

# 国联高股息精选混合型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年1月1日起至2024年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	62
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	83
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	84
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	84
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	84
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85

8.12 投资组合报告附注 .....	85
§9 基金份额持有人信息 .....	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	87
§10 开放式基金份额变动 .....	87
§11 重大事件揭示 .....	87
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	87
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	88
11.8 其他重大事件 .....	93
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	95
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	96
§13 备查文件目录 .....	96
13.1 备查文件目录 .....	96
13.2 存放地点 .....	96
13.3 查阅方式 .....	96

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联高股息精选混合型证券投资基金	
基金简称	国联高股息混合	
基金主代码	006123	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月26日	
基金管理人	国联基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,259,996,060.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联高股息混合A	国联高股息混合C
下属分级基金的交易代码	006123	006124
报告期末下属分级基金的份额总额	602,472,047.22份	657,524,013.42份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握中国宏观经济政策和市场发展趋势，精选A股和香港两个市场上具有高股息特征的上市公司股票，全面把握中国经济投资机会，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，追求基金长期资产增值。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、股票投资策略</li> <li>3、债券投资策略</li> <li>4、衍生品投资策略</li> <li>5、资产支持证券投资策略</li> <li>6、可转换债券投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中证红利指数收益率*70%+中证港股通高股息投资指数收益率*10%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国联基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健
	联系电话	010-56517000
	电子邮箱	caojian@gfund.com
客户服务电话	400-160-6000; 010-56517299	95588
传真	010-56517001	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100011	100140
法定代表人	王瑶	廖林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
注册登记机构	国联基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024年		2023年		2022年	
	国联高股息混合A	国联高股息混合C	国联高股息混合A	国联高股息混合C	国联高股息混合A	国联高股息混合C
本期已实现收益	47,796,076.87	45,594,899.86	-4,047,561.72	-3,563,574.35	-10,454,893.97	-7,266,525.52
本期利润	79,600,447.54	83,179,418.82	-2,934,065.67	-2,820,151.62	-14,510,562.72	-9,980,597.72
加权平均基金份额本期利润	0.1894	0.1964	-0.1647	-0.1629	-0.7194	-0.7048
本期加权平均净值利润率	17.86%	18.68%	-14.08%	-14.97%	-48.47%	-49.06%
本期基金份额净值增长率	25.96%	25.28%	-16.31%	-16.97%	-36.09%	-36.60%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	66,102,212.54	70,421,289.10	685,156.64	-1,639,711.37	3,824,369.27	2,273,808.70
期末可供分配基金份额利润	0.1097	0.1071	0.0141	-0.0286	0.2117	0.1700
期末基金资产净值	668,574,259.76	727,945,302.52	49,106,165.32	55,653,127.77	21,886,890.65	15,651,568.28
期末基金份额净值	1.1097	1.1071	1.0141	0.9714	1.2117	1.1700
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	34.24%	27.97%	6.57%	2.15%	27.34%	23.03%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联高股息混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.16%	1.42%	-0.44%	1.15%	2.60%	0.27%
过去六个月	11.67%	1.32%	4.52%	1.09%	7.15%	0.23%
过去一年	25.96%	1.10%	13.27%	0.93%	12.69%	0.17%
过去三年	-32.63%	1.23%	12.12%	0.87%	-44.75%	0.36%
过去五年	25.15%	1.47%	24.49%	0.89%	0.66%	0.58%
自基金合同生效起至今	34.24%	1.44%	30.89%	0.88%	3.35%	0.56%

国联高股息混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.02%	1.42%	-0.44%	1.15%	2.46%	0.27%
过去六个月	11.40%	1.32%	4.52%	1.09%	6.88%	0.23%
过去一年	25.28%	1.10%	13.27%	0.93%	12.01%	0.17%
过去三年	-34.05%	1.23%	12.12%	0.87%	-46.17%	0.36%
过去五年	19.76%	1.47%	24.49%	0.89%	-4.73%	0.58%
自基金合同生效起至今	27.97%	1.44%	30.89%	0.88%	-2.92%	0.56%

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

国联高股息混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年09月26日-2024年12月31日)

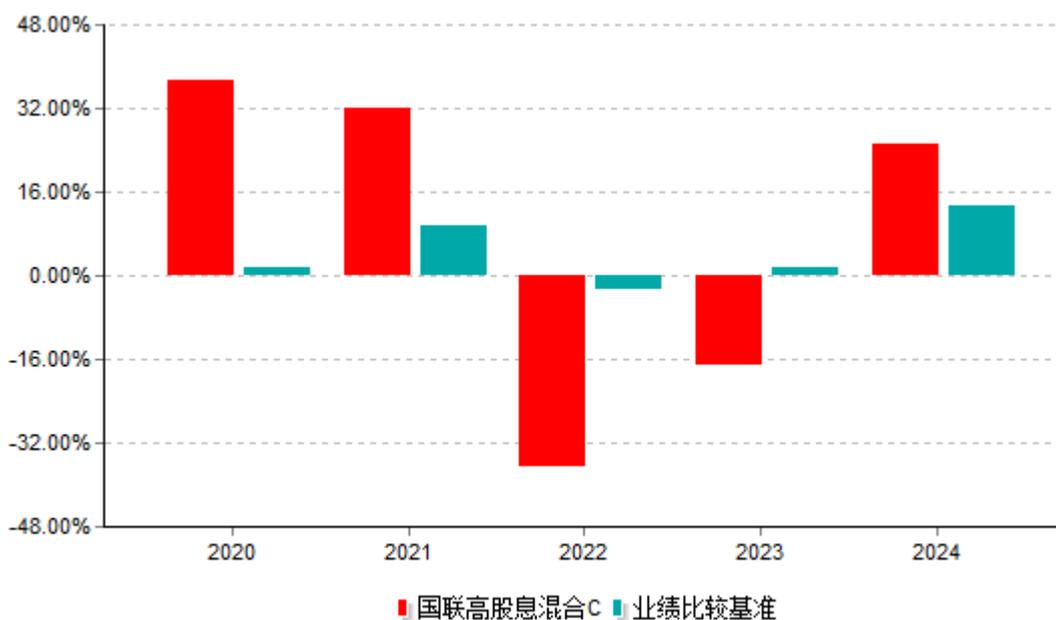
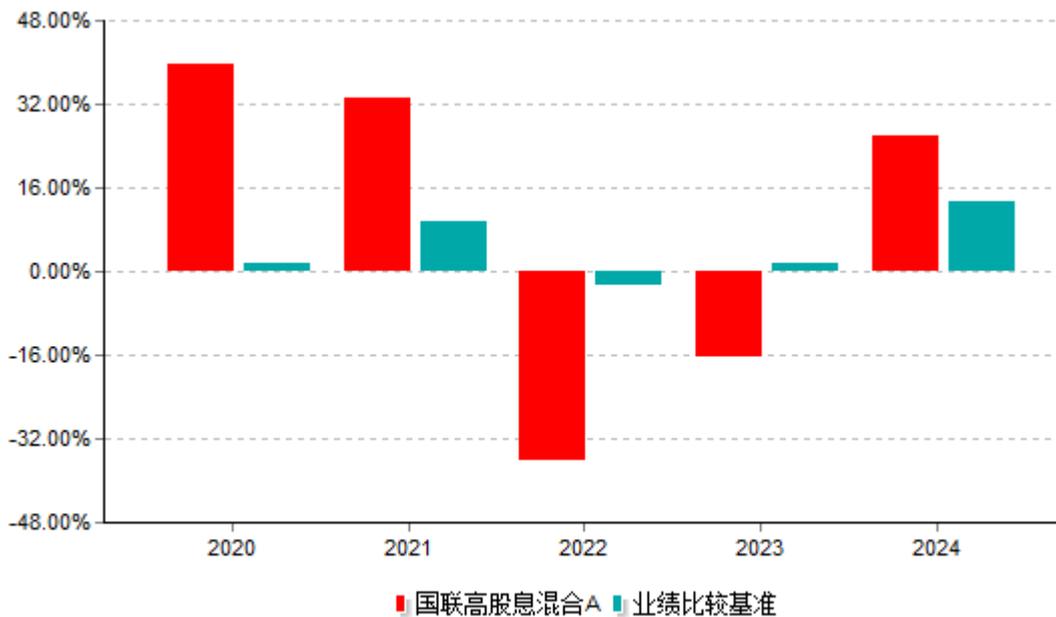


国联高股息混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年09月26日-2024年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。本基金业绩比较基准于2019年12月26日发生变更，由原来的“沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率×10%+上证国债指数收益率×30%”更改为“中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%”。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

国联高股息混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

	红数				
2024年	1.510	37,647,151.88	48,938,816.06	86,585,967.94	-
合计	1.510	37,647,151.88	48,938,816.06	86,585,967.94	-

国联高股息混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024年	1.000	26,722,800.99	23,017,761.12	49,740,562.11	-
合计	1.000	26,722,800.99	23,017,761.12	49,740,562.11	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联民生证券股份有限公司（根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”）与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2024年12月31日，国联基金管理有限公司共管理87只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月

定期开放债券型发起式证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景瑞一年持有期混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联消费精选混合型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
杜超	国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2023-11-07	-	8	杜超先生,中国国籍,毕业于南京航空航天大学计算机科学与技术专业,本科、学士学位,具有基金从业资格,证券从业年限8年。2013年7月至2016年4月任中国银行软件中心开发五部软件工程师。2016年4月加入公司,现任多策略投资部基金经理。
王喆	国联高股息精选混合型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金的基金	2024-05-29	-	9	王喆先生,中国国籍,毕业于北京航空航天大学金融学专业,研究生、硕士学位,具有基金从业资格,证券从业年限9年。2015年1月至2022年4月历任中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部基金研究员、权益投资部基金经理;2022年4月至2023年9月历任中信建投基金管理有限公司特定资产管理部投资经理、多元资产

	经理及公司多策略投资总监、多策略投资部总经理。				配置部投资经理。2023年9月加入公司，现任公司多策略投资总监、多策略投资部总经理。
熊健	国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。	2022-01-13	2024-05-29	6	熊健先生，中国国籍，毕业于英国帝国理工学院风险管理与金融工程专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限6年。2015年9月至2017年11月任苏格兰皇家银行风险控制部管理培训生。2018年1月加入公司，现任研究部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享

有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年A股市场整体呈现波动加剧、结构性机会为主的特征，市场表现受到国内外复杂经济环境的显著影响。年初，市场走势相对疲弱，但随着一系列稳增长政策的出台，资金活跃度提高，市场逐步走出反弹趋势。随后，政策加码预期逐步减弱，市场进入震荡格局，结构性机会成为主导，红利类资产表现较为突出。

下半年，市场行情大幅震荡，但在政策利好的刺激下，股票市场出现大幅反弹，科技、新能源和消费板块一度表现抢眼。然而，随着全球货币政策调整预期升温、地缘政治紧张局势升级以及经济放缓担忧加剧，市场在年底呈现震荡走势，投资者风险偏好明显下降，市场波动加剧。

在全年策略中，我们始终围绕电力及公用事业、银行和交通运输等高股息行业进行重点配置，同时适度增减医药、石油石化、基础化工等行业的比重，灵活抓住结构性机会。我们坚持选择具有长期稳定业绩增长的优质标的，力求在多变的市场环境中实现稳健的投资回报，持续优化投资组合。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联高股息混合A基金份额净值为1.1097元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.96%，同期业绩比较基准收益率为13.27%；截至报告期末国联高股息混合C基金份额净值为1.1071元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为25.28%，同期业绩比较基准收益率为13.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年，我们对中国经济和股票市场持谨慎乐观态度。从整体来看，2024年的经济修复为2025年奠定了坚实基础，多数指标显示今年经济增速有望维持稳健增长，消费复苏与科技创新将成为主要驱动力。从政策角度，货币政策适度宽松以及扩大内需的战略，为资本市场提供了稳定的支撑。

在股市方面，A股市场大概率延续震荡向上的格局。虽然短期内可能受到外部扰动，但从长期视角看，宏观经济的稳健复苏和企业盈利的提升将持续推动市场上涨。随着AI、半导体以及新能源等领域的技术突破与应用落地，科技板块将继续成为市场的焦点。电子、计算机等新兴产业具备显著的投资吸引力，预计在政策支持和资本投入下，将迎来更大的发展空间。

与此同时，红利类标的也值得关注。在低利率环境下，高股息资产对投资者的吸引力显著增强，不仅提供了稳定的收益，还兼具良好的抗风险能力。在经济复苏和消费升级的大背景下，消费、银行等领域的红利标的有望在稳健投资者中继续受到青睐。

展望全年，建议投资者坚持长期主义，把握科技成长与红利稳定两大主线，合理配置资产，关注结构性机会，同时保持灵活性以应对市场波动。相信中国经济的持续复苏将为资本市场带来更多积极变化。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中，一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发，由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，推动公司内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议，并跟踪改进落实情况。本报告期内，公司内部控制体系运行顺利，本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- 1、根据基金监管法律法规的最新变化，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，以投资决策委员会为最高投资决策机构，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同的约定。2024年6月26日，国联高股息混合A每10份分配1.28元，国联高股息混合C每10份分配0.77元；2024年12月19日，国联高股息混合A每10份分配0.23元，国联高股息混合C每10份分配0.23元。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--国联基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国联基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2025）第1580号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国联高股息精选混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了国联高股息精选混合型证券投资基金(以下简称"国联高股息混合")财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。  我们认为，后附国联高股息混合的财务报表在所

	<p>有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联高股息精选混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了国联高股息混合2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联高股息混合，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国联高股息混合管理人(以下简称“管理人”)根据《国联高股息精选混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的，因此财务报表可能不适于其他用途。本报告仅供管理人提供国联高股息混合份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
<p>其他信息</p>	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国联高股息混合2024年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p>

	<p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联高股息精选混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估国联高股息混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的</li> </ol>



<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	28,465,752.51	10,877,245.47
结算备付金		6,241,396.90	114,381.49
存出保证金		394,617.46	21,547.53
交易性金融资产	7.4.7.2	1,406,640,068.73	101,674,621.70
其中：股票投资		1,319,863,012.84	95,764,914.30
基金投资		-	-
债券投资		86,777,055.89	5,909,707.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,797,924.66	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		33,094,054.34	7,504,008.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,487,633,814.60	120,191,804.69
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,092,010.88	4,603,261.07
应付清算款		18,451,295.34	10,523,774.47
应付赎回款		211,774.64	6,343.55
应付管理人报酬		632,132.54	60,005.35
应付托管费		210,710.86	10,000.88

应付销售服务费		240,229.56	23,059.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,276,098.50	206,066.61
负债合计		91,114,252.32	15,432,511.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,259,996,060.64	105,713,847.82
未分配利润	7.4.7.8	136,523,501.64	-954,554.73
净资产合计		1,396,519,562.28	104,759,293.09
负债和净资产总计		1,487,633,814.60	120,191,804.69

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额1,259,996,060.64份，其中A类基金份额的份额总额为602,472,047.22份，份额净值1.1097元；C类基金份额的份额总额为657,524,013.42份，份额净值1.1071元。

## 7.2 利润表

会计主体：国联高股息精选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		173,308,241.71	-4,882,184.91
1.利息收入		369,020.13	13,049.98
其中：存款利息收入	7.4.7.9	197,555.27	13,049.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		171,464.86	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		102,908,372.09	-6,880,566.01
其中：股票投资收益	7.4.7.10	59,446,344.93	-7,366,956.24
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,155,976.15	42,086.40
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	12,929.16
股利收益	7.4.7.16	42,306,051.01	431,374.67
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	69,388,889.63	1,856,918.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	641,959.86	128,412.34
<b>减：二、营业总支出</b>		10,528,375.35	872,032.38
1.管理人报酬		5,333,196.46	547,721.22
2.托管费		1,768,711.87	91,286.88
3.销售服务费		2,240,361.11	152,164.59
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,013,179.95	8,911.44
其中：卖出回购金融资产支出		1,013,179.95	8,911.44
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	46.67
8.其他费用	7.4.7.20	172,925.96	71,901.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		162,779,866.36	-5,754,217.29
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		162,779,866.36	-5,754,217.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		162,779,866.36	-5,754,217.29

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国联高股息精选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	105,713,847.82	-954,554.73	104,759,293.09
二、本期期初净资产	105,713,847.82	-954,554.73	104,759,293.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,154,282,212.82	137,478,056.37	1,291,760,269.19
（一）、综合收益总额	-	162,779,866.36	162,779,866.36
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,154,282,212.82	111,024,720.06	1,265,306,932.88
其中：1.基金申购款	1,963,756,482.49	141,153,362.92	2,104,909,845.41
2.基金赎回款	-809,474,269.67	-30,128,642.86	-839,602,912.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-136,326,530.05	-136,326,530.05

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	1,259,996,060.64	136,523,501.64	1,396,519,562.28
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	31,440,280.96	6,098,177.97	37,538,458.93
二、本期期初净资产	31,440,280.96	6,098,177.97	37,538,458.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	74,273,566.86	-7,052,732.70	67,220,834.16
（一）、综合收益总额	-	-5,754,217.29	-5,754,217.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	74,273,566.86	-1,298,515.41	72,975,051.45
其中：1.基金申购款	109,066,206.56	1,427,375.88	110,493,582.44
2.基金赎回款	-34,792,639.70	-2,725,891.29	-37,518,530.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	105,713,847.82	-954,554.73	104,759,293.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

周妹云

李克

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国联高股息精选混合型证券投资基金(原名为中融高股息精选混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]967号《关于准予中融沪港深高股息精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2019]1255号《关于准予中融沪港深高股息精选灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融高股息精选混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)负责公开募集,于2019年9月26日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联高股息精选混合型证券投资基金。

本基金募集期为自2019年9月6日至2019年9月24日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金1,219,686,517.58元,折合1,219,686,517.58份国联高股息混合基金份额(其中:A类基金份额为1,022,287,538.10份;C类基金份额为197,398,979.48份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币325,815.39元,折合325,815.39份国联高股息混合基金份额(其中:A类基金份额为271,348.00份;C类基金份额为54,467.39份),以上收到的实收基金共计人民币1,220,012,332.97元,折合1,220,012,332.97份国联高股息混合基金份额(其中:A类基金份额为1,022,558,886.10份;C类基金份额为197,453,446.87份),有效认购户数为7021户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(港股通标的股票)债券(包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、次级债等)、资产支持证券、银行存款、债券回购、同业存单、股指期货、国债期货、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为:中证

红利指数收益率×70% + 中证港股通高股息投资指数收益率×10% + 上证国债指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

### ① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 1) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### ② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金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)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金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。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值，估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值；

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金

融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46

号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

3、证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	28,465,752.51	10,877,245.47
等于：本金	28,460,843.95	10,876,563.22
加：应计利息	4,908.56	682.25
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以 内	-	-
存款期限1-3个 月	-	-
存款期限3个月 以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	28,465,752.51	10,877,245.47

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,250,196,435.8 0	-	1,319,863,012.8 4	69,666,577.04
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	85,847,084.00	936,735.89	86,777,055.89	-6,764.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	85,847,084.00	936,735.89	86,777,055.89	-6,764.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,336,043,519.80	936,735.89	1,406,640,068.73	69,659,813.04
项目	上年度末 2023年12月31日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		95,498,679.89	-	95,764,914.30	266,234.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,799,951.00	105,067.40	5,909,707.40	4,689.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,799,951.00	105,067.40	5,909,707.40	4,689.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		101,298,630.89	105,067.40	101,674,621.70	270,923.41

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,797,924.66	-

银行间市场	-	-
合计	12,797,924.66	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	24.17	0.67
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,231,074.33	136,065.94
其中：交易所市场	1,231,074.33	136,065.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	45,000.00	70,000.00
合计	1,276,098.50	206,066.61

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 国联高股息混合A

金额单位：人民币元

项目 (国联高股息混合A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,421,008.68	48,421,008.68
本期申购	741,344,375.61	741,344,375.61
本期赎回(以“-”号填列)	-187,293,337.07	-187,293,337.07
本期末	602,472,047.22	602,472,047.22

#### 7.4.7.7.2 国联高股息混合C

金额单位：人民币元

项目 (国联高股息混合C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	57,292,839.14	57,292,839.14
本期申购	1,222,412,106.88	1,222,412,106.88
本期赎回(以“-”号填列)	-622,180,932.60	-622,180,932.60
本期末	657,524,013.42	657,524,013.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 国联高股息混合A

单位：人民币元

项目 (国联高股息混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,308,921.79	-32,623,765.15	685,156.64
本期期初	33,308,921.79	-32,623,765.15	685,156.64
本期利润	47,796,076.87	31,804,370.67	79,600,447.54
本期基金份额交易产生的变动数	421,068,217.27	-348,665,640.97	72,402,576.30
其中：基金申购款	546,743,408.37	-465,004,115.82	81,739,292.55
基金赎回款	-125,675,191.10	116,338,474.85	-9,336,716.25
本期已分配利润	-86,585,967.94	-	-86,585,967.94

本期末	415,587,247.99	-349,485,035.45	66,102,212.54
-----	----------------	-----------------	---------------

#### 7.4.7.8.2 国联高股息混合C

单位：人民币元

项目 (国联高股息混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,136,401.15	-37,776,112.52	-1,639,711.37
本期期初	36,136,401.15	-37,776,112.52	-1,639,711.37
本期利润	45,594,899.86	37,584,518.96	83,179,418.82
本期基金份额交易产生的变动数	410,869,201.82	-372,247,058.06	38,622,143.76
其中：基金申购款	811,941,335.97	-752,527,265.60	59,414,070.37
基金赎回款	-401,072,134.15	380,280,207.54	-20,791,926.61
本期已分配利润	-49,740,562.11	-	-49,740,562.11
本期末	442,859,940.72	-372,438,651.62	70,421,289.10

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	120,674.92	8,617.01
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	59,385.58	4,061.38
其他	17,494.77	371.59
合计	197,555.27	13,049.98

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
卖出股票成交总额	3,676,709,951.39	291,904,836.93
减：卖出股票成本总额	3,610,213,174.89	298,469,775.32
减：交易费用	7,050,431.57	802,017.85
买卖股票差价收入	59,446,344.93	-7,366,956.24

#### 7.4.7.11 基金投资收益

注：无。

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	1,292,760.07	42,045.80
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-136,783.92	40.60
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	1,155,976.15	42,086.40

##### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	109,444,272.36	6,000,118.47

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	107,486,945.92	5,884,376.40
减：应计利息总额	2,094,110.36	115,701.47
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-136,783.92	40.60

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
卖出权证成交总额	-	13,352.06
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	-	34.00
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	388.90
买卖权证差价收入	-	12,929.16

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	42,306,051.01	431,374.67
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	42,306,051.01	431,374.67
----	---------------	------------

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	69,388,889.63	1,856,918.78
——股票投资	69,400,342.63	1,847,863.88
——债券投资	-11,453.00	9,054.90
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	69,388,889.63	1,856,918.78

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	633,762.11	128,410.93
转换费收入	8,197.75	1.41
合计	641,959.86	128,412.34

#### 7.4.7.19 信用减值损失

注：无。

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	45,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	7,925.96	1,901.58
合计	172,925.96	71,901.58

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联民生证券股份有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：（1）根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国联民生证券股份有限公司	1,780,049,732.54	21.09%	-	-

**7.4.10.1.2 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国联民生证券股份有限公司	675,000,000.00	22.94%	-	-

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联民生证券股份有限公司	793,711.89	16.99%	299,665.31	24.34%

注：上述佣金计算符合监管部门对于公募基金佣金的相关规定。关联方为本产品提供清算等交易类型、以及研究服务（如有）。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,333,196.46	547,721.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	771,489.71	229,651.33
应支付基金管理人的净管理费	4,561,706.75	318,069.89

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

（2）客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

（3）根据《国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金调低管理费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自2024年1月15日起，本基金管理费率由1.20%变更为0.60%。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,768,711.87	91,286.88

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联高股息混合A	国联高股息混合C	合计
国联基金管理有限公司	0.00	1,277,656.90	1,277,656.90
中国工商银行股份有限公司	0.00	21,164.73	21,164.73
合计	-	1,298,821.63	1,298,821.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联高股息混合A	国联高股息混合C	合计
国联基金管理有限公司	0.00	6,560.55	6,560.55
中国工商银行股份有限公司	0.00	38,168.78	38,168.78

有限公司			
合计	0.00	44,729.33	44,729.33

注：（1）支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.50%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：

C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.50%/当年天数。

（2）根据《国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金调低C类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告》，自2024年2月2日起，本基金C类份额的销售服务费率由0.80%调低至0.50%。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	28,465,752.51	120,674.92	10,877,245.47	8,617.01

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金**

国联高股息混合A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2024-0 6-26	2024-06-2 6	1.280	34,457,78 5.47	37,692,022. 97	72,149,80 8.44	-
2	2024-1 2-19	2024-12-1 9	0.230	3,189,36 6.41	11,246,793. 09	14,436,15 9.50	-
合计			1.510	37,647,15 1.88	48,938,816. 06	86,585,96 7.94	-

国联高股息混合C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2024-0 6-26	2024-06-2 6	0.770	22,146,18 0.18	15,804,544. 49	37,950,72 4.67	-
2	2024-1 2-19	2024-12-1 9	0.230	4,576,62 0.81	7,213,216.6 3	11,789,83 7.44	-
合计			1.000	26,722,80 0.99	23,017,761. 12	49,740,56 2.11	-

**7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	受限期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位:股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注

688615	合合信息	2024-09-19	6个月	首次公开发售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月	首次公开发售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	首次公开发售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	首次公开发售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内(含)	新股未流通	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	首次公开发售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月	首次公开发售	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	首次公开发售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6个月	首次公开	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-

				发行 限售							
3015 71	国科 天成	2024 -08-1 4	6个月	首次 公开发 行 限售	11.14	40.83	350	3,89 9.00	14,29 0.50	-	
3016 13	新铝 时代	2024 -10-1 8	6个月	首次 公开发 行 限售	27.70	41.77	276	7,64 5.20	11,52 8.52	-	
3015 86	佳力 奇	2024 -08-2 1	6个月	首次 公开发 行 限售	18.09	53.14	215	3,88 9.35	11,42 5.10	-	
3016 17	博苑 股份	2024 -12-0 3	6个月	首次 公开发 行 限售	27.76	39.79	253	7,02 3.28	10,06 6.87	-	
3016 03	乔锋 智能	2024 -07-0 3	6个月	首次 公开发 行 限售	26.50	41.98	233	6,17 4.50	9,78 1.34	-	
3016 07	富特 科技	2024 -08-2 8	6个月	首次 公开发 行 限售	14.00	36.14	257	3,59 8.00	9,28 7.98	-	
3015 52	科力 装备	2024 -07-1 5	6个月	首次 公开发 行 限售	30.00	56.87	143	4,29 0.00	8,13 2.41	-	
0012 79	强邦 新材	2024 -09-2 7	6个月	首次 公开发 行 限售	9.68	27.91	265	2,56 5.20	7,39 6.15	-	

603395	红四方	2024-11-19	6个月	首次公开发售	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6个月	首次公开发售	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月	首次公开发售	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月	首次公开发售	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月	首次公开发售	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	首次公开发售	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发售	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	首次公开发售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末2024年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额70,092,010.88元，于2025年01月02日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
货币资金	28,465,752.51	-	-	-	28,465,752.51
结算备付金	6,241,396.90	-	-	-	6,241,396.90
存出保证金	394,617.46	-	-	-	394,617.46
交易性金融资产	86,777,055.89	-	-	1,319,863,012.84	1,406,640,068.73
买入返售金融资产	12,797,924.66	-	-	-	12,797,924.66
应收申购款	-	-	-	33,094,054.34	33,094,054.34
资产总计	134,676,747.42	-	-	1,352,957,067.18	1,487,633,814.60
负债					
卖出回购金融资产款	70,092,010.88	-	-	-	70,092,010.88
应付清算款	-	-	-	18,451,295.34	18,451,295.34
应付赎回款	-	-	-	211,774.64	211,774.64
应付管理人报酬	-	-	-	632,132.54	632,132.54
应付托管费	-	-	-	210,710.86	210,710.86
应付销售服务费	-	-	-	240,229.56	240,229.56
其他负债	-	-	-	1,276,098.50	1,276,098.50
负债总计	70,092,010.88	-	-	21,022,241.44	91,114,252.32

计					
利率敏 感度缺 口	64,584,736.54	-	-	1,331,934,825.74	1,396,519,562.28
上年度 末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	10,877,245.47	-	-	-	10,877,245.47
结算备 付金	114,381.49	-	-	-	114,381.49
存出保 证金	21,547.53	-	-	-	21,547.53
交易性 金融资 产	5,909,707.40	-	-	95,764,914.30	101,674,621.70
应收申 购款	-	-	-	7,504,008.50	7,504,008.50
资产总 计	16,922,881.89	-	-	103,268,922.80	120,191,804.69
负债					
卖出回 购金融 资产款	4,603,261.07	-	-	-	4,603,261.07
应付清 算款	-	-	-	10,523,774.47	10,523,774.47
应付赎 回款	-	-	-	6,343.55	6,343.55
应付管 理人报 酬	-	-	-	60,005.35	60,005.35
应付托 管费	-	-	-	10,000.88	10,000.88
应付销	-	-	-	23,059.67	23,059.67

售服务费					
其他负债	-	-	-	206,066.61	206,066.61
负债总计	4,603,261.07	-	-	10,829,250.53	15,432,511.60
利率敏感度缺口	12,319,620.82	-	-	92,439,672.27	104,759,293.09

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,319,863,012.84	94.51	95,764,914.30	91.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	86,777,055.89	6.21	5,909,707.40	5.64
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,406,640,068.73	100.72	101,674,621.70	97.06

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	沪深300指数上升5%	46,775,164.35	3,869,971.71
	沪深300指数下降5%	-46,775,164.35	-3,869,971.71

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,319,509,743.05	95,764,914.30
第二层次	86,804,792.39	5,909,707.40
第三层次	325,533.29	-
合计	1,406,640,068.73	101,674,621.70

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	150,105.73	150,105.73
转出第三层次	-	39,905.34	39,905.34
当期利得或损失总额	-	215,332.90	215,332.90
其中：计入损益的利得或损失	-	215,332.90	215,332.90
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	325,533.29	325,533.29
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	203,800.96	203,800.96
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	325,533.29	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2665-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### §8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,319,863,012.84	88.72
	其中：股票	1,319,863,012.84	88.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	86,777,055.89	5.83
	其中：债券	86,777,055.89	5.83
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	12,797,924.66	0.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,707,149.41	2.33
8	其他各项资产	33,488,671.80	2.25
9	合计	1,487,633,814.60	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	119,904,442.46	8.59
C	制造业	368,747,723.51	26.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	192,855,759.87	13.81
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	61,473,855.10	4.40
G	交通运输、仓储和邮政业	228,577,595.68	16.37
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,013,226.73	1.58
J	金融业	238,911,974.63	17.11
K	房地产业	13,103,222.00	0.94
L	租赁和商务服务业	27,850,393.42	1.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,164,871.44	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	27,259,948.00	1.95
S	综合	-	-
	合计	1,319,863,012.84	94.51

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	5,669,100	31,236,741.00	2.24
2	600548	深高速	2,232,614	30,095,636.72	2.16
3	002818	富森美	1,819,293	27,180,237.42	1.95
4	600803	新奥股份	1,214,068	26,320,994.24	1.88
5	002911	佛燃能源	2,078,542	26,272,770.88	1.88
6	002831	裕同科技	950,400	25,755,840.00	1.84
7	600028	中国石化	3,834,300	25,613,124.00	1.83
8	601088	中国神华	585,600	25,461,888.00	1.82
9	600018	上港集团	4,114,300	25,179,516.00	1.80
10	000429	粤高速 A	1,704,000	25,048,800.00	1.79

11	600033	福建高速	6,218,600	24,128,168.00	1.73
12	002540	亚太科技	3,882,800	23,918,048.00	1.71
13	601818	光大银行	6,166,400	23,863,968.00	1.71
14	601811	新华文轩	1,491,700	23,643,445.00	1.69
15	601006	大秦铁路	3,479,496	23,590,982.88	1.69
16	601857	中国石油	2,581,300	23,076,822.00	1.65
17	600269	赣粤高速	4,086,700	22,926,387.00	1.64
18	600015	华夏银行	2,819,900	22,587,399.00	1.62
19	600968	海油发展	5,158,500	22,026,795.00	1.58
20	601728	中国电信	3,036,200	21,921,364.00	1.57
21	001323	慕思股份	561,011	21,211,825.91	1.52
22	600350	山东高速	2,044,000	21,012,320.00	1.50
23	600886	国投电力	1,186,110	19,713,148.20	1.41
24	600710	苏美达	2,115,697	19,675,982.10	1.41
25	601827	三峰环境	2,233,668	19,164,871.44	1.37
26	002004	华邦健康	4,225,800	19,100,616.00	1.37
27	600863	内蒙华电	4,391,300	19,014,329.00	1.36
28	600177	雅戈尔	2,114,705	18,820,874.50	1.35
29	601169	北京银行	3,056,900	18,799,935.00	1.35
30	600900	长江电力	632,400	18,687,420.00	1.34
31	600098	广州发展	2,879,400	18,485,748.00	1.32
32	605599	菜百股份	1,546,800	17,556,180.00	1.26
33	601229	上海银行	1,906,790	17,447,128.50	1.25
34	600019	宝钢股份	2,464,761	17,253,327.00	1.24
35	601998	中信银行	2,420,070	16,892,088.60	1.21
36	002318	久立特材	721,100	16,880,951.00	1.21
37	601288	农业银行	3,156,600	16,856,244.00	1.21
38	600642	申能股份	1,753,500	16,640,715.00	1.19
39	601328	交通银行	2,067,006	16,060,636.62	1.15
40	002233	塔牌集团	2,073,200	15,901,444.00	1.14
41	601163	三角轮胎	1,028,380	15,497,686.60	1.11

42	603301	振德医疗	688,100	15,131,319.00	1.08
43	601577	长沙银行	1,672,600	14,869,414.00	1.06
44	601658	邮储银行	2,601,100	14,774,248.00	1.06
45	000333	美的集团	185,100	13,923,222.00	1.00
46	600987	航民股份	1,986,000	13,782,840.00	0.99
47	600648	外高桥	1,133,800	13,503,558.00	0.97
48	600007	中国国贸	535,700	13,103,222.00	0.94
49	000651	格力电器	284,800	12,944,160.00	0.93
50	601139	深圳燃气	1,823,340	12,872,780.40	0.92
51	601326	秦港股份	3,837,300	12,854,955.00	0.92
52	600741	华域汽车	713,100	12,557,691.00	0.90
53	600282	南钢股份	2,628,600	12,328,134.00	0.88
54	600873	梅花生物	1,211,500	12,151,345.00	0.87
55	600008	首创环保	3,466,400	11,369,792.00	0.81
56	601166	兴业银行	575,900	11,034,244.00	0.79
57	601568	北元集团	2,593,600	10,893,120.00	0.78
58	601963	重庆银行	1,156,776	10,734,881.28	0.77
59	600690	海尔智家	374,400	10,659,168.00	0.76
60	600717	天津港	2,168,884	10,562,465.08	0.76
61	600618	氯碱化工	1,033,900	10,194,254.00	0.73
62	000895	双汇发展	389,688	10,116,300.48	0.72
63	000902	新洋丰	726,900	9,478,776.00	0.68
64	600012	皖通高速	536,200	9,463,930.00	0.68
65	000883	湖北能源	1,872,000	9,322,560.00	0.67
66	600020	中原高速	2,142,950	9,043,249.00	0.65
67	600582	天地科技	1,399,400	8,648,292.00	0.62
68	000967	盈峰环境	1,711,800	8,507,646.00	0.61
69	601898	中煤能源	660,600	8,046,108.00	0.58
70	601665	齐鲁银行	1,372,057	7,669,798.63	0.55
71	002978	安宁股份	247,063	7,021,530.46	0.50
72	000019	深粮控股	1,027,900	6,753,303.00	0.48

73	000582	北部湾港	835,700	6,585,316.00	0.47
74	600585	海螺水泥	262,700	6,247,006.00	0.45
75	600295	鄂尔多斯	630,496	6,153,640.96	0.44
76	600795	国电电力	1,287,400	5,896,292.00	0.42
77	603053	成都燃气	571,905	5,736,207.15	0.41
78	601009	南京银行	525,100	5,592,315.00	0.40
79	600256	广汇能源	726,500	4,889,345.00	0.35
80	002003	伟星股份	343,000	4,860,310.00	0.35
81	600997	开滦股份	707,600	4,783,376.00	0.34
82	600017	日照港	1,427,400	4,567,680.00	0.33
83	601609	金田股份	699,700	4,128,230.00	0.30
84	600583	海油工程	689,000	3,768,830.00	0.27
85	601311	骆驼股份	453,500	3,759,515.00	0.27
86	600757	长江传媒	377,900	3,616,503.00	0.26
87	001965	招商公路	252,200	3,518,190.00	0.25
88	600511	国药股份	102,800	3,517,816.00	0.25
89	601825	沪农商行	351,300	2,989,563.00	0.21
90	600025	华能水电	265,300	2,523,003.00	0.18
91	600919	江苏银行	256,300	2,516,866.00	0.18
92	601319	中国人保	274,839	2,094,273.18	0.15
93	002948	青岛银行	466,800	1,811,184.00	0.13
94	000513	丽珠集团	39,390	1,496,820.00	0.11
95	000030	富奥股份	227,200	1,165,536.00	0.08
96	600000	浦发银行	105,058	1,081,046.82	0.08
97	000061	农产品	95,600	670,156.00	0.05
98	002091	江苏国泰	63,800	467,016.00	0.03
99	603699	纽威股份	10,600	235,002.00	0.02
100	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
101	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
102	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
103	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00

104	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
105	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
106	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
107	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
108	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
109	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
110	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
111	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
112	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
113	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
114	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
115	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
116	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
117	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
118	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
119	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
120	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
121	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
122	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
123	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	69,401,646.00	66.25
2	601328	交通银行	56,474,320.94	53.91
3	601006	大秦铁路	54,260,631.16	51.80
4	601339	百隆东方	50,995,642.00	48.68

5	600704	物产中大	50,230,233.03	47.95
6	600803	新奥股份	49,003,893.44	46.78
7	601318	中国平安	48,315,833.99	46.12
8	600717	天津港	47,842,158.12	45.67
9	002911	佛燃能源	47,689,427.12	45.52
10	002831	裕同科技	47,466,201.10	45.31
11	600018	上港集团	45,386,344.99	43.32
12	603053	成都燃气	43,963,120.96	41.97
13	000333	美的集团	43,806,967.74	41.82
14	600039	四川路桥	43,226,327.41	41.26
15	002004	华邦健康	43,150,355.00	41.19
16	001872	招商港口	42,653,315.04	40.72
17	600956	新天绿能	42,515,795.20	40.58
18	600710	苏美达	42,488,725.06	40.56
19	000429	粤高速 A	42,479,669.69	40.55
20	601577	长沙银行	42,272,465.00	40.35
21	601827	三峰环境	41,365,718.43	39.49
22	601658	邮储银行	40,615,597.00	38.77
23	601088	中国神华	39,091,660.00	37.32
24	601139	深圳燃气	38,685,248.30	36.93
25	601288	农业银行	38,363,665.00	36.62
26	600019	宝钢股份	38,195,330.61	36.46
27	600741	华域汽车	37,812,572.00	36.09
28	600033	福建高速	37,665,052.00	35.95
29	600028	中国石化	37,601,980.00	35.89
30	601963	重庆银行	37,307,486.98	35.61
31	601811	新华文轩	37,062,024.00	35.38
32	002818	富森美	36,973,184.49	35.29
33	600177	雅戈尔	36,880,955.06	35.21
34	600104	上汽集团	36,850,393.00	35.18
35	601818	光大银行	36,635,412.00	34.97

36	001323	慕思股份	36,408,944.41	34.75
37	601568	北元集团	36,084,389.70	34.45
38	600282	南钢股份	36,011,570.00	34.38
39	600269	赣粤高速	35,672,814.00	34.05
40	601668	中国建筑	35,659,420.00	34.04
41	601857	中国石油	35,453,112.00	33.84
42	600015	华夏银行	34,313,099.00	32.75
43	601607	上海医药	34,246,595.00	32.69
44	601229	上海银行	34,149,048.00	32.60
45	601998	中信银行	33,805,937.60	32.27
46	002034	旺能环境	33,775,593.00	32.24
47	600585	海螺水泥	33,735,527.05	32.20
48	601166	兴业银行	33,276,340.00	31.76
49	601169	北京银行	32,897,277.00	31.40
50	000708	中信特钢	32,892,378.95	31.40
51	601298	青岛港	32,188,121.00	30.73
52	600016	民生银行	32,168,118.00	30.71
53	605599	菜百股份	31,996,745.00	30.54
54	600886	国投电力	31,986,057.60	30.53
55	000088	盐田港	31,913,589.16	30.46
56	000582	北部湾港	31,592,877.00	30.16
57	600582	天地科技	31,582,054.00	30.15
58	000902	新洋丰	31,515,196.98	30.08
59	000012	南玻A	31,432,028.00	30.00
60	000651	格力电器	30,923,293.93	29.52
61	002978	安宁股份	30,789,449.87	29.39
62	601728	中国电信	30,462,024.00	29.08
63	600332	白云山	30,133,091.00	28.76
64	002948	青岛银行	30,090,364.60	28.72
65	600350	山东高速	29,916,742.00	28.56
66	601319	中国人保	29,675,816.00	28.33

67	601187	厦门银行	29,608,388.00	28.26
68	600873	梅花生物	29,589,175.00	28.24
69	600968	海油发展	29,569,355.00	28.23
70	601326	秦港股份	28,722,157.00	27.42
71	600548	深高速	28,491,295.88	27.20
72	002267	陕天然气	27,380,445.00	26.14
73	600377	宁沪高速	27,108,066.42	25.88
74	000895	双汇发展	27,008,749.84	25.78
75	600511	国药股份	26,626,992.00	25.42
76	600167	联美控股	26,596,216.58	25.39
77	600000	浦发银行	26,400,649.57	25.20
78	600900	长江电力	26,376,353.69	25.18
79	000513	丽珠集团	26,370,644.34	25.17
80	600050	中国联通	26,142,593.00	24.95
81	601825	沪农商行	26,126,713.00	24.94
82	600998	九州通	25,916,344.76	24.74
83	002003	伟星股份	25,834,075.52	24.66
84	601916	浙商银行	25,799,102.00	24.63
85	002563	森马服饰	25,717,784.97	24.55
86	002540	亚太科技	25,291,980.00	24.14
87	002233	塔牌集团	25,118,116.00	23.98
88	600690	海尔智家	24,785,536.52	23.66
89	600098	广州发展	24,396,924.00	23.29
90	601009	南京银行	24,393,368.00	23.29
91	600618	氯碱化工	24,163,825.00	23.07
92	600008	首创环保	24,137,768.00	23.04
93	000027	深圳能源	23,940,695.00	22.85
94	600887	伊利股份	23,709,330.00	22.63
95	603156	养元饮品	23,559,562.77	22.49
96	605507	国邦医药	22,749,426.00	21.72
97	601216	君正集团	22,669,960.97	21.64

98	601107	四川成渝	21,710,487.00	20.72
99	601665	齐鲁银行	21,336,380.97	20.37
100	600863	内蒙华电	20,190,338.00	19.27
101	601618	中国中冶	19,706,809.00	18.81
102	600755	厦门国贸	19,588,464.00	18.70
103	600089	特变电工	19,495,895.60	18.61
104	002701	奥瑞金	19,263,069.80	18.39
105	002318	久立特材	19,208,825.00	18.34
106	601390	中国中铁	19,117,974.00	18.25
107	600295	鄂尔多斯	18,986,099.64	18.12
108	003816	中国广核	18,540,804.00	17.70
109	603639	海利尔	18,476,323.00	17.64
110	002216	三全食品	18,338,838.18	17.51
111	000967	盈峰环境	18,284,999.00	17.45
112	600057	厦门象屿	18,191,054.00	17.36
113	600007	中国国贸	18,099,129.69	17.28
114	601163	三角轮胎	17,845,646.95	17.03
115	600064	南京高科	17,423,130.20	16.63
116	600309	万华化学	17,365,169.00	16.58
117	601868	中国能建	17,327,445.00	16.54
118	001213	中铁特货	17,119,042.00	16.34
119	002304	洋河股份	16,940,162.00	16.17
120	601186	中国铁建	16,796,756.00	16.03
121	603301	振德医疗	16,684,440.00	15.93
122	600273	嘉化能源	16,659,181.54	15.90
123	600642	申能股份	16,208,128.00	15.47
124	601098	中南传媒	16,015,379.65	15.29
125	002048	宁波华翔	15,987,131.78	15.26
126	000019	深粮控股	15,983,947.11	15.26
127	600496	精工钢构	15,502,295.00	14.80
128	600820	隧道股份	15,461,858.00	14.76

129	600926	杭州银行	15,296,247.00	14.60
130	600987	航民股份	14,959,457.00	14.28
131	301035	润丰股份	14,778,059.00	14.11
132	600648	外高桥	14,627,869.00	13.96
133	002275	桂林三金	14,578,717.00	13.92
134	000596	古井贡酒	14,544,605.00	13.88
135	600248	陕建股份	14,464,182.00	13.81
136	600787	中储股份	14,059,294.00	13.42
137	600919	江苏银行	13,918,972.50	13.29
138	601628	中国人寿	13,785,059.00	13.16
139	600017	日照港	13,458,650.00	12.85
140	600905	三峡能源	13,081,780.00	12.49
141	688819	天能股份	13,055,557.05	12.46
142	600036	招商银行	12,853,682.00	12.27
143	600757	长江传媒	12,352,363.00	11.79
144	600655	豫园股份	12,347,499.00	11.79
145	600519	贵州茅台	12,302,585.00	11.74
146	600346	恒力石化	12,148,466.00	11.60
147	601877	正泰电器	12,071,016.00	11.52
148	000061	农产品	12,008,676.00	11.46
149	600674	川投能源	11,750,568.47	11.22
150	000883	湖北能源	11,747,436.00	11.21
151	600997	开滦股份	11,736,317.34	11.20
152	002677	浙江美大	11,617,597.00	11.09
153	300146	汤臣倍健	11,447,215.00	10.93
154	300999	金龙鱼	11,376,029.00	10.86
155	002311	海大集团	11,272,064.50	10.76
156	002091	江苏国泰	11,246,083.00	10.74
157	000858	五粮液	11,023,881.00	10.52
158	601225	陕西煤业	10,896,666.00	10.40
159	600012	皖通高速	10,874,731.00	10.38

160	601898	中煤能源	10,586,514.00	10.11
161	600502	安徽建工	10,583,944.00	10.10
162	601077	渝农商行	10,462,189.00	9.99
163	002032	苏泊尔	10,407,027.02	9.93
164	688425	铁建重工	10,361,177.07	9.89
165	002958	青农商行	10,224,532.00	9.76
166	600398	海澜之家	9,539,060.00	9.11
167	601669	中国电建	9,491,556.00	9.06
168	600020	中原高速	9,430,131.50	9.00
169	601211	国泰君安	9,420,443.96	8.99
170	000685	中山公用	9,047,477.00	8.64
171	600323	瀚蓝环境	8,939,164.00	8.53
172	601311	骆驼股份	8,663,914.30	8.27
173	300888	稳健医疗	8,519,637.44	8.13
174	603195	公牛集团	8,254,282.60	7.88
175	600380	健康元	7,987,476.00	7.62
176	601766	中国中车	7,826,601.00	7.47
177	000030	富奥股份	7,820,071.00	7.46
178	002832	比音勒芬	7,724,437.90	7.37
179	600928	西安银行	7,719,247.00	7.37
180	002601	龙佰集团	7,673,031.00	7.32
181	002594	比亚迪	7,609,900.00	7.26
182	600801	华新水泥	7,408,688.20	7.07
183	600426	华鲁恒升	7,137,276.56	6.81
184	601939	建设银行	7,107,968.00	6.79
185	601330	绿色动力	6,980,022.00	6.66
186	601808	中海油服	6,771,808.44	6.46
187	601000	唐山港	6,706,204.00	6.40
188	600233	圆通速递	6,691,496.00	6.39
189	002128	电投能源	6,631,810.82	6.33
190	688739	成大生物	6,596,473.27	6.30

191	600362	江西铜业	6,306,453.99	6.02
192	600795	国电电力	6,234,030.00	5.95
193	601238	广汽集团	6,228,560.00	5.95
194	600929	雪天盐业	6,217,370.00	5.93
195	600025	华能水电	5,864,199.00	5.60
196	600612	老凤祥	5,793,280.00	5.53
197	600549	厦门钨业	5,786,575.00	5.52
198	600461	洪城环境	5,638,132.56	5.38
199	600875	东方电气	5,558,643.00	5.31
200	600256	广汇能源	5,428,991.00	5.18
201	603355	莱克电气	5,423,922.02	5.18
202	600328	中盐化工	5,268,207.00	5.03
203	600583	海油工程	5,054,213.00	4.82
204	601601	中国太保	4,907,581.30	4.68
205	600073	光明肉业	4,886,786.35	4.66
206	603393	新天然气	4,858,188.00	4.64
207	600598	北大荒	4,715,726.00	4.50
208	001289	龙源电力	4,667,570.00	4.46
209	600219	南山铝业	4,642,187.00	4.43
210	000877	天山股份	4,640,682.00	4.43
211	601928	凤凰传媒	4,612,205.00	4.40
212	600970	中材国际	4,605,449.00	4.40
213	601158	重庆水务	4,419,343.00	4.22
214	601609	金田股份	4,401,896.00	4.20
215	603071	物产环能	4,203,056.00	4.01
216	300470	中密控股	4,200,862.00	4.01
217	000778	新兴铸管	4,195,442.00	4.00
218	000538	云南白药	4,158,974.00	3.97
219	601899	紫金矿业	4,069,118.00	3.88
220	601838	成都银行	4,029,361.35	3.85
221	603699	纽威股份	3,727,406.24	3.56

222	601801	皖新传媒	3,506,690.00	3.35
223	002595	豪迈科技	3,393,701.00	3.24
224	603899	晨光股份	3,381,845.00	3.23
225	300979	华利集团	3,307,376.68	3.16
226	001965	招商公路	3,284,563.00	3.14
227	600406	国电南瑞	3,199,627.36	3.05
228	603599	广信股份	3,168,109.04	3.02
229	600251	冠农股份	2,628,521.00	2.51
230	601866	中远海发	2,530,277.00	2.42
231	002608	江苏国信	2,507,088.00	2.39
232	600660	福耀玻璃	2,297,535.00	2.19

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600704	物产中大	53,559,189.00	51.13
2	601318	中国平安	53,276,570.78	50.86
3	601339	百隆东方	49,011,862.80	46.79
4	001872	招商港口	46,817,308.00	44.69
5	600039	四川路桥	45,005,564.40	42.96
6	601988	中国银行	44,868,246.00	42.83
7	601328	交通银行	43,507,195.00	41.53
8	600956	新天绿能	41,270,374.60	39.40
9	600717	天津港	40,062,634.69	38.24
10	600104	上汽集团	39,609,265.00	37.81
11	601668	中国建筑	39,003,254.00	37.23
12	601298	青岛港	37,218,291.52	35.53

13	601607	上海医药	36,242,551.00	34.60
14	601319	中国人保	35,312,886.76	33.71
15	000088	盐田港	34,996,206.16	33.41
16	002034	旺能环境	34,635,499.37	33.06
17	603053	成都燃气	34,595,597.00	33.02
18	000333	美的集团	34,204,926.00	32.65
19	600016	民生银行	32,940,042.00	31.44
20	601963	重庆银行	32,922,306.04	31.43
21	000708	中信特钢	32,830,551.20	31.34
22	000012	南玻A	32,027,107.00	30.57
23	600377	宁沪高速	31,622,941.30	30.19
24	601006	大秦铁路	30,137,462.00	28.77
25	601577	长沙银行	29,738,522.00	28.39
26	002948	青岛银行	29,014,677.20	27.70
27	600050	中国联通	28,794,575.00	27.49
28	600803	新奥股份	28,765,905.00	27.46
29	600998	九州通	28,573,939.85	27.28
30	600585	海螺水泥	28,524,895.81	27.23
31	600332	白云山	28,458,816.00	27.17
32	600741	华域汽车	28,368,862.94	27.08
33	002911	佛燃能源	28,342,780.30	27.06
34	601658	邮储银行	27,888,619.00	26.62
35	601187	厦门银行	27,501,190.00	26.25
36	601139	深圳燃气	27,327,814.70	26.09
37	600000	浦发银行	27,131,466.28	25.90
38	601568	北元集团	27,075,899.80	25.85
39	600282	南钢股份	26,080,927.00	24.90
40	002267	陕天然气	26,039,013.00	24.86
41	002831	裕同科技	24,963,281.44	23.83
42	605507	国邦医药	24,874,805.06	23.74
43	000429	粤高速A	24,730,584.10	23.61

44	000513	丽珠集团	24,627,255.00	23.51
45	601825	沪农商行	24,457,931.00	23.35
46	601288	农业银行	24,235,208.00	23.13
47	601166	兴业银行	23,953,386.00	22.87
48	000027	深圳能源	23,873,601.00	22.79
49	600018	上港集团	23,813,912.00	22.73
50	000582	北部湾港	23,804,524.00	22.72
51	601827	三峰环境	23,467,493.81	22.40
52	601916	浙商银行	23,402,778.80	22.34
53	600511	国药股份	23,325,537.00	22.27
54	002004	华邦健康	23,255,157.00	22.20
55	002003	伟星股份	23,055,810.83	22.01
56	000651	格力电器	22,971,582.90	21.93
57	000902	新洋丰	22,735,510.00	21.70
58	600167	联美控股	22,669,311.96	21.64
59	601009	南京银行	22,608,923.65	21.58
60	600582	天地科技	22,147,966.00	21.14
61	600019	宝钢股份	22,113,872.80	21.11
62	601229	上海银行	21,964,735.42	20.97
63	003816	中国广核	21,931,303.00	20.93
64	600177	雅戈尔	21,573,129.42	20.59
65	600710	苏美达	21,567,321.00	20.59
66	601107	四川成渝	21,488,338.00	20.51
67	600887	伊利股份	21,237,024.00	20.27
68	601390	中国中铁	21,213,731.66	20.25
69	601216	君正集团	21,058,587.68	20.10
70	600873	梅花生物	20,366,464.00	19.44
71	002563	森马服饰	20,290,059.00	19.37
72	002978	安宁股份	19,946,127.20	19.04
73	002701	奥瑞金	19,816,717.34	18.92
74	600089	特变电工	19,770,056.50	18.87

75	601998	中信银行	19,612,410.00	18.72
76	601186	中国铁建	19,593,989.54	18.70
77	000895	双汇发展	19,357,552.00	18.48
78	603156	养元饮品	19,315,649.00	18.44
79	601868	中国能建	19,249,559.00	18.38
80	001323	慕思股份	19,109,995.00	18.24
81	600064	南京高科	19,002,039.48	18.14
82	600309	万华化学	18,623,049.00	17.78
83	001213	中铁特货	18,447,844.00	17.61
84	601088	中国神华	18,344,169.54	17.51
85	601818	光大银行	17,862,140.00	17.05
86	600496	精工钢构	17,848,817.00	17.04
87	601618	中国中冶	17,523,284.24	16.73
88	600015	华夏银行	17,441,021.00	16.65
89	600690	海尔智家	17,104,236.08	16.33
90	600273	嘉化能源	17,043,160.58	16.27
91	600033	福建高速	16,624,227.00	15.87
92	002304	洋河股份	16,593,164.00	15.84
93	600248	陕建股份	16,591,054.29	15.84
94	600926	杭州银行	16,576,542.00	15.82
95	603639	海利尔	16,367,234.52	15.62
96	601169	北京银行	16,331,825.00	15.59
97	002216	三全食品	16,141,563.40	15.41
98	600755	厦门国贸	16,133,256.25	15.40
99	601326	秦港股份	15,882,002.00	15.16
100	002048	宁波华翔	15,774,859.00	15.06
101	600057	厦门象屿	15,757,595.10	15.04
102	600886	国投电力	15,657,911.00	14.95
103	600269	赣粤高速	15,550,922.70	14.84
104	301035	润丰股份	15,502,394.00	14.80
105	600028	中国石化	15,252,290.00	14.56

106	601811	新华文轩	15,109,534.00	14.42
107	600295	鄂尔多斯	15,058,291.40	14.37
108	600787	中储股份	14,974,875.00	14.29
109	601665	齐鲁银行	14,909,678.00	14.23
110	002818	富森美	14,904,498.93	14.23
111	601098	中南传媒	14,872,737.00	14.20
112	600820	隧道股份	14,849,540.00	14.17
113	000596	古井贡酒	14,563,446.09	13.90
114	600655	豫园股份	14,455,000.03	13.80
115	002275	桂林三金	14,453,140.64	13.80
116	605599	菜百股份	14,085,036.00	13.45
117	600618	氯碱化工	13,726,068.00	13.10
118	600008	首创环保	13,637,920.00	13.02
119	600674	川投能源	13,312,543.00	12.71
120	600350	山东高速	13,282,855.99	12.68
121	000061	农产品	13,212,527.00	12.61
122	002311	海大集团	13,172,185.00	12.57
123	600036	招商银行	12,848,843.95	12.27
124	600502	安徽建工	12,828,461.00	12.25
125	601628	中国人寿	12,802,230.00	12.22
126	688819	天能股份	12,664,168.65	12.09
127	601225	陕西煤业	12,628,250.84	12.05
128	600905	三峡能源	12,581,032.00	12.01
129	601728	中国电信	12,431,397.00	11.87
130	688425	铁建重工	12,363,803.23	11.80
131	002677	浙江美大	12,275,112.26	11.72
132	600919	江苏银行	12,175,472.00	11.62
133	601877	正泰电器	12,160,360.00	11.61
134	601857	中国石油	11,819,685.00	11.28
135	600346	恒力石化	11,715,740.00	11.18
136	600519	贵州茅台	11,681,812.00	11.15

137	002032	苏泊尔	11,372,254.36	10.86
138	000967	盈峰环境	11,326,602.00	10.81
139	300999	金龙鱼	11,207,633.00	10.70
140	002091	江苏国泰	11,205,950.00	10.70
141	601077	渝农商行	10,628,404.00	10.15
142	000685	中山公用	10,431,373.00	9.96
143	600900	长江电力	10,328,114.14	9.86
144	000858	五粮液	10,310,153.00	9.84
145	603195	公牛集团	10,196,938.12	9.73
146	600323	瀚蓝环境	9,911,122.00	9.46
147	300146	汤臣倍健	9,815,900.00	9.37
148	002958	青农商行	9,754,421.00	9.31
149	600017	日照港	9,641,194.00	9.20
150	002128	电投能源	9,457,998.00	9.03
151	601211	国泰君安	9,425,993.50	9.00
152	600362	江西铜业	9,242,151.00	8.82
153	000019	深粮控股	9,240,211.30	8.82
154	600757	长江传媒	8,896,460.00	8.49
155	300888	稳健医疗	8,775,659.56	8.38
156	601766	中国中车	8,764,303.00	8.37
157	601808	中海油服	8,533,113.40	8.15
158	002594	比亚迪	8,509,870.00	8.12
159	601669	中国电建	8,501,773.00	8.12
160	002601	龙佰集团	8,495,839.00	8.11
161	002233	塔牌集团	8,314,529.00	7.94
162	601000	唐山港	7,765,501.00	7.41
163	600968	海油发展	7,726,110.00	7.38
164	600461	洪城环境	7,637,426.05	7.29
165	688739	成大生物	7,605,024.92	7.26
166	002832	比音勒芬	7,599,112.00	7.25
167	600801	华新水泥	7,537,497.00	7.20

168	600007	中国国贸	7,370,815.00	7.04
169	600426	华鲁恒升	7,311,682.00	6.98
170	600997	开滦股份	7,234,897.04	6.91
171	600928	西安银行	7,160,128.00	6.83
172	601939	建设银行	7,060,759.00	6.74
173	601330	绿色动力	6,941,118.00	6.63
174	600398	海澜之家	6,927,106.00	6.61
175	600380	健康元	6,749,317.00	6.44
176	600612	老凤祥	6,616,675.36	6.32
177	601238	广汽集团	6,488,586.65	6.19
178	600098	广州发展	6,485,997.00	6.19
179	600929	雪天盐业	6,469,293.00	6.18
180	000030	富奥股份	6,452,043.00	6.16
181	600549	厦门钨业	6,205,364.00	5.92
182	601158	重庆水务	5,902,141.00	5.63
183	600875	东方电气	5,831,552.00	5.57
184	603355	莱克电气	5,809,422.00	5.55
185	600328	中盐化工	5,799,538.60	5.54
186	600233	圆通速递	5,611,706.85	5.36
187	600970	中材国际	5,281,654.00	5.04
188	601601	中国太保	5,226,396.00	4.99
189	000778	新兴铸管	5,110,881.57	4.88
190	001289	龙源电力	4,999,223.04	4.77
191	600219	南山铝业	4,957,790.00	4.73
192	601899	紫金矿业	4,901,662.00	4.68
193	600025	华能水电	4,633,009.00	4.42
194	600598	北大荒	4,619,301.00	4.41
195	000538	云南白药	4,602,604.00	4.39
196	600073	光明肉业	4,575,001.00	4.37
197	601311	骆驼股份	4,561,188.00	4.35
198	603393	新天然气	4,441,679.00	4.24

199	000877	天山股份	4,345,055.00	4.15
200	601838	成都银行	4,208,712.00	4.02
201	603071	物产环能	4,206,466.00	4.02
202	601928	凤凰传媒	4,165,275.00	3.98
203	300470	中密控股	4,134,149.00	3.95
204	603599	广信股份	3,825,107.64	3.65
205	601898	中煤能源	3,802,979.00	3.63
206	601801	皖新传媒	3,772,341.70	3.60
207	300979	华利集团	3,702,396.52	3.53
208	002595	豪迈科技	3,699,597.00	3.53
209	603899	晨光股份	3,577,787.00	3.42
210	600660	福耀玻璃	3,500,957.30	3.34
211	002078	太阳纸业	3,369,657.00	3.22
212	600406	国电南瑞	3,346,801.00	3.19
213	600012	皖通高速	3,299,770.00	3.15
214	603699	纽威股份	3,237,522.00	3.09
215	000883	湖北能源	3,221,211.00	3.07
216	600251	冠农股份	2,572,816.00	2.46
217	601866	中远海发	2,539,472.00	2.42
218	002608	江苏国信	2,455,735.00	2.34
219	002318	久立特材	2,211,193.00	2.11

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,764,910,930.80
卖出股票收入（成交）总额	3,676,709,951.39

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	86,777,055.89	6.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	86,777,055.89	6.21

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24国债09	540,000	54,682,234.52	3.92
2	019706	23国债13	316,000	32,094,821.37	2.30

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券除中国银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。国家外汇管理局北京市分局2024年04月03日对中国银行股份有限公司进行处罚(京汇罚[2024]9号)。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

**8.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	394,617.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	33,094,054.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,488,671.80

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联高股息混合A	1,360	442,994.15	581,518,200.04	96.52%	20,953,847.18	3.48%
国联高股息混合C	2,347	280,155.10	634,627,437.29	96.52%	22,896,576.13	3.48%
合计	3,707	339,896.43	1,216,145,637.33	96.52%	43,850,423.31	3.48%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联高股息混合A	489,744.31	0.08%

	国联高股息混合C	145,668.49	0.02%
	合计	635,412.80	0.05%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联高股息混合A	10~50
	国联高股息混合C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国联高股息混合A	0~10
	国联高股息混合C	-
	合计	0~10

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	国联高股息混合A	国联高股息混合C
基金合同生效日(2019年09月26日)基金份额总额	1,022,558,886.10	197,453,446.87
本报告期期初基金份额总额	48,421,008.68	57,292,839.14
本报告期基金总申购份额	741,344,375.61	1,222,412,106.88
减：本报告期基金总赎回份额	187,293,337.07	622,180,932.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	602,472,047.22	657,524,013.42

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2024年4月10日发布公告，曹健先生担任国联基金管理有限公司督察长职务、周妹云女士、马荣荣女士、刘鲁旦先生担任国联基金管理有限公司副总经理职务，同时曹健先生不再担任国联基金管理有限公司副总经理职务、周妹云女士不再担任国联基金管理有限公司督察长职务。

本基金管理人于2024年7月10日发布公告，闫军先生担任国联基金管理有限公司总经理职务，同时闫军先生不再担任国联基金管理有限公司副总经理职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

**11.4 基金投资策略的改变**

本基金本报告期投资策略未发生改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续6年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为45,000.00元人民币。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

**11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：本报告期内托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

	量					
华泰证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	544,215,249.35	6.45%	242,669.44	5.20%	-
中银国际	1	-	-	-	-	退租1个交易单元。
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	206,681,863.00	2.45%	92,156.27	1.97%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	1,353,379,589.87	16.04%	990,812.48	21.21%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	658,460,576.02	7.80%	491,143.26	10.52%	-
国联民生证券	2	1,780,049,732.54	21.09%	793,711.89	16.99%	新增2个交易单元。
国泰	2	469,971,506.97	5.57%	350,542.19	7.50%	-

君安						
恒泰 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	退租 2个 交易 单 元。
华创 证券	2	549,326,587.70	6.51%	298,532.78	6.39%	新增 2个 交易 单 元。
华福 证券	2	64,306,484.94	0.76%	32,153.26	0.69%	新增 2个 交易 单 元。
华兴 证券	2	-	-	-	-	退租 2个 交易 单 元。
江海 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	830,641,183.53	9.84%	464,934.41	9.95%	-
申万 宏源	2	17,733,687.00	0.21%	13,227.27	0.28%	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	25,858,063.92	0.31%	19,288.62	0.41%	退租 2个 交易 单元。
中信证券	2	1,038,301,473.29	12.30%	462,989.73	9.91%	-
国投证券	3	35,653,159.76	0.42%	15,897.89	0.34%	退租 1个 交易 单元。
兴业证券	3	206,229,904.31	2.44%	91,958.78	1.97%	退租 2个 交易 单元。
方正证券	4	47,491,127.55	0.56%	21,176.66	0.45%	退租 3个 交易 单元。
信达证券	4	611,794,739.87	7.25%	289,654.09	6.20%	新增 1个 交易 单元。

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

1、财务状况良好；

- 2、经营行为规范；
  - 3、合规风控能力和交易能力较强；
  - 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
    - （1）有较强的宏观及行业研究能力。能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并进行路演、培训等。
    - （2）有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
    - （3）有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。
- ②券商专用交易单元选择程序：
- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；
  - 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。
- ③本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《国联基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	219,368,000.00	7.46%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	170,000,000.00	5.78%	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	101,757,375.00	34.51%	178,200,000.00	6.06%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

广发证券	10,031,516.92	3.40%	37,800,000.00	1.28%	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	675,000,000.00	22.94%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	36,900,000.00	1.25%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	122,118,836.00	41.41%	776,766,000.00	26.40%	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	13,000,000.00	0.44%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	464,800,000.00	15.80%	-	-	-	-
国投证券	-	-	12,800,000.00	0.44%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	60,976,513.00	20.68%	357,402,000.00	12.15%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金调低管理费率并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-11
2	国联基金管理有限公司关于办公地址名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-12
3	国联基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-29

	国联高股息精选混合型证券投资基金调低C类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告		
4	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
5	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
6	国联基金管理有限公司基金经理变更公告（国联高股息混合）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-31
7	国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-31
8	国联高股息精选混合型证券投资基金2024年第一次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-26
9	国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-28
10	国联基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-07-10
11	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-07-10
12	国联基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司代销本公司旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-08-21
13	国联基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网站	2024-08-22

	国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告		
14	国联基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-09-02
15	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-09-10
16	国联基金管理有限公司关于暂停武汉佰鲲基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-09-13
17	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-07
18	国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-17
19	国联高股息精选混合型证券投资基金2024年第二次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-18
20	国联基金管理有限公司关于国联高股息精选混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-20

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20240101-20240110,20240112-20240530	24,810,931.61	171,649,803.33	47,000,000.00	149,460,734.94	11.86%
	2	20240108-20240205	20,447,806.97	156,400,726.03	176,848,533.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融高股息精选混合型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 《国联高股息精选混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《国联高股息精选混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集中融高股息精选混合型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，(010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司  
二〇二五年三月二十八日