

# 国都聚成混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 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.....	49
7.7 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.....	49
7.8 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.....	49
7.9 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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 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的情况.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>

11.1 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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国都聚成混合型证券投资基金
基金简称	国都聚成
场内简称	-
基金主代码	011389
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年3月25日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	52,751,318.54份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动投资管理，在严格控制投资风险的前提下，争取通过挖掘市场的投资机会来获得较为稳健的投资收益，力争实现超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期投资回报。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，立足宏观经济和货币政策走势研究，通过综合分析国内外宏观经济态势、行业情况、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各类资产在特定经济形势下的估值水平和预期风险收益特征，决定基金的资产配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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		国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昭	龚小武
	联系电话	010-84183229	021-52629999-212056
	电子邮箱	lizhao@guodu.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-818-8118	95561
传真		010-84183311	021-62159217

注册地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	上海市银城路 167 号
邮政编码	100007	200120
法定代表人	翁振杰	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.guodu.com
基金中期报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-3,508,267.78
本期利润	-2,819,210.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0512
本期加权平均净值利润率	-8.48%
本期基金份额净值增长率	-9.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-24,378,122.50
期末可供分配基金份额利润	-0.4621
期末基金资产净值	29,423,585.25
期末基金份额净值	0.5578
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-44.22%

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、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损益。

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

3. 所述期末基金业绩指标不包含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。

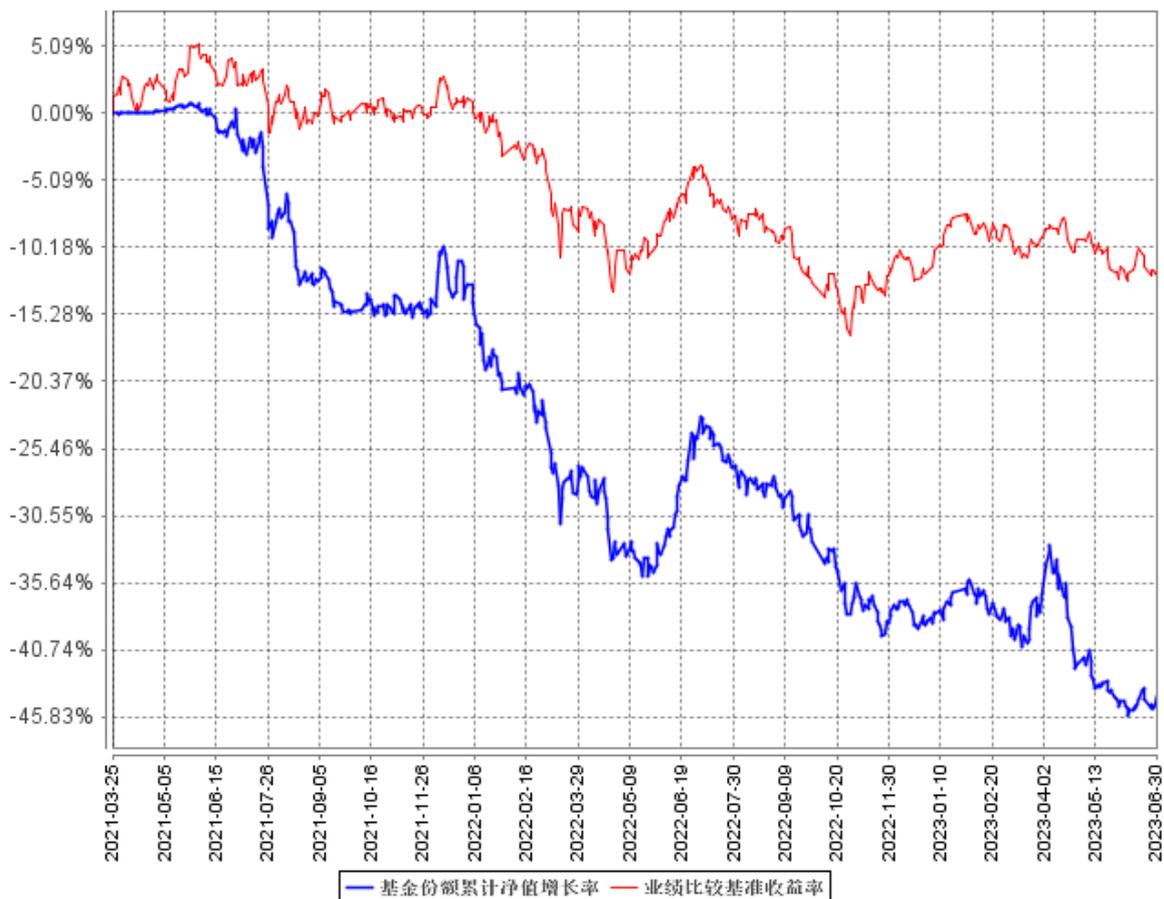
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.94%	0.76%	0.78%	0.52%	0.16%	0.24%
过去三个月	-12.03%	1.29%	-2.71%	0.49%	-9.32%	0.80%
过去六个月	-9.08%	1.18%	0.14%	0.50%	-9.22%	0.68%
过去一年	-26.04%	1.03%	-8.10%	0.59%	-17.94%	0.44%
自基金合同生效起至今	-44.22%	0.99%	-11.89%	0.66%	-32.33%	0.33%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国都证券股份有限公司（以下简称“国都证券”）是由国都证券有限责任公司整体变更而来。国都证券有限责任公司是经中国证监会批准，在中诚信托有限责任公司和北京国际信托有限公司原有证券业务整合的基础上，吸收其他股东出资，于 2001 年 12 月 28 日成立的综合性证券公司，注册地为北京。2015 年 6 月 23 日公司组织形式由有限责任公司整体变更为股份有限公司，公司正式更名为“国都证券股份有限公司”。目前，注册资本为人民币 5,830,000,009 元。

2014 年 8 月 19 日，经中国证监会批准，公司获准开展公募基金管理业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司管理 3 只开放式证券投资基金——国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、国都多策略混合型证券投资基金、国都聚成混合型证券投资基金。

#### 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		
廖晓东	基金管理部董事总经理	2021 年 3 月 25 日	-	21 年	历任中煤信托投资有限责任公司证券总部项目经理；国都证券研究所副总经理、证券投资部总经理、研究所所长、基金管理部总经理。现任国都证券股份有限公司基金管理部董事总经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会主席、基金经理。
张晓磊	基金经理	2023 年 3 月 10 日	-	8 年	曾任国都证券股份有限公司研究所研究员，基金管理部基金经理助理。现任国都证券基金管理部基金经理、公募证券投资基金管理业务投资决策委员会成员。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》等有关法律法规的规定和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》等有关法律文件的约定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资运作符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，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

由于今年是疫情后经济复苏的首年，虽然一季度经济仍保持了较高增速，但未达到市场之前较高的增速预期；二季度经济环比增速出现回落，导致市场信心进一步承压。包括就业压力、消费及投资不及预期、全球产业链重构导致外需回落、人民币阶段性贬值、产业去库存尚在进行等因素，都对上半年经济发展产生影响。然而长期来看，通过持续的开放、转型，不断提升要素生产率，我国经济有望在长期潜在增长和中短期增长之间形成新的平衡，从而保持经济的持续快速增长。

在年初，我们观察到宏观经济面临潜在的利空因素并进行了研究分析，为规避来自顺周期产业的衰退压力，选择了一部分与宏观经济相关性相对较弱的朝阳行业进行了配置，如人工智能、光通信、大数据、存储器等，在上半年来取得了一定的收益效果。我们认为下半年科技板块仍然是支撑 A 股行情的核心方向之一，需要着重挖掘优质标的配置。同时，如果经济数据逐步好转，顺周期行业的投资机会也将逐步显现，我们将密切关注相应的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.5578 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.08%，业绩比较基准收益率为 0.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期下半年经济有望进一步复苏，主要因素为以下几点：第一点是中央和地方政府下半年工作重心有望在经济政策方面多有着力，预计会有一系列提振经济的宏观调控和行业刺激措施出台，提振市场信心。第二点是疫情后经济生活步入正常，随着失业率降低，收入的提升，消费增长的内生性潜力正在积极改善和恢复。第三点是企业层面，二季度主动去库存之后，产能利用率、PPI、新涨价因素、产成品库存的相对底部或将在下半年出现，经济复苏的内生动能可能也会开始边际走强。第四点是持续的科技创新及投入，智能汽车、绿色能源产业以及各类新兴科技赛道将引领新的增量经济。第五点是随着经济运行强力复苏，人民币贬值势头将得到抑制并重拾升值轨道，有利于对资本市场带来资金支持，美联储加息周期接近尾声也支持这一趋势。

本基金对后市持相对乐观态度，在未来一段时间内，本基金将根据标的估值、产业发展情况以及市场环境等因素的变化，对高成长性赛道中仍有较高性价比的标的继续配置，同时关注顺周期板块的变化情况，根据宏观经济数据的改善情况择机加以配置，积极寻找兼顾短期收益和长期战略性机会的优质标的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；截至本报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。本基金管理人已按法规要求向监管机关报送解决方案。

## § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,732,289.14	7,238,638.10
结算备付金		284,025.41	209,933.65
存出保证金		41,162.65	26,852.84
交易性金融资产	6.4.7.2	22,334,915.60	28,520,066.00
其中：股票投资		22,334,915.60	28,520,066.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		30,392,392.80	35,995,490.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		790,062.19	708,515.34

应付赎回款		54,722.23	-
应付管理人报酬		35,965.53	45,380.70
应付托管费		2,397.69	3,025.40
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.9	85,659.91	137,122.41
负债合计		968,807.55	894,043.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	52,751,318.54	57,215,197.33
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-23,327,733.29	-22,113,750.59
净资产合计		29,423,585.25	35,101,446.74
负债和净资产总计		30,392,392.80	35,995,490.59

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5578 元，基金份额总额 52,751,318.54 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,552,566.42	-7,499,562.05
1.利息收入		13,040.69	36,360.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,040.69	16,300.11
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		-	20,060.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,255,121.52	-7,498,321.70
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,360,521.42	-7,744,350.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	105,399.90	246,028.61
以摊余成本计量的金融资		-	-

产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	689,057.70	-41,412.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	456.71	3,812.13
<b>减：二、营业总支出</b>		266,643.66	432,372.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	247,733.80	360,965.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,515.57	24,064.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	72.23
8. 其他费用	6.4.7.23	2,394.29	47,270.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-2,819,210.08	-7,931,934.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-2,819,210.08	-7,931,934.57
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-2,819,210.08	-7,931,934.57

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	57,215,197.33	-	-22,113,750.59	35,101,446.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	57,215,197.33	-	-22,113,750.59	35,101,446.74

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-4,463,878.79	-	-1,213,982.70	-5,677,861.49
(一)、综合收益总额	-	-	-2,819,210.08	-2,819,210.08
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-4,463,878.79	-	1,605,227.38	-2,858,651.41
其中：1.基金申购款	723,502.63	-	-280,413.12	443,089.51
2.基金赎回款	-5,187,381.42	-	1,885,640.50	-3,301,740.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	52,751,318.54	-	-23,327,733.29	29,423,585.25
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	69,360,002.81	-	-9,067,456.19	60,292,546.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	69,360,002.81	-	-9,067,456.19	60,292,546.62
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-5,899,689.30	-	-6,532,522.84	-12,432,212.14
(一)、综合收益总额	-	-	-7,931,934.57	-7,931,934.57
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-5,899,689.30	-	1,399,411.73	-4,500,277.57
其中：1.基金申购款	170,075.35	-	-44,769.38	125,305.97

2.基金赎回款	-6,069,764.65	-	1,444,181.11	-4,625,583.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	63,460,313.51	-	-15,599,979.03	47,860,334.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 翁振杰	_____ 封欣	_____ 陈蕾
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国都聚成混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2020 年 8 月 6 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都聚成混合型证券投资基金注册的批复》证监许可[2020]1694 号文核准注册，于 2021 年 02 月 05 日开始募集，募集期不超过三个月，本基金提前结束募集，截止日为 2021 年 3 月 22 日（含）。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 276,455,017.96 元人民币，并经中准会计师事务所（特殊普通合伙）“中准验字[2021]第 0069 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 25 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 276,496,226.65 份基金单位，其中认购资金利息折合 41,208.69 份基金单位。

本基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，具体为股票（包括中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券）、同业存单、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款）、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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〈年度和中期报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年度上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

#### 6.4.6 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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文

《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《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〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,732,289.14
等于：本金	7,731,581.46
加：应计利息	707.68
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：	7,732,289.14

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,745,288.91	-	22,334,915.60	589,626.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,745,288.91	-	22,334,915.60	589,626.69

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

截至本报告期末，本基金未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末投资债权。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期无债权投资减值准备计提。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期无其他债权投资减值准备计提。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期内未投资其他权益工具。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	53,425.62
其中：交易所市场	53,425.62
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	32,234.29
合计	85,659.91

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,215,197.33	57,215,197.33
本期申购	723,502.63	723,502.63
本期赎回(以“-”号填列)	-5,187,381.42	-5,187,381.42
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	52,751,318.54	52,751,318.54

注：本期申购份额含红利再投、转换入份额，本期赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-22,636,412.12	522,661.53	-22,113,750.59
本期利润	-3,508,267.78	689,057.70	-2,819,210.08
本期基金份额交易产生的变动数	1,766,557.40	-161,330.02	1,605,227.38
其中：基金申购款	-298,920.91	18,507.79	-280,413.12
基金赎回款	2,065,478.31	-179,837.81	1,885,640.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,378,122.50	1,050,389.21	-23,327,733.29

**6.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,583.46
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	2,189.20
其他	268.03
合计	13,040.69

注：“其他”为结算保证金利息收入。

**6.4.7.14 股票投资收益****6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	216,569,611.42
减：卖出股票成本总额	219,284,574.54
减：交易费用	645,558.30
买卖股票差价收入	-3,360,521.42

**6.4.7.15 债券投资收益****6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期未进行贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金在本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	105,399.90
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	105,399.90

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	689,057.70
——股票投资	689,057.70
——债券投资	-
——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	689,057.70

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	456.71
合计	456.71

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	7,439.10

信息披露费	-5,204.81
证券出借违约金	-
银行划款手续费	160.00
合计	2,394.29

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国都证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金的证券经纪商
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期的关联方交易主要包括通过关联方交易单元进行的交易、关联方报酬等情况。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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

国都证券股份有限公司	428,979,977.86	100.00%	146,885,947.42	100.00%
------------	----------------	---------	----------------	---------

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比区间均未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券股份有限公司	-	-	170,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30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
国都证券股份有限公司	395,224.89	100.00%	53,425.62	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
国都证券股份有限公司	134,972.17	100.00%	18,368.11	100.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费)等。

2、关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	247,733.80	360,965.31
其中：支付销售机构的客户维护费	568.49	491.88

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,515.57	24,064.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金

托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	7,731,581.46	10,583.46	8,028,241.68	13,844.16

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均没有需作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险容忍度、风险限额等指标，在确保整体风险可承受的前提下，积极、恰当地管理风险，实现经风险调整后的收益最大化。

本基金管理人风险管理的组织体系由董事会、监事会、经营管理层、各部门、分支机构、子公司和全体工作人员组成。董事会承担公司全面风险管理的最终责任。监事会承担全面风险管理的监督责任。经营管理层对公司全面风险管理承担主要责任。公司各部门、分支机构及子公司负责人承担本部门（分支机构、子公司）风险管理的直接责任。公司全体工作人员对风险管理有效性承担勤勉尽责、审慎防范、及时报告的责任。

董事会及其风险控制委员会负责审批公司风险管理制度、风险管理政策、重大风险处置方案等重大风险管理事项，对公司承担风险的整体情况和风险管理体系的有效性进行监督。

监事会负责监督董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经营管理层及其合规与风险管理委员会负责建设公司全面风险管理体系，组织实施董事会通过的风险管理政策，在董事会授权范围内对风险管理重大事项进行决策，向董事会报告风险管理工作和风险承担状况并接受监督。管理层及其下属的专业决策机构具体管理公司各项业务，设定各业务限额和风险限额，确定业务管理和风险控制的制度和措施。首席风险官负责公司全面风险管理工作，并领导风险管理部门的工作。

风险管理部在首席风险官领导下履行公司全面风险管理职责。公司资金管理部门牵头负责公司流动性风险管理工作，公司相关部门和风险管理部门配合其开展工作。

各业务部门、分支机构、子公司履行本部门（分支机构、子公司）的风险管理工作职责。财务、信息技术、运营、人力资源等职能部门在做好本部门风险管理工作的同时，在各自的专业领域对业务部门进行监督。

公司全体工作人员在执业行为中履行各自的风险管理责任。

#### **6.4.13.2 信用风险**

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的债券。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放

式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金组合资产以现金、股票、7 日内到期的国债逆回购等高流动性资产为主，停牌股票等主动投资于流动性受限资产占基金资产净值比例未超过 15%，7 个工作日可变现资产市值占基金净值的比例维持在 80%以上，可流通股股票资产变现天数低于 1 天，单一投资者持有基金份额最高比例不超过 20%。

报告期内，未出现巨额赎回或延期支付赎回款的情况及 7 个工作日可变现资产的可变现价值低于每日净赎回金额的情况，未出现可能导致流动性风险的情形，相关流动性监控指标符合《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》。

#### 6.4.13.4 市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致证券价格波动而产生风险。

##### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### 3、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

##### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和

利润水平。基金投资于证券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,731,581.46	-	-	-	-	707.68	7,732,289.14
结算备付金	283,897.71	-	-	-	-	127.70	284,025.41
存出保证金	41,144.15	-	-	-	-	18.50	41,162.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-22,334,915.60	22,334,915.60
资产总计	8,056,623.32	-	-	-	-	-22,335,769.48	30,392,392.80
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	790,062.19	790,062.19
应付赎回款	-	-	-	-	-	54,722.23	54,722.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,965.53	35,965.53
应付托管费	-	-	-	-	-	2,397.69	2,397.69
其他负债	-	-	-	-	-	85,659.91	85,659.91
负债总计	-	-	-	-	-	968,807.55	968,807.55
利率敏感度缺口	8,056,623.32	-	-	-	-	-21,366,961.93	29,423,585.25
上年度末 2022年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,237,809.31	-	-	-	-	828.79	7,238,638.10
结算备付金	209,829.70	-	-	-	-	103.95	209,933.65
存出保证金	26,839.64	-	-	-	-	13.20	26,852.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-28,520,066.00	28,520,066.00
资产总计	7,474,478.65	-	-	-	-	-28,521,011.94	35,995,490.59
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,380.70	45,380.70
应付托管费	-	-	-	-	-	3,025.40	3,025.40
其他负债	-	-	-	-	-	845,637.75	845,637.75
负债总计	-	-	-	-	-	894,043.85	894,043.85
利率敏感度缺口	7,474,478.65	-	-	-	-	-27,626,968.09	35,101,446.74

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，

且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。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。

本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	22,334,915.60	75.91	28,520,066.00	81.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,334,915.60	75.91	28,520,066.00	81.25

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动
	Beta 系数以市场过去一年的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足一年的股票，默认其波动与市场同步
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-864,480.78	-1,528,093.12
	沪深 300 指数上涨 5%	864,480.78	1,528,093.12

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平，以过去 250 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 539246.52 元，占基金资产净值比例为 1.77%。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	22,334,915.60	40,405,185.25
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	22,334,915.60	40,405,185.25

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

#### **6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	22,334,915.60	73.49
	其中：股票	22,334,915.60	73.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,016,314.55	26.38
8	其他各项资产	41,162.65	0.14
9	合计	30,392,392.80	100.00

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,914,515.60	67.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	475,500.00	1.62
E	建筑业	563,400.00	1.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	546,500.00	1.86
J	金融业	835,000.00	2.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,334,915.60	75.91

注：以上行业分类以 2023 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	4,200	1,084,734.00	3.69
2	688700	东威科技	8,000	797,840.00	2.71
3	300863	卡倍亿	12,000	754,920.00	2.57
4	688036	传音控股	5,000	735,000.00	2.50
5	300456	赛微电子	30,000	734,400.00	2.50
6	002126	银轮股份	40,000	708,000.00	2.41
7	600363	联创光电	19,000	704,900.00	2.40
8	688122	西部超导	12,600	702,198.00	2.39
9	300866	安克创新	8,000	700,000.00	2.38
10	000063	中兴通讯	15,000	683,100.00	2.32
11	603348	文灿股份	15,000	657,150.00	2.23
12	000625	长安汽车	50,000	646,500.00	2.20
13	688106	金宏气体	23,123	628,945.60	2.14
14	300638	广和通	27,600	625,968.00	2.13
15	300916	朗特智能	18,000	620,820.00	2.11
16	600732	爱旭股份	20,000	615,000.00	2.09
17	002865	钧达股份	4,000	610,120.00	2.07
18	002917	金奥博	48,000	593,280.00	2.02
19	000333	美的集团	10,000	589,200.00	2.00
20	600436	片仔癀	2,000	572,720.00	1.95
21	600072	中船科技	20,000	563,400.00	1.91
22	002747	埃斯顿	20,000	560,000.00	1.90
23	603197	保隆科技	10,000	542,500.00	1.84
24	688017	绿的谐波	3,000	487,200.00	1.66
25	601398	工商银行	100,000	482,000.00	1.64

26	600101	明星电力	50,000	475,500.00	1.62
27	002997	瑞鹄模具	15,000	445,950.00	1.52
28	688125	安达智能	8,000	434,800.00	1.48
29	688128	中国电研	17,000	433,500.00	1.47
30	300585	奥联电子	19,000	427,120.00	1.45
31	300480	光力科技	18,000	411,480.00	1.40
32	002409	雅克科技	5,000	364,400.00	1.24
33	601288	农业银行	100,000	353,000.00	1.20
34	300733	西菱动力	22,000	331,980.00	1.13
35	600584	长电科技	10,000	311,700.00	1.06
36	601698	中国卫通	15,000	298,200.00	1.01
37	002101	广东鸿图	15,000	293,700.00	1.00
38	600760	中航沈飞	6,000	270,000.00	0.92
39	688227	品高股份	10,000	248,300.00	0.84
40	000999	华润三九	4,000	242,640.00	0.82
41	603738	泰晶科技	14,000	232,540.00	0.79
42	002371	北方华创	400	127,060.00	0.43
43	002415	海康威视	2,000	66,220.00	0.23
44	600276	恒瑞医药	1,000	47,900.00	0.16
45	002568	百润股份	1,000	36,350.00	0.12
46	688012	中微公司	200	31,290.00	0.11
47	600460	士兰微	1,000	30,270.00	0.10
48	603027	千禾味业	1,000	21,120.00	0.07

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002568	百润股份	4,250,257.20	12.11
2	002230	科大讯飞	4,101,686.03	11.69
3	688111	金山办公	3,065,856.00	8.73
4	601398	工商银行	2,830,000.00	8.06
5	000063	中兴通讯	2,497,775.00	7.12
6	603986	兆易创新	2,441,474.00	6.96
7	300570	太辰光	2,419,716.00	6.89
8	601288	农业银行	2,409,900.00	6.87

9	301018	申菱环境	1,953,301.60	5.56
10	601939	建设银行	1,907,800.00	5.44
11	000625	长安汽车	1,886,785.00	5.38
12	601988	中国银行	1,874,000.00	5.34
13	300613	富瀚微	1,855,550.00	5.29
14	000807	云铝股份	1,808,200.00	5.15
15	300548	博创科技	1,731,530.00	4.93
16	688766	普冉股份	1,681,203.64	4.79
17	603019	中科曙光	1,643,370.00	4.68
18	688268	华特气体	1,627,480.28	4.64
19	002410	广联达	1,615,820.00	4.60
20	600150	中国船舶	1,577,344.00	4.49
21	300638	广和通	1,571,367.00	4.48
22	002865	钧达股份	1,549,139.00	4.41
23	688385	复旦微电	1,543,205.29	4.40
24	300037	新宙邦	1,532,031.00	4.36
25	600050	中国联通	1,472,000.00	4.19
26	002747	埃斯顿	1,462,704.00	4.17
27	301039	中集车辆	1,455,733.00	4.15
28	600522	中天科技	1,440,065.00	4.10
29	002371	北方华创	1,418,843.00	4.04
30	300308	中际旭创	1,409,173.00	4.01
31	600009	上海机场	1,408,950.00	4.01
32	300763	锦浪科技	1,402,280.00	3.99
33	688122	西部超导	1,399,240.96	3.99
34	600362	江西铜业	1,374,235.00	3.92
35	002594	比亚迪	1,371,302.00	3.91
36	688559	海目星	1,361,262.96	3.88
37	300727	润禾材料	1,339,376.00	3.82
38	603348	文灿股份	1,328,992.00	3.79
39	600584	长电科技	1,288,009.00	3.67
40	688700	东威科技	1,283,298.00	3.66
41	688568	中科星图	1,273,531.78	3.63
42	600732	爱旭股份	1,262,816.00	3.60
43	600703	三安光电	1,262,017.00	3.60
44	601985	中国核电	1,259,100.00	3.59

45	300502	新易盛	1,255,808.00	3.58
46	600363	联创光电	1,254,922.00	3.58
47	002603	以岭药业	1,247,980.00	3.56
48	688138	清溢光电	1,214,296.40	3.46
49	002599	盛通股份	1,207,824.00	3.44
50	601689	拓普集团	1,207,210.00	3.44
51	600941	中国移动	1,199,155.00	3.42
52	300782	卓胜微	1,179,398.40	3.36
53	600089	特变电工	1,179,228.00	3.36
54	002101	广东鸿图	1,175,610.00	3.35
55	300623	捷捷微电	1,174,720.00	3.35
56	688106	金宏气体	1,141,361.56	3.25
57	688707	振华新材	1,134,161.38	3.23
58	601186	中国铁建	1,126,500.00	3.21
59	688981	中芯国际	1,125,821.11	3.21
60	300480	光力科技	1,116,909.00	3.18
61	300474	景嘉微	1,115,857.00	3.18
62	600276	恒瑞医药	1,110,827.00	3.16
63	002261	拓维信息	1,095,100.00	3.12
64	002373	千方科技	1,089,700.00	3.10
65	300595	欧普康视	1,085,082.00	3.09
66	000810	创维数字	1,079,850.00	3.08
67	300671	富满微	1,079,690.00	3.08
68	002415	海康威视	1,068,292.00	3.04
69	300476	胜宏科技	1,060,000.00	3.02
70	601020	华钰矿业	1,021,115.00	2.91
71	603650	彤程新材	1,012,200.00	2.88
72	688200	华峰测控	1,010,160.00	2.88
73	603169	兰石重装	1,006,891.00	2.87
74	601899	紫金矿业	998,400.00	2.84
75	300684	中石科技	993,426.00	2.83
76	300442	润泽科技	978,601.90	2.79
77	002837	英维克	975,606.00	2.78
78	688525	佰维存储	961,254.24	2.74
79	300413	芒果超媒	949,464.00	2.70
80	688608	恒玄科技	936,266.00	2.67

81	002334	英威腾	931,200.00	2.65
82	000568	泸州老窖	929,800.00	2.65
83	600460	士兰微	928,985.00	2.65
84	600845	宝信软件	921,864.00	2.63
85	603915	国茂股份	920,215.00	2.62
86	601600	中国铝业	904,885.00	2.58
87	002601	龙佰集团	899,544.00	2.56
88	002709	天赐材料	899,390.00	2.56
89	000858	五粮液	885,556.00	2.52
90	002487	大金重工	874,900.00	2.49
91	605358	立昂微	861,815.00	2.46
92	603083	剑桥科技	846,462.00	2.41
93	002352	顺丰控股	832,410.00	2.37
94	300602	飞荣达	813,781.00	2.32
95	002154	报喜鸟	811,123.00	2.31
96	002555	三七互娱	807,384.00	2.30
97	002992	宝明科技	800,743.80	2.28
98	300863	卡倍亿	778,897.00	2.22
99	601607	上海医药	771,780.00	2.20
100	601728	中国电信	770,200.00	2.19
101	603383	顶点软件	766,591.00	2.18
102	688313	仕佳光子	755,370.00	2.15
103	688777	中控技术	751,102.44	2.14
104	002463	沪电股份	749,495.00	2.14
105	688041	海光信息	747,107.78	2.13
106	688636	智明达	739,580.00	2.11
107	601117	中国化学	732,500.00	2.09
108	000988	华工科技	727,000.00	2.07
109	000516	国际医学	718,800.00	2.05
110	002129	TCL 中环	718,206.00	2.05
111	002351	漫步者	711,010.00	2.03

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

#### 7.4.2 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	002568	百润股份	4,943,113.00	14.08
2	002230	科大讯飞	4,144,244.00	11.81
3	688111	金山办公	3,379,493.15	9.63
4	002410	广联达	2,571,364.00	7.33
5	600009	上海机场	2,489,534.10	7.09
6	601398	工商银行	2,418,000.00	6.89
7	603986	兆易创新	2,362,939.00	6.73
8	300570	太辰光	2,267,989.00	6.46
9	300308	中际旭创	2,173,850.00	6.19
10	601288	农业银行	2,112,100.00	6.02
11	300548	博创科技	2,064,224.00	5.88
12	002415	海康威视	2,051,097.00	5.84
13	601988	中国银行	2,048,000.00	5.83
14	000858	五粮液	1,985,692.00	5.66
15	000063	中兴通讯	1,982,481.00	5.65
16	601939	建设银行	1,951,300.00	5.56
17	300613	富瀚微	1,931,306.00	5.50
18	301018	申菱环境	1,925,188.00	5.48
19	002594	比亚迪	1,848,453.00	5.27
20	603027	千禾味业	1,760,480.00	5.02
21	601899	紫金矿业	1,733,034.00	4.94
22	000807	云铝股份	1,704,354.00	4.86
23	600150	中国船舶	1,627,204.00	4.64
24	603019	中科曙光	1,614,276.00	4.60
25	601021	春秋航空	1,560,826.00	4.45
26	688385	复旦微电	1,533,348.79	4.37
27	688268	华特气体	1,517,119.06	4.32
28	688766	普冉股份	1,481,239.62	4.22
29	600519	贵州茅台	1,424,800.00	4.06
30	002149	西部材料	1,422,877.00	4.05
31	300727	润禾材料	1,415,339.00	4.03
32	600050	中国联通	1,408,811.00	4.01
33	000568	泸州老窖	1,405,102.00	4.00
34	600522	中天科技	1,402,495.13	4.00
35	688559	海目星	1,399,994.17	3.99
36	300037	新宙邦	1,395,856.60	3.98

37	301039	中集车辆	1,371,031.00	3.91
38	600760	中航沈飞	1,334,408.00	3.80
39	688525	佰维存储	1,327,312.39	3.78
40	600362	江西铜业	1,314,000.00	3.74
41	002599	盛通股份	1,295,466.00	3.69
42	300763	锦浪科技	1,283,004.00	3.66
43	603517	绝味食品	1,259,784.00	3.59
44	300474	景嘉微	1,248,742.00	3.56
45	600703	三安光电	1,242,745.00	3.54
46	000625	长安汽车	1,239,700.00	3.53
47	603939	益丰药房	1,225,520.00	3.49
48	002261	拓维信息	1,223,747.00	3.49
49	688568	中科星图	1,220,170.14	3.48
50	002603	以岭药业	1,210,676.00	3.45
51	002371	北方华创	1,202,200.00	3.42
52	601985	中国核电	1,194,500.00	3.40
53	600941	中国移动	1,162,444.03	3.31
54	002727	一心堂	1,157,457.00	3.30
55	000810	创维数字	1,153,504.22	3.29
56	600845	宝信软件	1,135,659.00	3.24
57	000831	中国稀土	1,134,500.00	3.23
58	300502	新易盛	1,130,700.00	3.22
59	688707	振华新材	1,121,533.25	3.20
60	601689	拓普集团	1,120,359.00	3.19
61	688138	清溢光电	1,118,329.41	3.19
62	600089	特变电工	1,106,200.00	3.15
63	000970	中科三环	1,095,811.00	3.12
64	300782	卓胜微	1,084,951.00	3.09
65	300623	捷捷微电	1,063,451.00	3.03
66	601186	中国铁建	1,052,400.00	3.00
67	300101	振芯科技	1,047,333.00	2.98
68	300442	润泽科技	1,038,414.00	2.96
69	600258	首旅酒店	1,029,980.00	2.93
70	688981	中芯国际	1,023,611.40	2.92
71	603650	彤程新材	1,021,628.00	2.91
72	601888	中国中免	1,021,175.00	2.91
73	600276	恒瑞医药	1,018,970.00	2.90
74	002928	华夏航空	1,015,063.00	2.89

75	300671	富满微	1,011,886.00	2.88
76	002373	千方科技	1,011,136.00	2.88
77	601020	华钰矿业	993,010.00	2.83
78	300638	广和通	988,485.00	2.82
79	603083	剑桥科技	979,910.00	2.79
80	300498	温氏股份	971,267.00	2.77
81	300595	欧普康视	965,270.00	2.75
82	300476	胜宏科技	961,694.00	2.74
83	002865	钧达股份	951,290.00	2.71
84	002747	埃斯顿	950,812.00	2.71
85	300684	中石科技	935,996.00	2.67
86	300413	芒果超媒	931,510.00	2.65
87	600584	长电科技	927,120.00	2.64
88	000988	华工科技	918,508.00	2.62
89	603169	兰石重装	918,127.00	2.62
90	002487	大金重工	917,640.00	2.61
91	603737	三棵树	900,000.00	2.56
92	002334	英威腾	880,182.00	2.51
93	600487	亨通光电	878,510.00	2.50
94	688200	华峰测控	874,098.49	2.49
95	601600	中国铝业	867,600.00	2.47
96	688608	恒玄科技	854,225.96	2.43
97	300776	帝尔激光	844,200.00	2.41
98	603915	国茂股份	840,191.00	2.39
99	002837	英维克	827,126.00	2.36
100	002101	广东鸿图	822,823.00	2.34
101	300274	阳光电源	822,286.00	2.34
102	002709	天赐材料	797,947.00	2.27
103	600460	士兰微	797,048.00	2.27
104	002601	龙佰集团	788,589.00	2.25
105	002352	顺丰控股	785,408.00	2.24
106	688041	海光信息	785,272.62	2.24
107	603345	安井食品	783,965.00	2.23
108	002992	宝明科技	782,297.00	2.23
109	603383	顶点软件	781,708.20	2.23
110	601607	上海医药	765,703.00	2.18
111	605358	立昂微	749,285.00	2.13
112	601728	中国电信	737,200.00	2.10

113	002154	报喜鸟	737,146.41	2.10
114	300602	飞荣达	731,471.00	2.08
115	002129	TCL 中环	713,300.00	2.03
116	300480	光力科技	708,952.00	2.02
117	000516	国际医学	702,959.00	2.00

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

### 7.4.3 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	212,410,366.44
卖出股票收入（成交）总额	216,569,611.42

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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

基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，优化资产配置，谨慎投资，以降低投资组合的整体风险，达到套期保值的目标。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过套期保值降低投资组合的整体风险，获取超额收益。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

### 7.12.3 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	41,162.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,162.65

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
442	119,346.87	20,991,471.87	39.79%	31,759,846.67	60.21%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

注：基金管理人的从业人员，是指在基金管理人负责公募基金管理业务或者实际履行公募基金管理业务相应职责的人员以及可能接触公募基金管理业务未公开信息的人员，不包括与公募基金管理业务不直接相关的其他业务部门以及后台职能部门的工作人员。

### 8.3 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年3月25日）基金份额总额	276,496,226.65
本报告期期初基金份额总额	57,215,197.33
本报告期基金总申购份额	723,502.63
减：本报告期基金总赎回份额	5,187,381.42
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	52,751,318.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动：

#### 1、公司层面

公司董事会于 2023 年 1 月 18 日收到董事会秘书朱玉萍女士递交的辞职报告，上述辞职自董事会聘任新任董事会秘书之日起生效。辞职后不再担任公司其它职务。同时，朱玉萍女士向董事会一并辞去了其所担任的公司副总经理职务，该辞职自 2023 年 1 月 18 日起生效。

公司董事会于 2023 年 1 月 31 至 2 月 7 日以书面会议形式召开了第二届董事会第十七次会议（临时会议）。董事会根据薪酬与提名委员会提名决定聘任孙冠楠先生担任公司董事会秘书、副总经理。

公司董事会于 2023 年 3 月 9 日收到董事会秘书、副总经理孙冠楠先生递交的辞职报告，自 2023 年 3 月 9 日起辞职生效。

公司董事会于 2023 年 4 月 25 日以现场会议+视频会议形式召开了第二届董事会第十八次会议。董事会根据公司总经理杨江权先生提名，决定聘任赵红宇女士为公司首席信息官、副总经理。

公司董事会于 2023 年 5 月 30 日至 6 月 6 日以书面会议形式召开了第二届董事会第十九次会议（临时会议）。董事会根据薪酬与提名委员会提名，决定聘任李永梅女士为公司董事会秘书。

#### 2、基金业务层面

无。

#### 3、期后事项

公司董事会于 2023 年 7 月 24 日收到副总经理储钢汉先生递交的辞职报告，自 2023 年 7 月 24 日起辞职生效。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；涉及基金管理人的其他未决诉讼均不会对基金管理人日常经营造成重大影响，亦不会对基金管理人履行基金管理职责造成影响。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，管理人公募基金业务及其高级管理人员不存在受到稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	2	428,979,977.86	100.00%	395,224.89	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金本报告期内无新增和剔除席位，与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国都证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

## 10.8 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	国都聚成混合型证券投资基金2022年第4季度报告	证监会指定媒体	2023年1月20日
2	国都聚成混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	证监会指定媒体	2023年3月11日
3	国都聚成混合型证券投资基金2022年年度报告	证监会指定媒体	2023年3月30日
4	国都聚成混合型证券投资基金2023年第1季度报告	证监会指定媒体	2023年4月20日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《国都聚成混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 2、《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》及其更新
- 3、《国都聚成混合型证券投资基金托管协议》及其更新
- 4、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 [www.guodu.com](http://www.guodu.com)。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.guodu.com](http://www.guodu.com)）查阅。

国都证券股份有限公司

2023 年 8 月 30 日