

# 大成睿鑫股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.10 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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59

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 .....	60
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	70
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 .....	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.14 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
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 .....	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
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 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	大成睿鑫股票型证券投资基金	
基金简称	大成睿鑫股票	
基金主代码	009069	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年8月11日	
基金管理人	大成基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	313,401,163.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
下属分级基金的交易代码	009069	009070
报告期末下属分级基金的份额总额	274,325,678.68份	39,075,485.15份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化行业深度研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，充分发挥公司股票研究团队“自下而上”的主动选股能力，以定性和定量相结合的方法，基于对个股深入的基本面研究和细致的实地调研，精选股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

### 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		大成基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段皓静	张姗
	联系电话	0755-83183388	400-61-95555
	电子邮箱	office@dcfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008885558	400-61-95555
传真		0755-83199588	0755-83195201

注册地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、 27-33 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518054	518040
法定代表人	吴庆斌	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dcfund.com.cn
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	大成基金管理有限公司	广东省深圳市南山区海德三道 1236 号大成基金总部大厦 5 层、27-33 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
本期已实现收益	9,702,735.72	2,107,249.67	15,545,794.68	1,566,527.30	106,318,308.71	7,871,959.01
本期利润	-4,880,006.97	-580,341.65	-71,617,412.06	-8,555,663.00	68,880,743.23	5,999,412.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0163	-0.0108	-0.2048	-0.2303	0.0874	0.0994
本期加权	-1.51%	-1.01%	-19.24%	-21.76%	8.10%	9.23%

平均 净值 利润 率						
本期 基金 份额 净值 增长 率	-2.65%	-3.03%	-15.45%	-15.79%	15.23%	14.77%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末 可供 分配 利润	6,567,602.86	397,904.44	16,692,601.36	1,459,931.78	52,951,966.74	4,545,291.93
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.0239	0.0102	0.0518	0.0418	0.1381	0.1317
期末 基金 资产 净值	280,893,281.54	39,473,389.59	338,781,326.44	36,389,355.54	477,052,693.65	42,701,366.85
期末 基金 份额 净值	1.0239	1.0102	1.0518	1.0418	1.2440	1.2371
3.1.3 累计 期末 指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	2.39%	1.02%	5.18%	4.18%	24.40%	23.71%

注：1、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。

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。

## 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

大成睿鑫股票 A

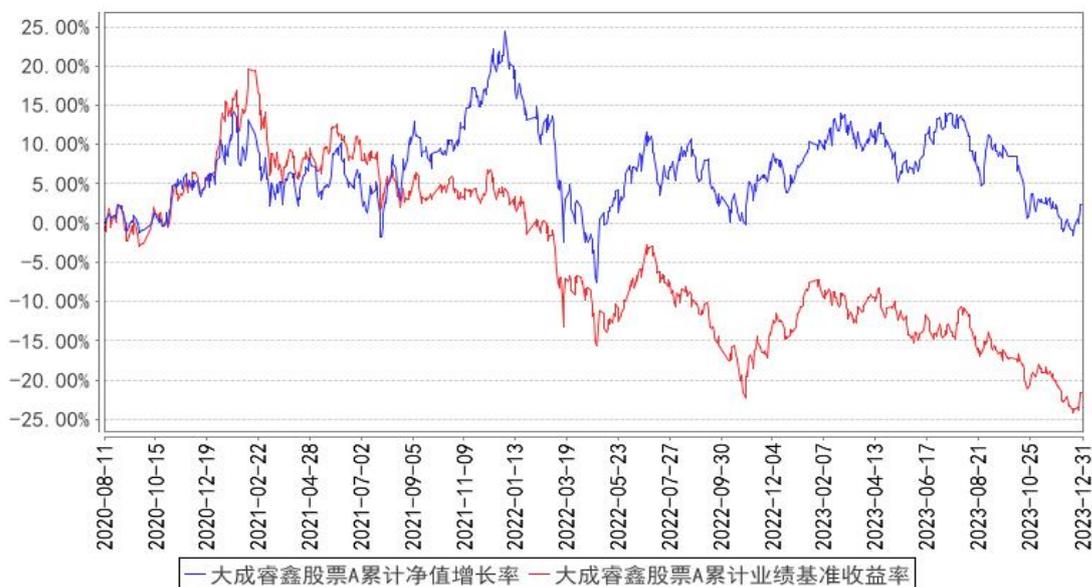
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.67%	0.71%	-5.47%	0.68%	-0.20%	0.03%
过去六个月	-9.67%	0.72%	-8.70%	0.74%	-0.97%	-0.02%
过去一年	-2.65%	0.75%	-9.16%	0.73%	6.51%	0.02%
过去三年	-5.16%	1.01%	-28.15%	0.95%	22.99%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.39%	0.98%	-21.61%	0.94%	24.00%	0.04%

大成睿鑫股票 C

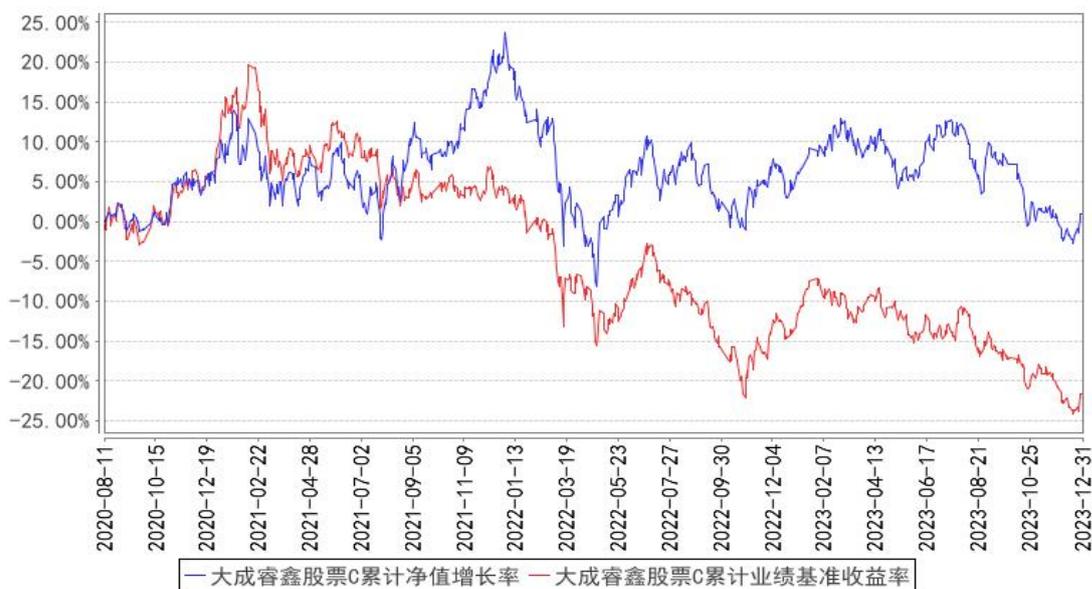
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.76%	0.71%	-5.47%	0.68%	-0.29%	0.03%
过去六个月	-9.85%	0.72%	-8.70%	0.74%	-1.15%	-0.02%
过去一年	-3.03%	0.75%	-9.16%	0.73%	6.13%	0.02%
过去三年	-6.28%	1.01%	-28.15%	0.95%	21.87%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.02%	0.98%	-21.61%	0.94%	22.63%	0.04%

### 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

大成睿鑫股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



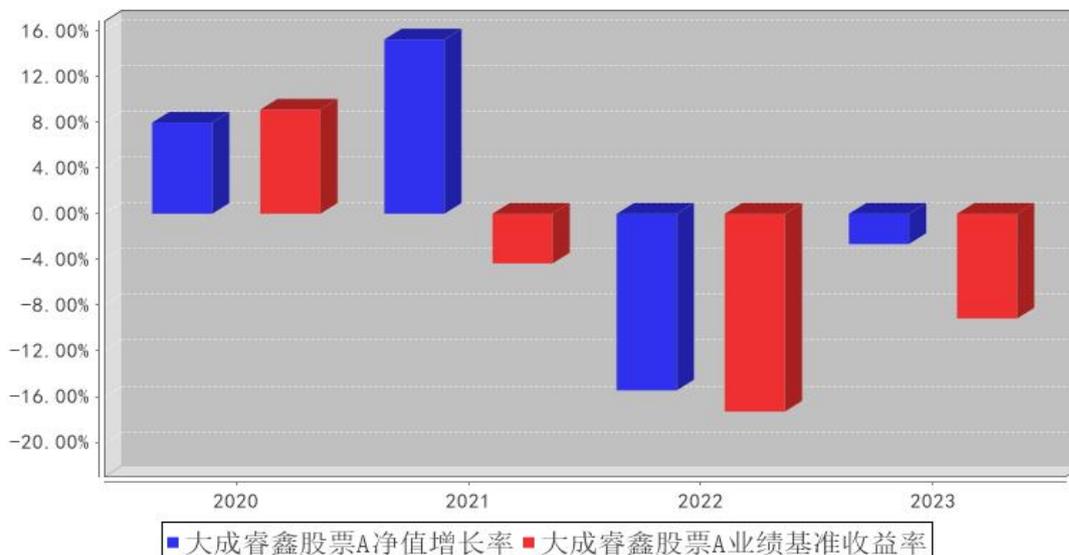
大成睿鑫股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



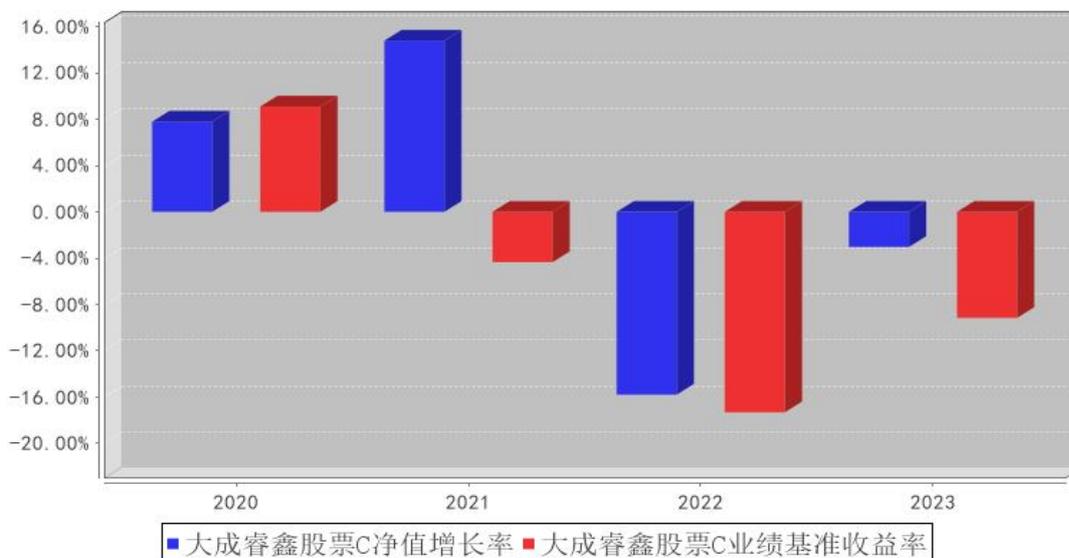
注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

大成睿鑫股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



大成睿鑫股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

大成基金管理有限公司成立于 1999 年 4 月 12 日，注册资本人民币 2 亿元，是中国首批获准

成立的“老十家”基金管理公司之一。公司总部位于深圳，同时设置了北方、华东和南方营销总部，在北京、上海等地开设有 5 家分公司。2009 年，公司在香港设立大成国际资产管理有限公司，大力拓展国际业务；2013 年，设立大成创新资本管理有限公司，开拓专户及专项管理业务。

公司业务资质齐全，全面覆盖公募基金、机构投资、海外投资、财富管理、养老金管理等业务，还受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金和基本养老保险基金。旗下大成国际资产管理公司具备 QFII、RQFII 等资格，是首批首家完成备案的能够提供港股通投资顾问服务的香港机构。

历经二十余年的磨砺和沉淀，大成基金形成了以长期投资能力为核心的竞争优势，打造了一支具有良好职业素养和丰富经验的资产管理队伍。公司目前已形成权益投资、固收投资、指数与期货投资、跨境投资、混合资产投资、大类资产配置六大投资团队，全面覆盖各类投资领域，综合实力不断提升，各项业务迅猛发展，管理资产种类位居同业前列。

#### 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		
刘旭	本基金基金经理，股票投资部总监、董事总经理	2020 年 8 月 11 日	-	12 年	厦门大学管理学硕士。2009 年至 2010 年在毕马威华振会计师事务所任审计师。2011 年 2 月至 2013 年 5 月任广发证券研究所研究员。2013 年 5 月加入大成基金管理有限公司，曾担任研究部研究员、基金经理助理、股票投资部副总监，现任股票投资部总监、董事总经理。2015 年 7 月 29 日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 20 日至 2021 年 3 月 17 日任大成创新成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。2019 年 12 月 24 日起任大成优势企业混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 5 日起任大成睿裕六个月持有期股票型证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 11 日起任大成睿鑫股票型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月 15 日起任大成核心价值甄选混合型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 7 日起任大成匠心卓越三年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 18 日起任大成慧心优选一年持有期混合

					型证券投资基金基金经理。2023 年 12 月 1 日起任大成至信回报三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
郑欣	本基金经理助理	2023 年 4 月 26 日	-	7 年	CFA, 厦门大学经济学硕士。2016 年 7 月至 2019 年 6 月任第一创业证券资产管理部研究员。2019 年 7 月加入大成基金管理有限公司, 现任固定收益总部研究主管兼基金经理。2021 年 11 月 26 日起任大成惠恒一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 2 月 25 日起任大成惠享一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 14 日起任大成景乐纯债债券型证券投资基金、大成景泰纯债债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成景悦中短债债券型证券投资基金基金经理。2024 年 1 月 17 日起任大成惠福纯债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。国籍：中国
赵蓬	本基金经理助理	2022 年 7 月 14 日	2023 年 8 月 4 日	7 年	北京大学经济学硕士。2015 年 7 月至 2015 年 10 月任深圳盈信资产管理有限公司投资部投资经理。2016 年 2 月至 2019 年 2 月任华泰证券研究所研究员。2019 年 2 月加入大成基金管理有限公司, 曾担任研究部研究员、基金经理助理, 现任研究部基金经理。2023 年 8 月 4 日起任大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国
方锐	本基金经理助理	2020 年 11 月 6 日	2023 年 4 月 26 日	7 年	北京大学经济学硕士。2015 年 7 月至 2016 年 11 月就职于中国人民银行深圳市中心支行, 任货币信贷管理处科员。2016 年 11 月加入大成基金管理有限公司, 先后担任固定收益总部助理研究员、基金经理助理、基金经理。2020 年 9 月 7 日起任大成彭博农发行债券 1-3 年指数证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月 30 日至 2024 年 1 月 17 日任大成中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 4 月起任大成安诚债券型证券投

					<p>资基金基金经理。2022 年 6 月 2 日起任大成景盈债券型证券投资基金基金经理。2022 年 7 月 27 日任大成惠兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 12 月 4 日起任大成稳益 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 25 日起任大成景信债券型证券投资基金基金经理。2023 年 10 月 27 日起任大成稳安 60 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2023 年 11 月 9 日起任大成景熙利率债债券型证券投资基金基金经理。具备基金从业资格。</p> <p>国籍：中国</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，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。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持，投资部门负责投资决策，交易管理部负责实施交易并实时监控，监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核，风险管理部负责对交易情况进行合理性分析，通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行了公平交易的原则和制度。公司运用统计分析方法和工具，对旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内及 5 日内股票及债券交易同向交易价差进行分析，针对同一基金经理管理的多个投资组合及公私募兼任基金经理管理的多个投资组合的投资交易行为加强了公平交易监测与分析，包括对不同时间窗下（同日、3 日、5 日、10 日）反向交易和同向交易价差监控的分析。分析结果表明：债券交易同向交易频率较低；部分股票同向交易溢价率较大主要来源于投资策略差异、市场因素（如个股当日价格振幅较高）及组合经理交易时机选择，即投资组合成交时间不一致以及成交价格的日内较大变动导致个别些组合间的成交价格差异较大，同时结合交易价差专项统计分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合未发现存在异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价，未发生成交较少的单边交易量超过该股当日成交量 5% 的股票同日反向交易；主动投资组合间债券交易存在 1 笔同日反向交易，原因为流动性需要。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响，无异常。

## 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

转眼又是一年，感谢持有人的陪伴！

对中国来说，2023 年是我国进入新阶段后的一个重要年度，他的重要性主要体现在短周期上——经历了三年疫情，居民和地方政府的资产负债表被削弱，证伪了年初相对乐观的预期。而中长周期因素的演化方向在 2023 年中并未发生改变，2023 年的历史作用是让疫情不能再成为理由后，证券市场在经济下行压力进行了一定程度的反馈。

我们这里提及的中长周期要素，首先是人口。2023 年是中国总人口绝对值下降的第二年，降幅比 2022 年大，年龄结构在后移，这一变化将在未来影响很多产业的发展。其次是地产问题与外部市场约束。对内较为宽松的流动性叠加地产对货币吸纳能力的下降，导致制造业投资走高和国内利率进一步在底部徘徊。国内相对过剩的制造业产能需要外送，而外部市场政策环境对中国具备全球竞争力的产业形成了一定制约，这一客观背景将对潜在出海企业进行筛选，机遇与挑战并存。

对世界来说，2023 年确实是不平凡的一年！在人工智能行业，过去数年的技术创新在 23 年开

花结果，无论是国际还是国内资本市场的相关公司，股价都给予了积极回应。技术进步是人类社会前进的永恒驱动，股价上涨是人们对更好生活的本能向往。我们作为专业投资者，即便在近年内不会形成持仓，也会持续跟踪产业变化及对百行千业的影响。

2023 年沪深 300 下跌 11.38%，中证 500 下跌 7.42%。由于对经济预期偏弱，宏观经济相关个股普遍承压。在经济不确定的背景下，高股息和与经济无关的博弈工具如微盘股在 2023 年表现较好。本组合在 2023 年 A 类份额下降 2.65%，C 类份额下降 3.03%，主因组合内运营商、能源、家电等高股息标的在 23 年风格下获得一定表现，但组合内制造业公司普遍出现回撤，抵减了前者带来的回报。

23 年在研究上的积累与此前年度没有区别。投资需要理性，理性包含但不限于如谨慎推导结论、不要过度简化事物、分清部分与整体的关系、尊重历史形成过程等基本观点，然后将这些要素带入到一个个商业案例中去实践。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末大成睿鑫股票 A 的基金份额净值为 1.0239 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.65%，同期业绩比较基准收益率为-9.16%；截至本报告期末大成睿鑫股票 C 的基金份额净值为 1.0102 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.03%，同期业绩比较基准收益率为-9.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

24 年初把 23 年的风格演绎的更加极致。部分高股息公司随着上涨吸引力在确定性下降，而部分与宏观经济和产业发展更加相关的公司的性价比在凸显。过去，现在和未来，本组合都不会将阶段性风格作为组合构建的考虑要素，组合内持仓买入的唯一原因是管理人认为该公司的价值可能低于当下价格，所以本组合也会动态调整，权衡风险与收益。我们对 24 年证券市场表现抱有谨慎乐观的态度，我们承认很多长期因素会深刻影响中国经济，我们也应看到股价至少已经部分反应了这种预期。中国是无可回避的全球第二大经济体，无论愿意还是不愿意，都将以他特有方式融入外部世界，与全球一起经历技术迭代与文化互通。未来十年，70 后和 80 后的企业家将逐步成为中国经济的主角，虽然相比更早的几代企业家没有了内需红利，但他们的成长环境具备更好的视野和创造性。我们相信会有一批优秀团队在逐步适应中国发展新阶段的内外部环境后，打造出具备国际竞争力的企业，助力中国经济的转型升级。

最后，再一次感谢持有人一直以来无声的鼓励与支持！

#### 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，依据相关的法律法规、基金合同以及内部监察稽核制度，本基金管理人对本基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行了监察稽核。内部监察稽核的重点是：国家法

律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；资讯管制和保密工作落实情况；员工职业操守规范情况，目的是规范基金财产的运作，防范和控制投资风险，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，维护本基金份额持有人的合法权益。

（一）根据最新的法律法规、规章、规范性文件，本基金管理人及时制定了相应的公司制度，并对现有制度进行不断修订和完善，确保本基金管理人内控制度的适时性、全面性和合法合规性。同时，为保障制度的适时性，避免部分内控制度、业务规则与业务发展不相适应，报告期内本基金管理人组织各部门对内部管理制度作了进一步梳理和完善。

（二）全面加强风险监控，不断提高基金业务风险管理水平。为督促各部门完善并落实各项内控措施，公司严格执行风险控制管理员制度，健全内控工作协调机制及监督机制，并进一步加强投资风险量化评价能力及事前风险防范能力，有效防范相关业务风险。同时，公司严格执行投资报备制度，建立了基金从业人员证券投资管理监控信息系统，将投资报备工作纳入常态。

（三）日常监察和专项监察相结合，确保监察稽核的有效性和深入性。本年度，公司继续对本基金销售、宣传等方面的材料、协议及其他法律资料等进行了严格审查，对本基金各项投资比例、投资权限、基金交易、股票投资限制、股票库维护等方面进行实时监控，同时，还专门针对基金投资交易（包括公平交易、转债投资、投资权限、投资比例、流动性风险、基金重仓股等）、基金运营（基金头寸、基金结算、登记清算等）、网上交易、基金销售等进行专项监察。通过日常监察，保证了公司监察的全面性、实时性，通过专项监察，及时发现并纠正了业务中的潜在风险，加强了业务部门和人员的风险意识，从而较好地预防了风险的发生。

（四）加强了对投资管理人员通讯工具在交易时间的集中管理，定期或不定期对投资管理人员的网络即时通讯记录、电话录音等进行抽查，有效的防范了各种形式的利益输送行为。

（五）以多种方式加强合规教育与培训，提高全公司的合规守法意识。及时向全公司传达与基金相关的法律法规，并要求公司各部门贯彻到日常工作中。公司监察稽核部通过解答各业务部门提出的法律问题，提供法律依据，对于较为重大疑难法律事项及时咨询公司外部律师或监管部门，避免了业务发展中的盲目性，及时防范风险，维护了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

本基金管理人指导基金估值业务的领导小组为公司估值委员会，公司估值委员会主要负责估值政策和估值程序的制定、修订以及执行情况的监督。估值委员会由公司各投研部门、交易管理部、风险管理部、监察稽核部、基金运营部指定人员组成。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员中包括八名投资组合经理。

各投研部门、风险管理部负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于

不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量；定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；交易管理部负责关注相关投资品种的流动性状况，协助反馈其市场交易信息；基金运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，并负责与托管行沟通估值调整事项；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，投资组合经理作为估值小组成员，对持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间交易的债券品种的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内本基金无收益分配事项。

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

无。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	大成睿鑫股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了大成睿鑫股票型证券投资基金（以下简称“大成睿鑫股票基金”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 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，后附的大成睿鑫股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了大成睿鑫股票基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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，我们独立于大成睿鑫股票基金，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。
其他信息	大成睿鑫股票基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。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。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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。在编制财务报表时，管理层负责评估大成睿鑫股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督大成睿鑫股票基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	<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。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：（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。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对大成睿鑫股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致大成睿鑫股票基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华   林恩丽
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2024年3月28日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	49,195,705.97	67,755,159.17
结算备付金		89,802.27	-
存出保证金		39,358.03	24,236.73
交易性金融资产	7.4.7.2	271,960,583.00	308,381,663.01
其中：股票投资		271,946,199.29	308,381,663.01
基金投资		-	-
债券投资		14,383.71	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		37,751.00	135,371.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		321,323,200.27	376,296,430.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2.41	0.18
应付赎回款		423,251.39	309,961.25
应付管理人报酬		320,962.35	486,080.99
应付托管费		53,493.71	81,013.51
应付销售服务费		13,140.82	12,512.17
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	7.4.7.9	145,678.46	236,180.08
负债合计		956,529.14	1,125,748.18
<b>净资产：</b>			

实收基金	7.4.7.10	313,401,163.83	357,018,148.84
未分配利润	7.4.7.12	6,965,507.30	18,152,533.14
净资产合计		320,366,671.13	375,170,681.98
负债和净资产总计		321,323,200.27	376,296,430.16

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 313,401,163.83 份，其中，A 类基金份额净值 1.0239 元，基金份额 274,325,678.68 份；C 类基金份额净值 1.0102 元，基金份额 39,075,485.15 份。

## 7.2 利润表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		1,089,948.71	-72,541,343.46
1. 利息收入		223,226.37	223,789.42
其中：存款利息收入	7.4.7.13	223,226.37	223,789.42
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,047,754.25	24,455,875.28
其中：股票投资收益	7.4.7.14	7,973,537.43	14,199,017.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	12.03	36,112.93
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	10,074,204.79	10,220,745.17
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-17,270,334.01	-97,285,397.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	89,302.10	64,388.88
<b>减：二、营业总支出</b>		6,550,297.33	7,631,731.60

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,231,538.67	6,193,828.02
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	871,923.14	1,032,304.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	230,605.19	157,788.25
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	216,230.33	247,810.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,460,348.62	-80,173,075.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,460,348.62	-80,173,075.06
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-5,460,348.62	-80,173,075.06

### 7.3 净资产变动表

会计主体：大成睿鑫股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	357,018,148.84	-	18,152,533.14	375,170,681.98
二、本期期初净资产	357,018,148.84	-	18,152,533.14	375,170,681.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,616,985.01	-	-11,187,025.84	-54,804,010.85
（一）、综合收益总额	-	-	-5,460,348.62	-5,460,348.62
（二）、本期基金份额	-43,616,985.01	-	-5,726,672.67	-49,343,657.68

额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)			7.22	2.23
其中：1. 基金申购款	119,039,695.89	-	9,933,493.09	128,973,188.98
2. 基金赎回款	-162,656,680.90	-	-15,660,170.31	-178,316,851.21
(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	313,401,163.83	-	6,965,507.30	320,366,671.13
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	418,006,523.08	-	101,747,537.42	519,754,060.50
二、本期期初净资产	418,006,523.08	-	101,747,537.42	519,754,060.50
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-60,988,374.24	-	-83,595,004.28	-144,583,378.52
(一)、综合收益总额	-	-	-80,173,075.06	-80,173,075.06
(二)、本期基金份额交易产	-60,988,374.24	-	-3,421,929.22	-64,410,303.46

生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	60,997,316.01	-	5,219,178.67	66,216,494.68
2. 基金赎回款	-121,985,690.25	-	-8,641,107.89	-130,626,798.14
(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	357,018,148.84	-	18,152,533.14	375,170,681.98

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：

谭晓冈

范瑛

梁靖

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

大成睿鑫股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2020】234号文“关于准予大成睿鑫股票型证券投资基金注册的批复”的核准,由大成基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成睿鑫股票型证券投资基金基金合同》作为发起人于2020年7月27日至2020年8月7日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2020)验字第60469430\_H08号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年8月11日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司,注

册登记机构为本基金管理人，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、中期票据、短期融资券）、债券回购、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、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）。本基金可参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产、存托凭证的比例为基金资产的 80%-95%（其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+恒生指数收益率×10%+中证综合债券指数收益率×15%。

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）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。本财务报表以本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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。（1）金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。（2）金融负债分类 本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 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，所有公允价值变动计入当期损益。

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。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，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，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。（2）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值。（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。（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募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。（2）对于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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。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）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；（2）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；（3）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；（4）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。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

#### （1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为1%，由出让方缴纳。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （2）增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	49,195,705.97	67,755,159.17
等于：本金	49,190,438.34	67,747,857.64
加：应计利息	5,267.63	7,301.53
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	49,195,705.97	67,755,159.17

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	273,952,100.81	-	271,946,199.29	-2,005,901.52
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	12,199.92	14,383.71	2,171.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,199.92	14,383.71	2,171.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	273,964,300.73	12.11	271,960,583.00	-2,003,729.84
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	293,115,058.84	-	308,381,663.01	15,266,604.17
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	293,115,058.84	-	308,381,663.01	15,266,604.17

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.00	19.86

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	71,171.46	11,660.22
其中：交易所市场	71,171.46	11,660.22
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	74,500.00	224,500.00
合计	145,678.46	236,180.08

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 大成睿鑫股票 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	322,088,725.08	322,088,725.08
本期申购	48,109,096.78	48,109,096.78
本期赎回（以“-”号填列）	-95,872,143.18	-95,872,143.18
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	274,325,678.68	274,325,678.68

##### 大成睿鑫股票 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,929,423.76	34,929,423.76
本期申购	70,930,599.11	70,930,599.11
本期赎回（以“-”号填列）	-66,784,537.72	-66,784,537.72
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	39,075,485.15	39,075,485.15

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 大成睿鑫股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	58,293,741.83	-41,601,140.47	16,692,601.36
本期期初	58,293,741.83	-41,601,140.47	16,692,601.36
本期利润	9,702,735.72	-14,582,742.69	-4,880,006.97
本期基金份额交易产生的变动数	-10,534,791.11	5,289,799.58	-5,244,991.53
其中：基金申购款	9,612,527.32	-5,519,103.59	4,093,423.73
基金赎回款	-20,147,318.43	10,808,903.17	-9,338,415.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,461,686.44	-50,894,083.58	6,567,602.86

## 大成睿鑫股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,940,151.87	-4,480,220.09	1,459,931.78
本期期初	5,940,151.87	-4,480,220.09	1,459,931.78
本期利润	2,107,249.67	-2,687,591.32	-580,341.65
本期基金份额交易产生的变动数	-464,516.37	-17,169.32	-481,685.69
其中：基金申购款	12,983,927.22	-7,143,857.86	5,840,069.36
基金赎回款	-13,448,443.59	7,126,688.54	-6,321,755.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,582,885.17	-7,184,980.73	397,904.44

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	220,683.83	221,132.84
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	2,144.46	1,759.85
其他	398.08	896.73
合计	223,226.37	223,789.42

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,973,537.43	14,199,017.18
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购	-	-

差价收入		
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	7,973,537.43	14,199,017.18

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总额	212,127,475.98	201,355,208.94
减：卖出股票成本 总额	203,577,017.82	186,588,963.25
减：交易费用	576,920.73	567,228.51
买卖股票差价收 入	7,973,537.43	14,199,017.18

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	12.03	42,147.93
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	-	-6,035.00
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	12.03	36,112.93

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	20,034,287.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	19,978,680.00
减：应计利息总额	-	61,117.80
减：交易费用	-	525.00
买卖债券差价收入	-	-6,035.00

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	10,074,204.79	10,220,745.17
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	10,074,204.79	10,220,745.17

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,270,334.01	-97,285,397.04
股票投资	-17,272,505.69	-97,305,297.04
债券投资	2,171.68	19,900.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-17,270,334.01	-97,285,397.04

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	88,642.91	49,185.18

基金转换费收入	659.19	15,203.70
合计	89,302.10	64,388.88

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

（2）本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
深港通证券组合费	466.69	65.67
银行划款手续费	7,763.64	9,745.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	216,230.33	247,810.67

#### 7.4.7.24 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
大成基金管理有限公司（“大成基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中泰信托有限责任公司	基金管理人的股东
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国银河投资管理有限公司	基金管理人的股东
大成国际资产管理有限公司（“大成国际”）	基金管理人的子公司
大成创新资本管理有限公司（“大成创新资本”）	基金管理人的合营企业

注：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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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（%）
光大证券	239,208,120.12	61.83	156,218,950.58	48.33

##### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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（%）
光大证券	219,559.33	61.52	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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（%）
光大证券	143,153.06	48.31	1,029.61	8.83

注：(1) 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。

(2) 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,231,538.67	6,193,828.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,324,979.91	2,889,845.67
应支付基金管理人的净管理费	2,906,558.76	3,303,982.35

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金管理费的年费率由 1.50% 调整为 1.20%。

### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	871,923.14	1,032,304.66

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2023 年 7 月 10 日起，基金托管费的年费率由 0.25% 调整为 0.20%。

### 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C	合计
大成基金	-	22,136.41	22,136.41

招商银行	-	20,917.18	20,917.18
合计	-	43,053.59	43,053.59
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C	合计
大成基金	-	2,692.78	2,692.78
招商银行	-	24,740.85	24,740.85
合计	-	27,433.63	27,433.63

注：基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行	49,195,705.97	220,683.83	67,755,159.17	221,132.84

注：本基金的活期货币资金由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
光大证券	688052	纳芯微	网下发行	1,131	260,130.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2023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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	61	3,271.43	4,596.96	-

001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股锁定	55.68	37.58	222	12,360.96	8,342.76	-
301381	赛维时代	2023年7月5日	6个月	新股锁定	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股锁定	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股锁定	47.58	30.22	392	18,651.36	11,846.24	-
301487	盟固	2023年8月	6个月	新股锁定	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

	利	1 日								
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新股锁定	39.99	38.81	340	13,596.60	13,195.40	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股锁定	56.56	62.23	236	13,348.16	14,686.28	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定	28.00	22.67	491	13,748.00	11,130.97	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁定	99.57	81.46	103	10,255.71	8,390.38	-
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股锁定	71.80	68.91	145	10,411.00	9,991.95	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301548	崇	2023	6 个月	新股	66.80	58.99	127	8,483.60	7,491.73	-

	德科技	年9月11日		锁定							
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股锁定	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股锁定	24.22	18.24	455	11,020.10	8,299.20	-	
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定	11.25	11.07	514	5,782.50	5,689.98	-	
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定	1.70	4.06	2,463	4,187.10	9,999.78	-	
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定	16.80	31.19	177	2,973.60	5,520.63	-	
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股锁定	58.08	57.81	59	3,426.72	3,410.79	-	
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	160	3,696.00	3,729.60	-	
603119	浙	2023	6个月	新股	15.32	23.87	201	3,079.32	4,797.87	-	

	江 荣 泰	年7月 21日		锁定							
603193	润 本 股 份	2023 年10 月9日	6个月	新股 锁定	17.38	16.66	240	4,171.20	3,998.40	-	
603231	索 宝 蛋 白	2023 年12 月6日	6个月	新股 锁定	21.29	21.53	150	3,193.50	3,229.50	-	
603270	金 帝 股 份	2023 年8月 25日	6个月	新股 锁定	21.77	29.58	192	4,179.84	5,679.36	-	
603273	天 元 智 能	2023 年10 月16 日	6个月	新股 锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603275	众 辰 科 技	2023 年8月 16日	6个月	新股 锁定	49.97	39.70	109	5,446.73	4,327.30	-	
603276	恒 兴 新 材	2023 年9月 18日	6个月	新股 锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-	
603296	华 勤 技 术	2023 年8月 1日	6个月	新股 锁定	80.80	77.75	166	13,412.80	12,906.50	-	
603373	安 邦 护 卫	2023 年12 月13 日	6个月	新股 锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	
688450	光 格 科 技	2023 年7月 17日	6个月	新股 锁定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	
688549	中 巨 芯	2023 年8月 30日	6个月	新股 锁定	5.18	8.09	2,276	11,789.68	18,412.84	-	
688573	信 宇	2023 年8月	6个月	新股 锁定	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	

	人	9 日									
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁定	24.98	28.02	507	12,664.86	14,206.14	-	
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	6 个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-	
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-	
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股锁定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股锁定	31.95	52.25	259	8,275.05	13,532.75	-	
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股锁定	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-	
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股锁定	103.40	78.23	86	8,892.40	6,727.78	-	
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定	42.66	48.18	234	9,982.44	11,274.12	-	
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁定	29.66	36.39	262	7,770.92	9,534.18	-	
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业

倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。 2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。 3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 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由金融工具产生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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以由高层监控(合规与风险管理委员会、公司投资风险控制委员会)、专业监控(监察稽核部、风险管理部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，对公司整体运营风险进行监督，监督风险控制措施的执行。在管理层层面设立投资风险控制委员会，通过定期会议讨论涉及投资风险的重大议题，形成正式决议提交投委会。在业务操作层面，监察稽核部履行合规控制职责，通过定期、不定期检查内控制度的执行情况、对重大风险点以专项稽核的方式确保公司内控制度、流程得到贯彻执行。风险管理部履行风险量化评估分析职责。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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，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。

本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (上年度末：本基金无债券投资)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 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，约定在非正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。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%，且本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产未超过最近工作日确认的净赎回金额。本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”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。除附注期末债券正回购交易中作为抵押的债券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对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	49,195,705.97	-	-	-	49,195,705.97
结算备付金	89,802.27	-	-	-	89,802.27

存出保证金	39,358.03	-	-	-	39,358.03
交易性金融资产	-	-	14,383.71	271,946,199.29	271,960,583.00
应收申购款	-	-	-	37,751.00	37,751.00
资产总计	49,324,866.27	-	14,383.71	271,983,950.29	321,323,200.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	423,251.39	423,251.39
应付管理人报酬	-	-	-	320,962.35	320,962.35
应付托管费	-	-	-	53,493.71	53,493.71
应付清算款	-	-	-	2.41	2.41
应付销售服务费	-	-	-	13,140.82	13,140.82
其他负债	-	-	-	145,678.46	145,678.46
负债总计	-	-	-	956,529.14	956,529.14
利率敏感度缺口	49,324,866.27	-	14,383.71	271,027,421.15	320,366,671.13
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	67,755,159.17	-	-	-	67,755,159.17
存出保证金	24,236.73	-	-	-	24,236.73
交易性金融资产	-	-	-	308,381,663.01	308,381,663.01
应收申购款	-	-	-	135,371.25	135,371.25
资产总计	67,779,395.90	-	-	308,517,034.26	376,296,430.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	309,961.25	309,961.25
应付管理人报酬	-	-	-	486,080.99	486,080.99
应付托管费	-	-	-	81,013.51	81,013.51
应付清算款	-	-	-	0.18	0.18
应付销售服务费	-	-	-	12,512.17	12,512.17
其他负债	-	-	-	236,180.08	236,180.08
负债总计	-	-	-	1,125,748.18	1,125,748.18
利率敏感度缺口	67,779,395.90	-	-	307,391,286.08	375,170,681.98

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(上年度末：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，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。

## 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,968,101.19	-	10,968,101.19
资产合计	-	10,968,101.19	-	10,968,101.19
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	10,968,101.19	-	10,968,101.19
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	805,550.89	-	805,550.89
资产合计	-	805,550.89	-	805,550.89
以外币计价的负债				
负债合	-	-	-	-

计				
资产负债表外 汇风险 敞口净额	-	805,550. 89	-	805,550. 89

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	548,405.06	40,277.55
	所有外币相对人民币贬值 5%	-548,405.06	-40,277.55

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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，所面临的最大的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其它价格风险，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。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产、存托凭证的比例为基金资产的 80%-95%（其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 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 2023年12月31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	271,946,199.29	84.89	308,381,663.01	82.20

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	271,946,199.29	84.89	308,381,663.01	82.20

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	12,345,204.29	15,950,929.13
业绩比较基准下降5%	-12,345,204.29	-15,950,929.13	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	271,399,622.36	307,675,456.47
第二层次	-	-
第三层次	560,960.64	706,206.54

合计	271,960,583.00	308,381,663.01
----	----------------	----------------

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、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 2023年1月1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	-	706,206.54	706,206.54
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,234,410.83	1,234,410.83
转出第三层次	-	1,090,848.20	1,090,848.20
当期利得或损失总额	-	-288,808.53	-288,808.53
其中：计入损益的利得或损失	-	-288,808.53	-288,808.53
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	560,960.64	560,960.64
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	-	120,301.16	120,301.16
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	6,611,330.79	6,611,330.79
转出第三层次	-	6,491,924.88	6,491,924.88
当期利得或损失总额	-	586,800.63	586,800.63
其中：计入损益的利得或损失	-	586,800.63	586,800.63
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	706,206.54	706,206.54
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	-	45,478.31	45,478.31

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	560,960.64	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462 至 2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	706,206.54	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891 至 2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	271,946,199.29	84.63
	其中：股票	271,946,199.29	84.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,383.71	0.00
	其中：债券	14,383.71	0.00
	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	49,285,508.24	15.34
8	其他各项资产	77,109.03	0.02
9	合计	321,323,200.27	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 10,968,101.19 元，占期末基金资产净值的比例为 3.42%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,803,750.65	7.12
C	制造业	229,953,400.87	71.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,154.14	0.02
E	建筑业	27,114.84	0.01
F	批发和零售业	508,982.92	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	1,683,249.86	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,760,725.95	1.49
J	金融业	96,014.26	0.03

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	49,168.46	0.02
M	科学研究和技术服务业	441,640.75	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	210,677.67	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	347,556.93	0.11
R	文化、体育和娱乐业	25,660.80	0.01
S	综合	-	-
	合计	260,978,098.10	81.46

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通讯	738,417.96	0.23
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	-	-
工业	10,229,683.23	3.19
材料	-	-
科技	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	10,968,101.19	3.42

注：以上分类采用彭博行业分类标准。

### 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	000333	美的集团	556,346	30,393,181.98	9.49
2	002884	凌霄泵业	1,596,500	27,715,240.00	8.65
3	002595	豪迈科技	900,000	26,793,000.00	8.36
4	000651	格力电器	732,700	23,570,959.00	7.36
5	601225	陕西煤业	1,087,513	22,718,146.57	7.09
6	603279	景津装备	1,007,820	22,282,900.20	6.96
7	000063	中兴通讯	820,300	21,721,544.00	6.78
8	600031	三一重工	1,119,900	15,421,023.00	4.81
9	603337	杰克股份	648,420	14,005,872.00	4.37
10	601919	中远海控	163,941	1,570,554.78	0.49
10	01919	中远海控	1,438,000	10,229,683.23	3.19
11	600352	浙江龙盛	1,185,216	9,955,814.40	3.11

12	600690	海尔智家	432,354	9,079,434.00	2.83
13	002484	江海股份	288,248	4,629,262.88	1.44
14	002372	伟星新材	172,163	2,491,198.61	0.78
15	603989	艾华集团	93,179	2,005,212.08	0.63
16	00700	腾讯控股	2,700	718,378.72	0.22
17	301153	中科江南	7,061	552,664.47	0.17
18	688213	思特威	9,327	518,208.12	0.16
19	688428	诺诚健华	43,976	505,724.00	0.16
20	688279	峰昭科技	3,762	474,463.44	0.15
21	301269	华大九天	3,905	413,344.25	0.13
22	688249	晶合集成	21,595	372,513.75	0.12
23	301487	盟固利	8,662	364,071.57	0.11
24	301308	江波龙	3,587	330,183.35	0.10
25	688031	星环科技	4,842	315,068.94	0.10
26	688361	中科飞测	4,085	304,046.55	0.09
27	688271	联影医疗	2,209	302,655.09	0.09
28	688387	信科移动	40,988	295,523.48	0.09
29	688382	益方生物	18,872	285,722.08	0.09
30	688052	纳芯微	1,583	264,123.55	0.08
31	688343	云天励飞	5,242	258,168.50	0.08
32	688326	经纬恒润	2,201	255,426.05	0.08
33	301162	国能日新	4,663	241,916.44	0.08
34	688322	奥比中光	6,429	241,601.82	0.08
35	688392	骄成超声	2,883	240,471.03	0.08
36	688172	燕东微	12,214	225,714.72	0.07
37	688401	路维光电	7,173	220,354.56	0.07
38	301558	三态股份	14,578	215,025.20	0.07
39	688472	阿特斯	16,763	211,716.69	0.07
40	301293	三博脑科	3,324	207,484.08	0.06
41	301421	波长光电	3,315	205,939.53	0.06
42	301095	广立微	2,748	205,358.04	0.06
43	688469	芯联集成	40,501	203,315.02	0.06
44	688627	精智达	2,212	196,942.04	0.06
45	301330	熵基科技	5,902	195,356.20	0.06
46	688372	伟测科技	2,479	194,353.60	0.06
47	688549	中巨芯	22,754	190,018.48	0.06
48	301387	光大同创	2,796	189,289.20	0.06
49	301358	湖南裕能	5,495	186,555.25	0.06
50	688048	长光华芯	2,916	182,745.72	0.06
51	301391	卡莱特	1,581	180,992.88	0.06
52	688306	均普智能	32,204	179,376.28	0.06
53	688375	国博电子	2,209	175,681.77	0.05
54	688290	景业智能	3,648	174,264.96	0.05

55	688403	汇成股份	16,368	172,682.40	0.05
56	301381	赛维时代	5,710	172,613.30	0.05
57	301139	元道通信	5,086	171,957.66	0.05
58	688515	裕太微	1,733	171,237.73	0.05
59	688045	必易微	3,861	165,366.63	0.05
60	688371	菲沃泰	9,268	163,209.48	0.05
61	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.05
62	688295	中复神鹰	5,349	162,128.19	0.05
63	301307	美利信	4,668	161,932.92	0.05
64	688410	山外山	5,543	161,855.60	0.05
65	301396	宏景科技	4,752	159,904.80	0.05
66	301165	锐捷网络	4,178	158,304.42	0.05
67	301327	华宝新能	2,042	156,008.80	0.05
68	688652	京仪装备	2,587	153,794.75	0.05
69	301509	金凯生科	2,353	148,353.66	0.05
70	301325	曼恩斯特	1,909	148,023.86	0.05
71	301363	美好医疗	4,002	147,273.60	0.05
72	688591	泰凌微	5,066	146,736.27	0.05
73	301268	铭利达	4,896	146,047.68	0.05
74	301310	鑫宏业	3,002	146,047.30	0.05
75	301195	北路智控	3,525	143,044.50	0.04
76	688576	西山科技	1,482	142,464.66	0.04
77	688610	埃科光电	2,747	142,371.24	0.04
78	301377	鼎泰高科	6,012	142,183.80	0.04
79	301267	华夏眼科	4,365	140,072.85	0.04
80	301507	民生健康	8,509	139,845.35	0.04
81	301366	一博科技	4,100	136,817.00	0.04
82	301317	鑫磊股份	6,936	136,361.76	0.04
83	301498	乖宝宠物	3,392	134,695.52	0.04
84	301303	真兰仪表	6,820	134,285.80	0.04
85	601096	宏盛华源	24,624	134,101.38	0.04
86	603296	华勤技术	1,659	132,182.27	0.04
87	688409	富创精密	1,646	128,898.26	0.04
88	688531	日联科技	1,269	128,270.52	0.04
89	301367	怡和嘉业	1,051	127,959.25	0.04
90	688653	康希通信	6,478	127,078.12	0.04
91	688073	毕得医药	2,279	126,484.50	0.04
92	301398	星源卓镁	2,549	125,640.21	0.04
93	688570	天玛智控	4,610	125,438.10	0.04
94	301248	杰创智能	7,074	124,573.14	0.04
95	301516	中远通	6,033	124,517.13	0.04
96	688152	麒麟信安	1,772	124,164.04	0.04
97	688125	安达智能	3,145	124,070.25	0.04

98	688261	东微半导	1,481	123,796.79	0.04
99	688380	中微半导	5,186	123,737.96	0.04
100	301389	隆扬电子	6,426	122,608.08	0.04
101	301468	博盈特焊	3,913	119,201.53	0.04
102	301413	安培龙	1,633	118,542.96	0.04
103	688631	莱斯信息	3,357	118,334.25	0.04
104	688702	盛科通信	2,332	118,167.22	0.04
105	301223	中荣股份	6,365	115,333.80	0.04
106	301281	科源制药	3,366	114,578.64	0.04
107	301251	威尔高	3,207	114,566.49	0.04
108	688459	哈铁科技	12,225	114,426.00	0.04
109	301511	德福科技	4,906	113,514.82	0.04
110	688426	康为世纪	3,690	112,729.50	0.04
111	688291	金橙子	3,961	112,690.45	0.04
112	301148	嘉戎技术	5,088	112,190.40	0.04
113	301260	格力博	6,439	111,909.82	0.03
114	688102	斯瑞新材	8,442	111,349.98	0.03
115	301568	思泰克	2,456	109,572.88	0.03
116	688507	索辰科技	786	107,485.50	0.03
117	688293	奥浦迈	1,914	105,595.38	0.03
118	301528	多浦乐	1,445	105,528.95	0.03
119	301216	万凯新材	7,416	104,788.08	0.03
120	688132	邦彦技术	4,844	103,806.92	0.03
121	301207	华兰疫苗	3,700	102,860.00	0.03
122	688716	中研股份	2,614	102,438.18	0.03
123	301429	森泰股份	4,989	101,975.16	0.03
124	301261	恒工精密	1,973	101,693.80	0.03
125	301332	德尔玛	8,274	101,108.28	0.03
126	301517	陕西华达	1,841	100,653.05	0.03
127	301200	大族数控	2,627	99,221.79	0.03
128	301335	天元宠物	4,617	98,803.80	0.03
129	688251	井松智能	3,392	98,639.36	0.03
130	301222	浙江恒威	3,315	98,554.95	0.03
131	688720	艾森股份	1,644	97,348.14	0.03
132	301418	协昌科技	1,886	97,069.97	0.03
133	301489	思泉新材	1,278	95,146.08	0.03
134	301459	丰茂股份	2,077	95,083.08	0.03
135	301356	天振股份	5,188	94,369.72	0.03
136	301282	金禄电子	3,766	94,112.34	0.03
137	688489	三未信安	1,968	92,535.36	0.03
138	301578	辰奕智能	1,175	89,662.16	0.03
139	688143	长盈通	2,519	89,046.65	0.03
140	301313	凡拓数创	2,464	88,851.84	0.03

141	301428	世纪恒通	2,289	88,469.85	0.03
142	601061	中信金属	11,403	87,917.13	0.03
143	301345	涛涛车业	1,425	86,782.50	0.03
144	301296	新巨丰	8,415	86,674.50	0.03
145	301258	富士莱	2,684	86,639.52	0.03
146	688137	近岸蛋白	1,553	86,160.44	0.03
147	301525	儒竞科技	1,023	86,019.98	0.03
148	301288	清研环境	4,516	85,713.68	0.03
149	301559	中集环科	4,544	85,417.74	0.03
150	301371	敷尔佳	2,217	84,571.71	0.03
151	688573	信宇人	2,844	84,466.20	0.03
152	688651	盛邦安全	1,778	83,492.90	0.03
153	301316	慧博云通	3,584	83,292.16	0.03
154	301270	汉仪股份	2,095	83,276.25	0.03
155	688061	灿瑞科技	2,071	82,840.00	0.03
156	301439	泓淋电力	5,628	82,281.36	0.03
157	601136	首创证券	4,739	80,373.44	0.03
158	301232	飞沃科技	1,643	79,669.07	0.02
159	688247	宣泰医药	7,155	78,561.90	0.02
160	688648	中邮科技	3,025	78,163.55	0.02
161	301150	中一科技	2,337	77,728.62	0.02
162	301548	崇德科技	1,268	77,195.42	0.02
163	688370	丛麟科技	3,119	77,039.30	0.02
164	301273	瑞晨环保	2,761	76,175.99	0.02
165	301170	锡南科技	2,496	75,953.28	0.02
166	688623	双元科技	1,066	75,664.68	0.02
167	301163	宏德股份	2,764	74,904.40	0.02
168	301279	金道科技	2,956	73,279.24	0.02
169	301322	绿通科技	1,750	72,030.00	0.02
170	301529	福赛科技	1,816	72,009.06	0.02
171	301337	亚华电子	2,318	70,953.98	0.02
172	301505	苏州规划	1,934	70,283.14	0.02
173	688657	浩辰软件	856	70,191.18	0.02
174	301219	腾远钴业	1,778	69,999.86	0.02
175	300804	广康生化	2,257	69,651.02	0.02
176	688275	万润新能	1,103	68,022.01	0.02
177	301319	唯特偶	1,149	67,113.09	0.02
178	301309	万得凯	2,271	63,474.45	0.02
179	601083	锦江航运	5,136	63,418.76	0.02
180	603004	鼎龙科技	1,764	62,652.63	0.02
181	688450	光格科技	1,662	61,217.74	0.02
182	688420	美腾科技	2,339	60,439.76	0.02
183	603270	金帝股份	1,918	58,667.56	0.02

184	688391	钜泉科技	1,170	58,032.00	0.02
185	601065	江盐集团	5,001	57,211.44	0.02
186	001306	夏厦精密	606	54,001.21	0.02
187	001326	联域股份	986	53,715.67	0.02
188	001270	铖昌科技	795	49,854.45	0.02
189	600925	苏能股份	8,960	49,369.60	0.02
190	603119	浙江荣泰	2,005	48,454.67	0.02
191	688267	中触媒	2,321	44,609.62	0.01
192	001239	永达股份	1,887	44,228.22	0.01
193	603275	众辰科技	1,087	43,926.52	0.01
194	603273	天元智能	1,772	43,322.30	0.01
195	603193	润本股份	2,395	43,176.30	0.01
196	001301	尚太科技	1,164	42,625.68	0.01
197	001358	兴欣新材	867	41,281.92	0.01
198	001328	登康口腔	1,445	40,907.95	0.01
199	001269	欧晶科技	764	40,835.80	0.01
200	603075	热威股份	1,592	38,484.24	0.01
201	603373	安邦护卫	876	36,981.40	0.01
202	001314	亿道信息	508	36,540.44	0.01
203	603062	麦加芯彩	582	36,066.91	0.01
204	603276	恒兴新材	1,336	34,970.56	0.01
205	603231	索宝蛋白	1,495	34,863.90	0.01
206	001311	多利科技	649	32,131.99	0.01
207	603281	江瀚新材	1,208	31,758.32	0.01
208	001360	南矿集团	1,762	30,641.18	0.01
209	601089	福元医药	1,749	30,152.76	0.01
210	835179	凯德石英	1,300	29,952.00	0.01
211	001339	智微智能	812	27,916.56	0.01
212	603137	恒尚节能	1,382	27,114.84	0.01
213	001258	立新能源	3,188	25,759.04	0.01
214	001330	博纳影业	3,564	25,660.80	0.01
215	603211	晋拓股份	1,287	24,761.88	0.01
216	001308	康冠科技	867	24,258.66	0.01
217	001367	海森药业	549	24,134.04	0.01
218	301091	深城交	1,021	23,431.95	0.01
219	601022	宁波远洋	1,983	21,991.47	0.01
220	603206	嘉环科技	1,210	21,550.10	0.01
221	03690	美团-W	270	20,039.24	0.01
222	001338	永顺泰	1,649	19,886.94	0.01
223	603132	金徽股份	1,342	18,358.56	0.01
224	603255	鼎际得	489	18,239.70	0.01
225	001376	百通能源	804	17,897.04	0.01
226	601121	宝地矿业	2,532	17,875.92	0.01

227	603191	望变电气	1,149	17,843.97	0.01
228	001322	箭牌家居	1,499	17,778.14	0.01
229	301217	铜冠铜箔	1,485	17,612.10	0.01
230	001323	慕思股份	573	17,476.50	0.01
231	001298	好上好	584	17,414.88	0.01
232	001318	阳光乳业	1,142	16,947.28	0.01
233	001236	弘业期货	1,399	15,640.82	0.00
234	603153	上海建科	740	15,636.20	0.00
235	001300	三柏硕	763	15,473.64	0.00
236	301149	隆华新材	1,214	15,017.18	0.00
237	301117	佳缘科技	262	14,281.62	0.00
238	603097	江苏华辰	577	13,842.23	0.00
239	301179	泽宇智能	531	13,779.45	0.00
240	603190	亚通精工	470	13,761.60	0.00
241	301221	光庭信息	236	13,758.80	0.00
242	603235	天新药业	572	13,750.88	0.00
243	603162	海通发展	774	13,715.28	0.00
244	001319	铭科精技	536	13,705.52	0.00
245	603209	兴通股份	833	13,569.57	0.00
246	603237	五芳斋	455	13,331.50	0.00
247	603173	福斯达	588	13,241.76	0.00
248	603070	万控智造	775	12,446.50	0.00
249	001229	魅视科技	347	12,353.20	0.00
250	301050	雷电微力	211	12,292.86	0.00
251	001278	一彬科技	473	12,260.16	0.00
252	001228	永泰运	383	12,187.06	0.00
253	301089	拓新药业	220	11,882.20	0.00
254	603057	紫燕食品	549	11,847.42	0.00
255	301180	万祥科技	654	11,830.86	0.00
256	603282	亚光股份	457	11,808.88	0.00
257	301188	力诺特玻	647	11,574.83	0.00
258	301093	华兰股份	348	11,240.40	0.00
259	001260	坤泰股份	484	10,681.88	0.00
260	001313	粤海饲料	1,232	10,619.84	0.00
261	603130	云中马	480	10,344.00	0.00
262	001266	宏英智能	346	10,137.80	0.00
263	603215	比依股份	575	9,947.50	0.00
264	603280	南方路机	363	9,706.62	0.00
265	603051	鹿山新材	272	9,446.56	0.00
266	001333	光华股份	426	9,431.64	0.00
267	001331	胜通能源	539	9,410.94	0.00
268	301111	粤万年青	379	9,308.24	0.00
269	603170	宝立食品	542	9,165.22	0.00

270	001238	浙江正特	374	9,114.38	0.00
271	301190	善水科技	477	9,048.69	0.00
272	001299	美能能源	576	8,945.28	0.00
273	301048	金鹰重工	843	8,885.22	0.00
274	001368	通达创智	351	8,806.59	0.00
275	001230	劲旅环境	375	8,797.50	0.00
276	301126	达嘉维康	662	8,625.86	0.00
277	301092	争光股份	323	8,553.04	0.00
278	301138	华研精机	285	8,265.00	0.00
279	603291	联合水务	536	8,141.84	0.00
280	603151	邦基科技	535	8,073.15	0.00
281	603182	嘉华股份	546	8,064.42	0.00
282	603065	宿迁联盛	581	8,006.18	0.00
283	001336	楚环科技	274	7,869.28	0.00
284	301046	能辉科技	290	7,864.80	0.00
285	301118	恒光股份	315	7,695.45	0.00
286	603272	联翔股份	443	7,477.84	0.00
287	301083	百胜智能	416	7,429.76	0.00
288	001231	农心科技	355	7,394.65	0.00
289	301088	戎美股份	485	7,386.55	0.00
290	301182	凯旺科技	294	6,873.72	0.00
291	832419	路斯股份	600	6,834.00	0.00
292	301066	万事利	482	6,208.16	0.00
293	301228	实朴检测	373	6,184.34	0.00
294	301059	金三江	492	5,963.04	0.00
295	301056	森赫股份	572	5,845.84	0.00
296	301196	唯科科技	165	5,672.70	0.00
297	301062	上海艾录	523	5,658.86	0.00
298	301055	张小泉	355	5,119.10	0.00
299	301072	中捷精工	181	4,570.25	0.00
300	300774	倍杰特	444	4,568.76	0.00
301	301036	双乐股份	205	4,544.85	0.00
302	301049	超越科技	196	4,539.36	0.00
303	301068	大地海洋	144	4,377.60	0.00
304	301053	远信工业	155	4,318.30	0.00
305	301057	汇隆新材	218	3,662.40	0.00
306	300854	中兰环保	203	3,542.35	0.00
307	301063	海锅股份	153	3,488.40	0.00
308	301079	邵阳液压	182	3,148.60	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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	601919	中远海控	24,396,154.80	6.50
1	01919	中远海控	10,300,779.20	2.75
2	000651	格力电器	33,984,929.50	9.06
3	000333	美的集团	29,564,907.85	7.88
4	002595	豪迈科技	28,548,649.00	7.61
5	600031	三一重工	20,734,724.00	5.53
6	002484	江海股份	12,134,862.88	3.23
7	600352	浙江龙盛	12,071,395.52	3.22
8	603279	景津装备	2,996,251.00	0.80
9	688249	晶合集成	428,876.70	0.11
10	688469	芯联集成	230,450.69	0.06
11	688343	云天励飞	230,228.64	0.06
12	301310	鑫宏业	201,974.56	0.05
13	688610	埃科光电	201,437.51	0.05
14	688576	西山科技	201,255.60	0.05
15	301260	格力博	198,643.15	0.05
16	688531	日联科技	193,370.22	0.05
17	301468	博盈特焊	186,180.54	0.05
18	688472	阿特斯	186,069.30	0.05
19	301303	真兰仪表	182,776.00	0.05
20	301387	光大同创	163,062.72	0.04

注：1. 本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 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	600941	中国移动	48,157,066.99	12.84
2	601919	中远海控	28,334,521.14	7.55
3	603187	海容冷链	24,579,682.59	6.55
4	603989	艾华集团	22,540,661.60	6.01
5	600031	三一重工	20,743,065.00	5.53
6	000063	中兴通讯	19,480,472.00	5.19
7	000657	中钨高新	15,896,210.24	4.24
8	002372	伟星新材	11,667,280.00	3.11

9	002484	江海股份	7,038,026.07	1.88
10	000651	格力电器	6,581,406.00	1.75
11	603279	景津装备	2,413,754.00	0.64
12	600938	中国海油	1,921,280.05	0.51
13	002749	国光股份	1,277,145.28	0.34
14	688072	拓荆科技	840,128.58	0.22
15	605080	浙江自然	529,176.00	0.14
16	688237	超卓航科	119,352.48	0.03
17	301078	孩子王	8,247.96	0.00

注：1. 本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

2. 对于同时在 A+H 股上市的股票（如有），合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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	184,414,059.79
卖出股票收入（成交）总额	212,127,475.98

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
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）	14,383.71	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,383.71	0.00

#### 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	123215	铭利转债	122	14,383.71	0.00

#### 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

无。

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  
无。

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  
无。

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

本基金投资的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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出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	39,358.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,751.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,109.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
无。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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 (%)
大成睿鑫 股票 A	8,500	32,273.61	13,846,392.58	5.05	260,479,286.10	94.95
大成睿鑫 股票 C	4,172	9,366.13	8,208,457.11	21.01	30,867,028.04	78.99
合计	12,672	24,731.78	22,054,849.69	7.04	291,346,314.14	92.96

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，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）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

### 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	大成睿鑫股票 A	59.94	0.0000
	大成睿鑫股票 C	10.22	0.0000
	合计	70.16	0.0000

注：上述占基金总份额比例的计算中，对分级份额，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）。

### 9.3 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、 基金投资和部门 负责人持有本开放式 基金	大成睿鑫股票 A	0
	大成睿鑫股票 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	大成睿鑫股票 A	0
	大成睿鑫股票 C	0
	合计	0

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	大成睿鑫股票 A	大成睿鑫股票 C
基金合同生效日 (2020年8月11日) 基金份额总额	2,168,218,011.38	161,705,779.50
本报告期期初基金 份额总额	322,088,725.08	34,929,423.76
本报告期基金总申 购份额	48,109,096.78	70,930,599.11
减：本报告期基金总 赎回份额	95,872,143.18	66,784,537.72
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	274,325,678.68	39,075,485.15

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

无。

#### 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

##### 一、基金管理人的重大人事变动

根据我司发布的《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经大成基金管理有限公司第八届董事会第二次会议审议通过并履行必要程序，自2023年3月25日起，温智敏先生因个人原因辞去公司副总经理职务。聘请石国武先生担任公司副总经理，任期自公司八届二次董事会决议作出之日起，至本届董事会任期届满之日止。

##### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付的审计费用为 70,000.00 元整。该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
光大证券	2	239,208,120.12	61.83	219,559.33	61.52	-
招商证券	1	104,467,669.69	27.00	96,922.11	27.16	-
国信证券	1	43,184,339.92	11.16	40,416.68	11.32	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会颁布的《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序。

租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：

- （一）财务状况良好，最近一年无重大违规行为；
- （二）经营行为规范，内控制度健全，能满足各投资组合运作的保密性要求；
- （三）研究实力较强，能提供包括研究报告、路演服务、协助进行上市公司调研等研究服务；
- （四）具备各投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，有足够的交易和清算能力，满足各投资组合证券交易需要；
- （五）能提供投资组合运作、管理所需的其他券商服务；
- （六）相关基金合同、资产管理合同以及法律法规规定的其他条件。

租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金交易单元。

### 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

无。

### 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	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
2	大成基金管理有限公司关于终止和谐保险销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 11 月 29 日
3	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 11 月 22 日
4	大成睿鑫股票型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 10 月 25 日
5	大成睿鑫股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 9 日
6	大成基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 9 月 6 日
7	大成睿鑫股票型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 30 日
8	大成睿鑫股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 8 月 26 日

9	大成睿鑫股票型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年8月26日
10	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年8月22日
11	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西部证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年8月15日
12	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月25日
13	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月21日
14	大成睿鑫股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月20日
15	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月13日
16	大成睿鑫股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
17	大成睿鑫股票型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
18	大成睿鑫股票型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
19	大成睿鑫股票型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
20	大成睿鑫股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
21	大成基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年7月8日
22	关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023年6月30日
23	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2023年5月16日

	公司为销售机构的公告	公司网站	
24	大成基金管理有限公司提醒投资者谨防金融诈骗的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
25	大成睿鑫股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
26	大成睿鑫股票型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 30 日
27	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
28	大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 27 日
29	大成基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下基金费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 24 日
30	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 10 日
31	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 2 月 23 日
32	大成睿鑫股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 18 日
33	大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 16 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立大成睿鑫股票型证券投资基金的文件；
- 2、《大成睿鑫股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成睿鑫股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程；
- 5、本报告期内在规定报刊上披露的各种公告原稿。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，或登录本基金管理人网站 <http://www.dcfund.com.cn> 进行查阅。

大成基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日