460,000	-	(23,460,000)	-
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 4.55% S/A 08SEP2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 5.52% S/A 21MAY2034	200,000	-	-	-	200,000
PACIFICORP 7.375% S/A 15SEP2055	-	500,000	-	-	500,000
PAYCHEX INC 5.35% S/A 15APR2032	-	400,000	-	-	400,000
PAYPAL HLDGS INC 4.45% S/A 06MAR2028	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
PAYPAL HLDGS INC 5.1% S/A 01APR2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
PAYPAL HLDGS INC S+0.67% Q 06MAR2028	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	5,580,000	14,129,000	-	(19,709,000)	-
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.625% S/A PERP	-	5,600,000	-	-	5,600,000
PEPSICO INC 4.1% S/A 15JAN2029	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
PEPSICO INC 4.3% S/A 23JUL2030	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
PEPSICO INC 4.65% S/A 23JUL2032	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
PEPSICO INC 5% S/A 23JUL2035	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
PERTAMINA HUTU ENERGI PT 5.25% S/A 21MAY2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000
PERUVIAN GOVERNMENT INTL BOND 5.5% S/A 30MAR2036	-	1,000,000	-	-	1,000,000
PERUVIAN GOVERNMENT INTL BOND 6.2% S/A 30JUN2055	-	500,000	-	-	500,000
PETRON CORP 7.35% S/A PERP REGS	-	500,000	-	(500,000)	-
PETRONAS CAPITAL LTD 4.95% S/A 03JAN2031 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
PETRONAS CAPITAL LTD 5.34% S/A 03APR2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
PETRONAS CAPITAL LTD 5.848% S/A 03APR2055	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 0.66% Q 27OCT2028	-	400,000	-	(400,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 0.83% Q 28APR2028	-	600,000	-	(600,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 3.875% S/A 27OCT2028	-	400,000	-	-	400,000
PHILIP MORRIS INTL INC 4% S/A 29OCT2030	-	400,000	-	-	400,000
PHILIP MORRIS INTL INC 4.125% S/A 28APR2028	-	7,000,000	-	(7,000,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 4.25% S/A 29OCT2032	-	400,000	-	-	-
PHILIP MORRIS INTL INC 4.375% S/A 30APR2030	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 4.625% S/A 29OCT2035	-	400,000	-	(400,000)	-
PHILIP MORRIS INTL INC 4.875% S/A 30APR2035	-	400,000	-	(400,000)	-
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 5.5% S/A 04FEB2035	-	900,000	-	(900,000)	-
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 5.9% S/A 04FEB2050	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	-	4,000,000	-	-	-
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.812% S/A 21COT2032	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
POSCO HLDGS INC 5.75% S/A 05JUL2035	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
POSCO HOLDINGS INC 5.125% S/A 07MAY2030 REGS	-	500,000	-	-	500,000
PROCTER & GAMBLE CO 4.1% S/A 03NOV2032	-	3,100,000	-	(3,100,000)	-
PROLOGIS LP 3.25% S/A 11SEP2029	5,000,000	-	-	-	5,000,000
PROSUS NV 3.68% S/A 21JAN2030 REGS	-	800,000	-	-	800,000
PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING 4.772% S/A 09DEC2029	400,000	-	-	-	400,000
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.375% S/A 15MAY2045 (CALLED)	-	3,650,000	-	(3,650,000)	-
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.239% S/A 10NOV2037	-	2,600,000	-	-	2,600,000
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.25% S/A PERP	3,000,000	8,500,000	-	(11,500,000)	-
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.875% S/A 17JUN2046	-	12,152,000	-	-	12,152,000
QBE INSURANCE GROUP LTD 5.875% S/A PERP REGS	3,000,000	31,870,000	-	(34,870,000)	-
QIC CAYMAN LTD 6.15% S/A PERP	-	1,500,000	-	-	1,500,000
QIB TIER 1 SUKUK LLC 5.45% S/A PERP	500,000	-	-	-	500,000
QNB FINANCE LTD 4.5% S/A 24JUL2030	-	700,000	-	(700,000)	-
QUALCOMM INC 4.5% S/A 20MAY2030	-	2,500,000	-	(500,000)	2,000,000
QUALCOMM INC 5% S/A 20MAY2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
QUZHOU STATE OWNED CAPITAL OPERATION CO LTD 3% S/A 02MAR2025	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
RAIZEN FUELS FINANCE 6.25% S/A 08JUL2032	-	1,400,000	-	(900,000)	500,000
RAIZEN FUELS FINANCE 6.7% S/A 25FEB2037	-	250,000	-	(250,000)	-
RAIZEN FUELS FINANCE 6.95% S/A 05MAR2054	-	250,000	-	(250,000)	-
RAIZEN FUELS FINANCE 6.95% S/A 05MAR2054	-	250,000	-	(250,000)	-
RAKUTEN GROUP INC 11.25% S/A 15FEB2027	-	500,000	-	-	500,000
RALPH LAUREN CORP 5% S/A 15JUN2032	-	1,000,000	-	-	1,000,000
RANDE PROPERTY 6.65% S/A 01JUN2055	600,000	-	-	-	600,000
REC LTD 4.75% S/A 27SEP2029	1,000,000	-	-	-	1,000,000
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 5.25% S/A 09JAN2030	-	1,500,000	-	-	1,500,000

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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC 6.65% S/A 15SEP2055	-	400,000	-	-	400,000
REP OF CHILE 5.65% S/A 13JAN2037	-	200,000	-	-	200,000
REPUBLIC OF BULGARIA 5% S/A 05MAR2037	150,000	-	-	(150,000)	-
REPUBLIC OF INDONESIA 5.3% S/A 14AUG2035	-	1,200,000	-	-	1,200,000
REPUBLIC OF INDONESIA 5.6% S/A 15JAN2035	-	1,300,000	-	-	1,300,000
RESONA BANK LTD 4.983% S/A 22JAN2028	-	250,000	-	-	250,000
RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC/RWLV CAPITAL INC 4.625% S/A 16APR2029 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
RIO TINTO FIN USA LTD 5.75% S/A 14MAR2055	-	250,000	-	(250,000)	-
RIO TINTO FIN USA LTD 5.875% S/A 14MAR2065	-	500,000	-	(500,000)	-
RIO TINTO FINANCE USA PLC 4.375% S/A 12MAR2027	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
RIO TINTO FINANCE USA PLC 4.5% S/A 14MAR2028	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
RIO TINTO FINANCE USA PLC 4.875% S/A 14MAR2030	-	3,000,000	-	(2,000,000)	1,000,000
RIO TINTO FINANCE USA PLC 5% S/A 14MAR2032	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
RIO TINTO FINANCE USA PLC 5.25% S/A 14MAR2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
RIO TINTO FINANCE USD PLC S+0.84% Q 14MAR2028	-	2,500,000	-	-	2,500,000
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.75% S/A 02JUL2035	-	6,000,000	-	(1,000,000)	5,000,000
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 6.875% S/A PERP	-	7,800,000	-	-	7,800,000
RLGH FINANCE BERMUDA LTD 8.25% S/A 17JUL2031	-	1,800,000	-	-	1,800,000
ROYAL BANK OF CANADA 6.35% Q 24NOV2084	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
ROYAL BANK OF CANADA 6.75% Q 24AUG2085	-	800,000	-	(800,000)	-
RYDER SYSTEM INC 4.85% S/A 15JUN2030	-	250,000	-	-	250,000
SAN MIGUEL CORP 5.5% S/A PERP (CALLED)	-	1,350,000	-	(1,350,000)	-
SANDS CHINA LTD 2.3% S/A 08MAR2027	2,000,000	3,634,000	-	-	5,634,000
SANDS CHINA LTD 2.85% S/A 08MAR2029	500,000	-	-	-	500,000
SANDS CHINA LTD 3.8% S/A 08JAN2026	-	7,500,000	-	-	7,500,000
SANDS CHINA LTD 5.125% S/A 08AUG2025	1,000,000	14,650,000	-	(15,650,000)	-

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
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
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 6.03% A 21JAN2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
SANTANDER INTERNATIONAL PRODUCTS PLC 6.06% A 21NOV2034	5,000,000	-	-	(5,000,000)	-
SANTANDER UK GROUP HLDGS PLC 6.534% S/A 10JAN2029	-	3,000,000	-	-	3,200,000
SANTOS FINANCE LTD 5.75% S/A 13NOV2035 REGS	-	2,600,000	-	-	2,600,000
SANTOS FINANCE LTD 6.875% S/A 19SEP2033 REGS	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SAUDI ARABIAN OIL CO 4.75% S/A 02JUN2030 REGS	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
SAUDI ARABIAN OIL CO 5.375% S/A 02JUN2035 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SAUDI ARABIAN OIL CO 6.375% S/A 02JUN2055 REGS	-	4,000,000	-	(3,000,000)	1,000,000
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.225% S/A 18FEB2030	-	3,000,000	-	(1,000,000)	2,000,000
SAUDI ELECTRICITY SUKUK PROGRAMME CO 5.489% S/A 18FEB2035 REGS	-	2,500,000	-	(500,000)	2,000,000
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.125% S/A 13JAN2028 REGS	-	3,400,000	-	-	3,400,000
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.375% S/A 13JAN2031 REGS	-	4,000,000	-	(2,000,000)	2,000,000
SAUDI GOVERNMENT INTL BOND 5.625% S/A 13JAN2035 REGS	-	5,000,000	-	(3,400,000)	1,600,000
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	2,000,000	23,465,000	-	(25,465,000)	-
SCENTRE GROUP TRUST 2 5.125% S/A 24SEP2080 REGS	-	17,023,000	-	-	17,023,000
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 5.75% S/A 22APR2027	-	600,000	-	(600,000)	-
SCIENCE CITY GUANGZHOU INVESTMENT GROUP CO LTD 6.8% S/A 05AUG2025	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
SEAZEN GROUP LTD 11.88% S/A 26JUN2028	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
SEKISUI HOUSE LTD 4.7% S/A 23FEB2030	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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
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	10,900,000	-	(12,000,000)	-
SEMPRA ENERGY 6.4% S/A 01OCT2054	-	-	-	-	-
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	-	-	-	-
SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 6.375% S/A 28FEB2033	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.4% S/A 30OCT2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SHELL FINANCE US INC 4.125% S/A 06NOV2030	-	600,000	-	(600,000)	-
SHELL FINANCE US INC 4.75% S/A 06JAN2036	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SHELL FINANCE US INC S+0.78% S/A 06NOV2030	-	2,000,000	-	-	2,000,000
SHIN KONG LIFE SG PTE 6.95% S/A 26JUN2035	-	1,500,000	-	(500,000)	1,000,000
SHINHAN BANK CO LTD 5.75% S/A 15APR2034 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 2.875% S/A PERP REGS	1,500,000	4,000,000	-	-	5,500,000
SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 5.2% S/A 28MAY2035	-	700,000	-	(700,000)	-
SIEMENS FUNDING BV 4.35% S/A 26MAY2028	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
SIEMENS FUNDING BV 4.6% S/A 28MAY2030	-	500,000	-	(500,000)	-
SIEMENS FUNDING BV 4.9% S/A 28MAY2032	-	700,000	-	-	700,000
SIEMENS FUNDING BV 5.8% S/A 28MAY2055	-	300,000	-	(300,000)	-
SIEMENS FUNDING BV 5.9% S/A 28MAY2065	-	400,000	-	(400,000)	-
SINGAPORE AIRLINES LTD 5.25% S/A 21MAR2034	800,000	-	-	-	800,000
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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP (CALLED)	-	6,000,000	-	(6,000,000)	-
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 6.75% S/A PERP	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.1% S/A 01APR2030 REGS	-	750,000	-	-	750,000
SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 5.55% S/A 3APR2034 REGS	-	1,600,000	-	-	1,600,000
SNAM SPA 5% S/A 28MAY2030	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
SNAM SPA 5.75% S/A 28MAY2035	-	3,400,000	-	(2,500,000)	900,000
SNAM SPA 6.5% S/A 28MAY2055	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
SNB FUNDING LTD 6% S/A 24JUN2035	-	1,900,000	-	-	1,900,000
SOAR WISE LTD 4.05% S/A 08OCT2024	1,700,000	-	-	(11,700,000)	-
SOCIETE GENERALE S+1.42% S/A 22MAY2029	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 4.25% S/A 14APR2025 REGS	-	3,595,000	-	(3,595,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 4.75% S/A PERP REGS	-	8,000,000	-	-	8,000,000
SOCIETE GENERALE SA 5.249% S/A 22MAY2029 REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
SOCIETE GENERALE SA 5.439% S/A 03OCT2036 REGS	-	8,000,000	-	-	8,000,000
SOCIETE GENERALE SA 5.5% S/A 13APR2029 REGS	-	12,000,000	-	(5,000,000)	7,000,000
SOCIETE GENERALE SA 5.512% S/A 22MAY2031 REGS	-	1,300,000	-	-	1,300,000
SOCIETE GENERALE SA 6.1% S/A 13APR2033 REGS	-	2,800,000	-	-	2,800,000
SOCIETE GENERALE SA 8% S/A PERP	3,000,000	11,095,000	-	(14,095,000)	-
SOCIETE GENERALE SA 8.125% S/A PERP	950,000	-	-	-	950,000
SOCIETE GENERALE SA S+1.41% Q 13APR2029 REGS	-	11,000,000	-	(11,000,000)	-
SOFTBANK CORP 4.699% S/A 09JUL2030	-	500,000	-	(500,000)	-
SOFTBANK CORP 5.332% S/A 09JUL2035	-	500,000	-	(500,000)	-
SOFTBANK GROUP CORP 6.5% S/A 29OCT2062	-	500,000	-	-	500,000
SOFTBANK GROUP CORP 7.625% S/A 29APR2061	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SOFTBANK GROUP CORP 8.25% S/A 29OCT2065	-	750,000	-	-	750,000
SOUTHERN CO 4% S/A 15JAN2051	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SOUTHWEST AIRLINES CO 4.375% S/A 15NOV2028	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
SOUTHWEST AIRLINES CO 5.25% S/A 15NOV2035	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
SPIC PREFERRED CO NO 2 LTD 3.45% S/A PERP (CALLED)	-	6,355,000	-	(6,355,000)	-
SPIC PREFERRED CO NO 4 LTD 4.95% S/A PERP	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
SRC SUKUK LTD 5% S/A 27FEB2028	-	2,350,000	-	-	2,350,000
SRC SUKUK LTD 5.375% S/A 27FEB2035	-	1,100,000	-	-	1,100,000
STANDARD CHARTERED PLC 5.005% S/A 15OCT2030 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
STANDARD CHARTERED PLC 5.4% S/A 12AUG2036 REGS	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 5.545% S/A 21JAN2029	-	1,000,000	-	-	1,000,000
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	300,000	4,000,000	-	(4,300,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 7% S/A PERP REGS	-	2,300,000	-	(2,300,000)	-
STANDARD CHARTERED PLC 7.625% S/A PERP REGS	-	1,500,000	-	-	1,500,000
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+1.24% Q 21JAN2029 REGS	-	3,000,000	-	-	3,000,000
STANDARD CHARTERED PLC S+1.93% Q 06JUL2027 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SUCI SECOND INVESTMENT CO 4.375% S/A 10SEP2027 REGS	500,000	-	-	(500,000)	-
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	-	3,604,000	-	-	3,604,000
SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 5.236% S/A 01MAY2030	-	500,000	-	-	500,000
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 4.954% S/A 08JUL2033	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.796% S/A 08JUL2046	-	2,300,000	-	(2,300,000)	-
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.836% S/A 09JUL2044	450,000	-	-	-	450,000
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 6.45% S/A PERP REGS	-	3,200,000	-	(2,000,000)	1,200,000
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.05% Q 15APR2030	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+1.19% Q08JUL2031	-	1,900,000	-	(1,900,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.45% S/A 10SEP2027	900,000	-	-	-	900,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.5% S/A 13MAR2028 REGS	-	700,000	-	-	700,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 4.7% S/A 13MAR2030	-	700,000	-	(700,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 5.05% S/A 13MAR2035	-	700,000	-	(700,000)	-
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.75% Q 11SEP2028	-	2,900,000	-	-	2,900,000
SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD S+0.99% Q 13MAR2030	-	2,700,000	-	-	2,700,000
SUMITOMO MITSUI TRUST GROUP INC 5.416% S/A 11SEP2036 REGS	-	900,000	-	-	900,000
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 5.95% S/A 17JUL2026	7,495,000	2,614,000	-	-	10,109,000
SUZHOU CITY CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP (HOLDING) CO LTD 5% S/A 15JUL2028	-	1,500,000	-	-	1,500,000
SVENSKA HANDELSBANKEN AB S+1.25% Q 15JUN2026 REGS	1,000,000	-	-	-	1,000,000
SWIRE PACIFIC MTN FINANCING HK LTD 4.625% S/A 28AUG2032	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 2.85% S/A 22JUL2030	-	4,000,000	-	(4,000,000)	-
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.4% S/A 03SEP2029	2,000,000	-	-	-	2,000,000
SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING LTD 3.45% S/A 22JUL2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
SWISS RE SUBORDINATED FINANCE PLC 6.191% S/A 01APR2046 REGS	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
SX FENGXI DEVELOPMENT GR 4.95% S/A 28SEP2026	-	8,200,000	-	(6,200,000)	2,000,000
SYNGENTA FINANCE NV 4.892% S/A 24APR2025 REGS	8,627,000	1,935,000	-	(10,562,000)	-
SYNGENTA FINANCE NV 5.182% S/A 24APR2028 REGS	-	300,000	-	-	300,000
SYNOPSIS INC 4.55% S/A 01APR2027	-	500,000	-	(500,000)	-
SYNOPSIS INC 4.65% S/A 01APR2028	-	400,000	-	(400,000)	-
SYNOPSIS INC 4.85% S/A 01APR2030	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
SYNOPSIS INC 5.15% S/A 01APR2035	-	700,000	-	(700,000)	-
SYNOPSIS INC 5.7% S/A 01APR2055	-	300,000	-	(300,000)	-
SYSCO CORP 5.1% S/A 23SEP2030	-	750,000	-	-	750,000
SYSCO CORP 5.4% S/A 23MAR2035	-	300,000	-	-	300,000
SZ YINTONG AM INV S/A 4.5% 30JUL2028	-	2,000,000	-	-	2,000,000
TATA CAPITAL LTD 5.389% S/A 21JUL2028	-	1,500,000	-	-	1,500,000
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.05% S/A 30JUL2035	-	11,900,000	-	(1,900,000)	10,000,000
TEMASEK FINANCIAL I LTD 2.55% S/A 30JUL2055 REGS	-	13,000,000	-	-	13,000,000
TEMASEK FINANCIAL I LTD 3.1% S/A 28AUG2054	3,000,000	-	-	-	3,000,000
TENCENT HLDGS LTD 1.81% S/A 26JAN2026 REGS	-	6,085,000	-	-	6,085,000
TENCENT HLDGS LTD 3.29% S/A 03JUN2060 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
TENCENT HLDGS LTD 3.595% S/A 19JAN2028 REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
TENCENT HLDGS LTD 3.8% S/A 11FEB2025 REGS	2,984,000	-	-	(2,984,000)	-
TENCENT HOLDINGS LTD 3.1% S/A 23SEP2055	-	2,000,000	-	-	2,000,000
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	-	2,000,000	-	-	2,000,000
T-MOBILE USA INC 5.05% S/A 15JUL2033 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
T-MOBILE USA INC 5.125% S/A 15MAY2032	-	1,800,000	-	-	1,800,000
T-MOBILE USA INC 5.3% S/A 15MAY2035 REGS	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
T-MOBILE USA INC 5.875% S/A 15NOV2055	-	750,000	-	(750,000)	-
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 5.25% S/A PERP	442,000	14,945,000	-	(15,387,000)	-
TONGYANG LIFE INSURANCE CO LTD 6.25% S/A 07MAY2035	-	4,500,000	-	-	4,500,000
TORONTO-DOMINION BANK 5.146% S/A 10SEP2034	-	1,000,000	-	-	1,000,000
TORONTO-DOMINION BANK 8.125% Q 31OCT2082	-	9,639,000	-	-	9,639,000
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.5% S/A 14MAY2027	-	2,000,000	-	-	2,000,000
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.65% S/A 03SEP2032	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.8% S/A 15MAY2030	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
TPG OPERATING GROUP II LP 5.375% S/A 15JAN2036	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 4.924% S/A 24MAR2036	-	1,400,000	-	(1,400,000)	-
TRUIST BANK 4.671% S/A 20MAY2027	-	2,500,000	-	(2,500,000)	-
TRUIST FINANCIAL CORP 5.071% S/A 20MAY2031	-	2,500,000	-	-	2,500,000
TVF VARLIK KIRALAMA AS 6.95% S/A 23JAN2030	400,000	-	-	-	400,000
UBS AG 6.373% S/A 15JUL2026 REGS (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
UBS GROUP AG 3.875% S/A PERP REGS	-	2,917,000	-	-	2,917,000
UBS GROUP AG 4.875% S/A PERP REGS	-	2,000,000	-	-	2,000,000
UBS GROUP AG 5.125% A PERP	-	4,500,000	-	-	4,500,000
UBS GROUP AG 7% A PERP	1,000,000	18,187,000	-	(19,187,000)	-
UBS GROUP AG 7% S/A PERP	-	250,000	-	(250,000)	-
UBS GROUP AG 7% S/A PERP REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
UBS GROUP AG 7.125% S/A PERP	-	2,250,000	-	(2,250,000)	-
UBS GROUP AG 9.25% S/A PERP	400,000	-	-	-	400,000
UBS GROUP AG S+1.06% Q 23SEP2031	-	3,000,000	-	-	3,000,000
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.6% S/A PERP	-	1,750,000	-	-	1,750,000
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% A PERP (CALLED)	-	25,763,000	-	(25,763,000)	-
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG 6.875% S/A PERP	400,000	-	-	-	400,000
UNION PACIFIC CORP 5.1% S/A 20FEB2035	-	500,000	-	(500,000)	-
UNITED PARCEL SERVICE INC 5.25% S/A 14MAY2035	-	1,000,000	-	-	1,000,000
UNITED PARCEL SERVICE INC 6.05% S/A 14MAY2065	-	500,000	-	(500,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% 02JAN2026	-	10,000,000	-	-	10,000,000
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 04FEB2025	-	50,000,000	-	(50,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 06FEB2025	-	60,000,000	-	(60,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 11FEB2025	-	50,000,000	-	(50,000,000)	-

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 13FEB2025	-	30,000,000	-	(30,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 14JAN2025	-	30,000,000	-	(30,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 15APR2025	-	20,000,000	-	(20,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 16JAN2025	-	8,000,000	-	(8,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 18FEB2025	-	50,000,000	-	(50,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 20FEB2025	-	50,000,000	-	(50,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 20MAR2025	-	10,000,000	-	(10,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 21JAN2025	-	30,000,000	-	(30,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 22APR2025	-	20,000,000	-	(20,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 23JAN2025	-	30,000,000	-	(30,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 25FEB2025	-	30,000,000	-	(30,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 28JAN2025	-	10,000,000	-	(10,000,000)	-
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 29APR2025	-	10,000,000	-	(10,000,000)	-
UNITEDHEALTH GROUP INC 5.3% S/A 15JUN2035	-	250,000	-	-	250,000
US TREASURY N/B 3.75% S/A 30JUN2027	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
US TREASURY N/B 4.125% S/A 31JAN2027	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 15AUG2035	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 15MAY2035	-	1,500,000	-	(1,500,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 30NOV2026	1,000,000	-	-	(1,000,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 31DEC2026	-	6,000,000	-	(6,000,000)	-
US TREASURY N/B 4.25% S/A 31JAN2030	-	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
US TREASURY N/B 4.625% S/A 15FEB2035		9,500,000	-	(9,500,000)	-
US TREASURY N/B 4.875% S/A 15AUG2045	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
VERISK ANALYTICS INC 4.5% S/A 15AUG2030 (CALLED)	-	500,000	-	-	500,000
VERISK ANALYTICS INC 5.125% S/A 15FEB2036		1,900,000	-	(1,900,000)	-
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 2.75% S/A 02JUN2025	1,734,000	1,550,000	-	(3,284,000)	-
VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 6% S/A 15FEB2056	-	1,500,000	-	-	1,500,000
VIRGINIA ELECTRIC AND POWER CO 6.2% S/A 15FEB2056	-	2,000,000	-	(2,000,000)	-
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 3.125% S/A 12MAY2023 REGS	700,000	-	-	-	700,000
VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FINANCE LLC 6% S/A 16NOV2026 REGS	750,000	-	-	-	750,000
WALMART INC 4.35% S/A 28APR2030	-	500,000	-	-	500,000
WALMART INC 4.9% S/A 28APR2035	-	2,500,000	-	-	2,500,000
WASTE CONNECTIONS INC 5.25% S/A 01SEP2035	-	300,000	-	-	300,000
WEIBO CORP 3.375% S/A 08JUL2030	2,000,000	-	-	-	-
WELLS FARGO & CO 2.766% A 23JUL2029	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
WELLS FARGO & CO 3.866% A 23JUL2036	-	1,300,000	-	(1,300,000)	-
WELLS FARGO & CO 4.61% S/A 30AUG2025	-	5,000,000	-	(5,000,000)	-
WELLS FARGO & CO 4.9% S/A 24JAN2028	-	3,000,000	-	(3,000,000)	-
WELLS FARGO & CO 5.244% S/A 24JAN2031	-	500,000	-	-	500,000
WELLS FARGO & CO S+0.78% Q 24JAN2028	-	2,150,000	-	(650,000)	1,500,000
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 5.6% A 26JUN2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.7% A 22NOV2034	5,000,000	-	-	-	5,000,000
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.8% A 19FEB2035	-	5,000,000	-	-	5,000,000
WELLS FARGO FINANCE LLC 5.9% A 19FEB2035	-	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/NEW ZEALAND 5% S/A PERP	-	4,750,000	-	-	4,750,000
WESTPAC NEW ZEALAND LTD 4.938% S/A 27FEB2030 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
WESTWOOD GROUP HLDGS LTD 2.8% S/A 20JAN2026	-	2,800,000	-	-	2,800,000
WILLOW NO 2 IRELAND PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LT 4.25% A 01OCT2045 (CALLED)	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 5.95% S/A 30MAR2029	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)

2025年12月31日

	持有量的变动				2025年12月 31日
	2025年1月 1日	增加	红利/股息	处置	
WOODSIDE FINANCE LTD 5.4% S/A 19MAY2030	-	600,000	-	-	600,000
WOODSIDE FINANCE LTD 5.7% S/A 19MAY2032	-	1,600,000	-	(1,600,000)	-
WOODSIDE FINANCE LTD 6% S/A 19MAY2035	-	1,500,000	-	-	1,500,000
WOORI BANK 6.375% S/A PERP REGS	-	1,800,000	-	(1,600,000)	200,000
WP CAREY INC 4.65% S/A 15JUL2030	-	1,000,000	-	-	1,000,000
WUHAN METRO GROUP CO LTD 4.45% S/A 22OCT2027	1,000,000	-	-	-	1,000,000
WUHAN OPTICAL VALLEY FINANCIAL HOLDING GROUP CO LTD 3.5% S/A 03JUL2028	-	20,000,000	-	-	20,000,000
WYNN MACAU LTD 5.5% S/A 15JAN2026 REGS (CALLED)	-	2,200,000	-	(2,200,000)	-
XIANJIN INDUSTRY INVESTMENT CO LTD 3.9% S/A 08JUN2025	-	1,000,000	-	(1,000,000)	-
XIAOMI BEST TIME INTL LTD 2.875% S/A 14JUL2031 REGS	-	1,000,000	-	-	1,000,000
YIELDKING INVESTMENT LTD 2.8% S/A 18AUG2026	-	5,000,000	-	-	5,000,000
YUEXIU REIT MTN CO LTD 2.65% S/A 02FEB2026	-	2,000,000	-	-	2,000,000
YUNDA HLDG INVESTMENT LTD 2.25% S/A 19AUG2025	3,500,000	24,221,000	-	(27,721,000)	-
ZHANGZHOU TRANSPORTATION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.1% 09APR2028	-	1,700,000	-	-	1,700,000
ZHEJIANG BOXIN BVI LTD 6.2% S/A 21APR2025	2,000,000	10,800,000	-	(12,800,000)	-
ZHEJIANG SEAPORT INTL CO LTD 1.98% S/A 17MAR2026	-	1,000,000	-	-	1,000,000
ZHENGZHOU REAL ESTATE GROUP CO LTD 2.7% S/A 22JUL2028	-	10,000,000	-	-	10,000,000
ZHENGZHOU URBAN CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 3.8% S/A 16JAN2025	1,500,000	-	-	(1,500,000)	-
ZHENGZHOU URBAN CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 5.2% S/A 30AUG2025	-	2,700,000	-	2,700,000	-
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.125% S/A 16JUL2025	1,200,000	12,305,000	-	(13,505,000)	-
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD 3.5% S/A 08MAR2026	1,825,000	13,756,000	-	-	15,581,000
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 3% S/A 13JAN2026 (CALLED)	-	3,610,000	-	(3,610,000)	-
ZHONGSHENG GROUP HLDGS LTD 5.98% S/A 30JAN2028	2,000,000	5,000,000	-	(7,000,000)	-
ZHUZHOU CITY CONSTRUCTION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 4.6% S/A 29MAR2025	-	250,000	-	(250,000)	-
ZHUZHOU CITY CONSTRUCTION DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.3% S/A 18 MAR 2028	-	1,000,000	-	-	1,000,000
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	3,618,605	4,050,496	-	-	7,669,101

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)

2025年12月31日

	2025年1月 1日	持有量的变动			2025年12月 31日
		增加	红利/股息	处置	
CHINAAMC GLOBAL SELCTED INCOME FUND-I A USD	931,084	174,795	-	-	1,105,879
CHINAAMC SELECT ASIA BOND FUND-I ACC USD	1,218,560	4,867,779	-	-	6,086,338
CHINAAMC SELECT MONEY MARKET FUND-I HKD	-	3,536,679	-	(3,536,678)	-
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I RMB ACC	-	450,000	-	-	450,000
CHINAAMC SELECT RMB INVESTMENT GRADE INCOME FUND-I USD HEDGED ACC	3,050,837	12,037,890	-	-	15,088,726
CNCB CAPITAL ASIAN INVESTMENT GRADE BOND FUND CLASS I USD ACC	50,000	-	-	(50,000)	-
	424,953,674	3,587,607,203	-	(2,155,760,832)	1,856,800,045

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 2025 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>				
美元 443,787,756	人民币 3,102,663,530	31/3/2026	中国银行 (香港) 有限公司	2,952,934
美元 1,430	人民币 10,000	31/3/2026	中国银行 (香港) 有限公司	9
				<u>2,952,943</u>
<u>金融负债:</u>				
欧元 1,000,000	美元 1,155,343	26/1/2026	JPM Chase Bank	(20,139)
欧元 500,000	美元 581,540	30/1/2026	JPM Chase Bank	(6,315)
人民币 32,000,000	美元 4,544,999	10/2/2026	JPM Chase Bank	(49,302)
人民币 800,000	美元 114,082	17/3/2026	JPM Chase Bank	(1,008)
人民币 266,000,000	美元 37,927,385	17/3/2026	JPM Chase Bank	(340,036)
欧元 1,838,000	美元 2,161,033	19/3/2026	JPM Chase Bank	(4,721)
澳元 2,170,000	美元 1,434,149	19/3/2026	JPM Chase Bank	(15,242)
人民币 50,000,000	美元 7,146,502	20/1/2026	JPM Chase Bank	(23,210)
				<u>(459,973)</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 2025 年 12 月 31 日止年度及截至 2024 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2025年12月31日止年度 -远期外汇合约	12.29%	78.28%	20.16%
截至2024年12月31日止年度 -远期外汇合约	16.61%	49.28%	36.95%

净衍生风险

	最低	最高	平均
截至2025年12月31日止年度 - 远期外汇合约	(50.26%)	21.32%	13.46%
截至2024年12月31日止年度 - 远期外汇合约	16.37%	39.27%	32.93%

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 美元
2025年12月31日		
- A类(美元)	美元 12.1544	24,362,915
- A类派息(美元)	美元 10.3914	20,709
- A类(人民币)	人民币 12.2112	6,136,170
- A类派息(人民币)	人民币 9.9763	2,862
- A类派息(人民币)(对冲)	人民币 9.9762	2,855
- A类(港币)	港币 12.0928	24,572,852
- A类派息(港币)	港币 10.3825	2,661
- C类(美元)	美元 10.6390	78,474,570
- I类(美元)	美元 13.0157	244,072,569
- I类派息(美元)	美元 12.2129	61,116,488
- I类(人民币)	人民币 10.2367	4,488,043
- I类(港币)	港币 12.1133	4,867,531
- R类(美元)	美元 0.9948	32,356,002
- R类(人民币)	人民币 1.2322	892,034,407
- R类(人民币)(对冲)	人民币 1.0406	496,830,818
2024年12月31日		
- A类(美元)	美元 11.5057	13,920,187
- A类(人民币)	人民币 12.1474	8,533,777
- A类(港币)	港币 11.4224	6,817,227
- C类(美元)	美元 10.0080	10,008
- C类(人民币)	人民币 10.0534	1,370
- C类(人民币)(对冲)	人民币 10.0534	1,370
- I类(美元)	美元 12.2671	199,108,109
- I类派息(美元)	美元 11.6588	58,344,155
- I类(港币)	港币 11.3961	3,182,005
- R类(美元)	美元 0.9417	9,958,116
- R类(人民币)	人民币 1.2252	134,800,964
- R类(人民币)(对冲)	人民币 1.0039	100,658,290
2023年12月31日*		
- A类(美元)	美元 10.9689	5,378,770
- A类(人民币)	人民币 11.2375	374,111
- A类(港币)	港币 10.9512	6,418,663
- R类(人民币)	人民币 1.1335	7,851,173
- R类(人民币)(对冲)	人民币 0.9901	43,704,144
- I类(美元)	美元 11.6583	37,198,207
- I类派息(美元)	美元 11.0809	8,237,377
- I类(港币)	港币 10.8935	3,024,360

*2023年12月31日非工作日,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 2025 年 12 月 31 日止年度		
- I 类(港币)	港币 12.1171	港币 11.3937
- I 类(美元)	美元 13.0194	美元 12.2342
- I 类派息(美元)	美元 12.2891	美元 11.6274
- I 类(人民币)	人民币 10.4004	人民币 10.0000
- A 类(美元)	美元 12.1580	美元 11.4728
- A 类派息(美元)	美元 10.4650	美元 9.9920
- A 类(港币)	港币 12.0968	港币 11.4183
- A 类派息(港币)	港币 10.4414	港币 9.9520
- A 类(人民币)	人民币 12.4170	人民币 12.0067
- A 类派息(人民币)	人民币 10.2203	人民币 9.9285
- A 类派息(人民币)(对冲)	人民币 10.2202	人民币 9.9285
- R 类(美元)	美元 0.9951	美元 0.9390
- R 类(人民币)	人民币 1.2529	人民币 1.2111
- R 类(人民币)(对冲)	人民币 1.0422	人民币 1.0016
- C 类(美元)	美元 10.6420	美元 9.9829
- C 类(人民币)	人民币 10.0919	人民币 9.9398
- C 类(人民币)(对冲)	人民币 10.0919	人民币 9.9398
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
- I 类派息(美元)	美元 11.7434	美元 11.0669
- 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
- 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
- I 类派息(美元)	美元 11.0817	美元 10.7616
- 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

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 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
- I 类派息 (美元)	美元 10.7771	美元 10.7616
- 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
- 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
- I 类派息 (美元)	美元 10.7733	美元 9.7690
- A 类 (美元)	美元 10.8126	美元 9.8351
- A 类 (港币)	港币 10.7171	港币 9.7517
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
- I 类派息 (美元)	美元 10.0953	美元 10.0000
- A 类 (美元)	美元 10.1357	美元 9.9875
- A 类 (港币)	港币 10.1447	港币 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。

