

# 国都聚成混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：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及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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料经审计，信永中和会计师事务所（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 1 月 1 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<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.....	20
7.3 净资产变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63

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 .....	63
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 .....	63
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 .....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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的情况 .....	66
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 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</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 .....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	74

## § 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	50,985,819.80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	福建省福州市台江区江滨中大

	街 3 号国华投资大厦 9、10 层	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.guodu.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 9 层
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、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 3 月 25 日 (基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-7,448,113.10	-14,607,628.54	-13,490,039.48
本期利润	-7,429,754.99	-16,658,272.56	-11,538,826.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1389	-0.2630	-0.1036
本期加权平均净值利润率	-25.12%	-37.20%	-10.92%
本期基金份额净值增长率	-23.47%	-29.43%	-13.07%
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	-27,414,224.11	-22,636,412.12	-11,536,349.72
期末可供分配基金份额利润	-0.5377	-0.3956	-0.1663
期末基金资产净值	23,939,785.66	35,101,446.74	60,292,546.62
期末基金份额净值	0.4695	0.6135	0.8693
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	-53.05%	-38.65%	-13.07%

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。

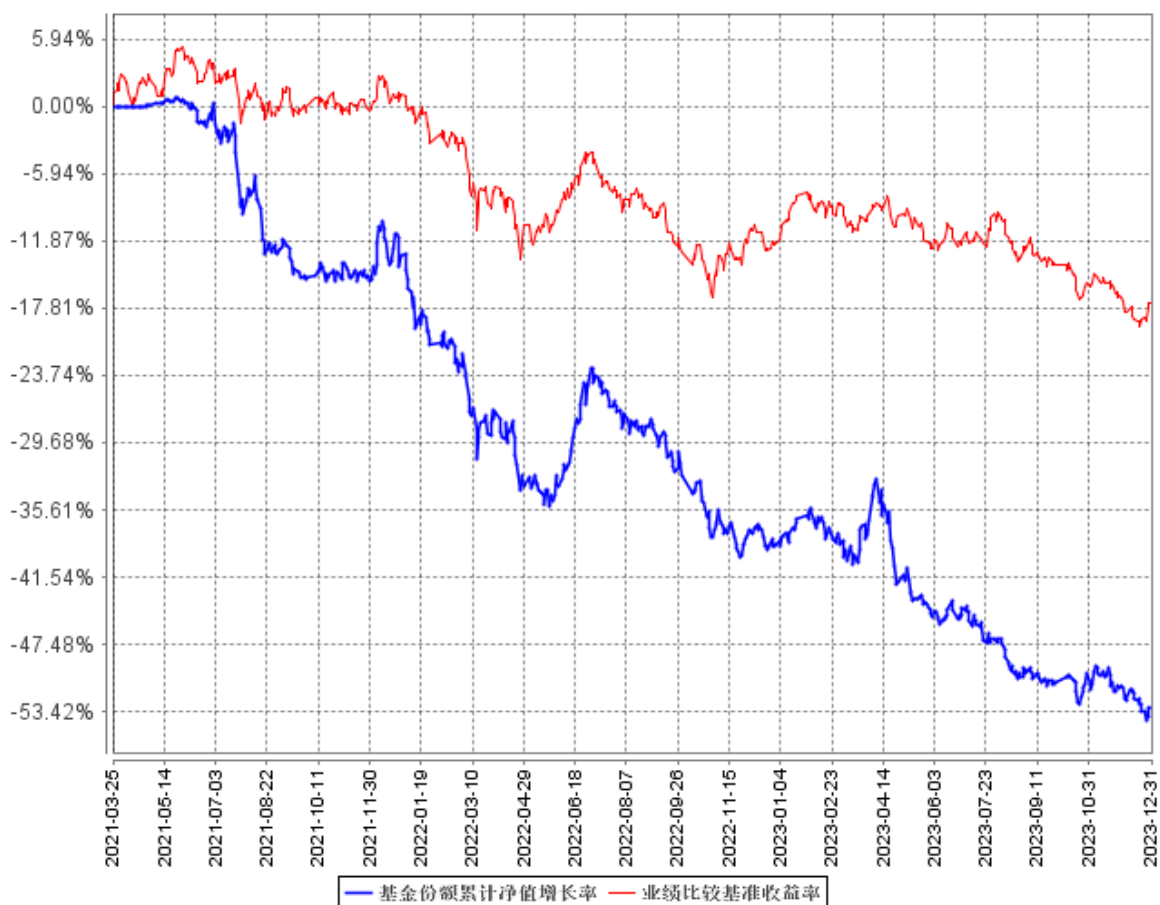
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	-4.57%	0.97%	-3.91%	0.48%	-0.66%	0.49%
过去六个月	-15.83%	0.85%	-6.16%	0.51%	-9.67%	0.34%
过去一年	-23.47%	1.02%	-6.03%	0.51%	-17.44%	0.51%
自基金合同生效起至今	-53.05%	0.97%	-17.32%	0.64%	-35.73%	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

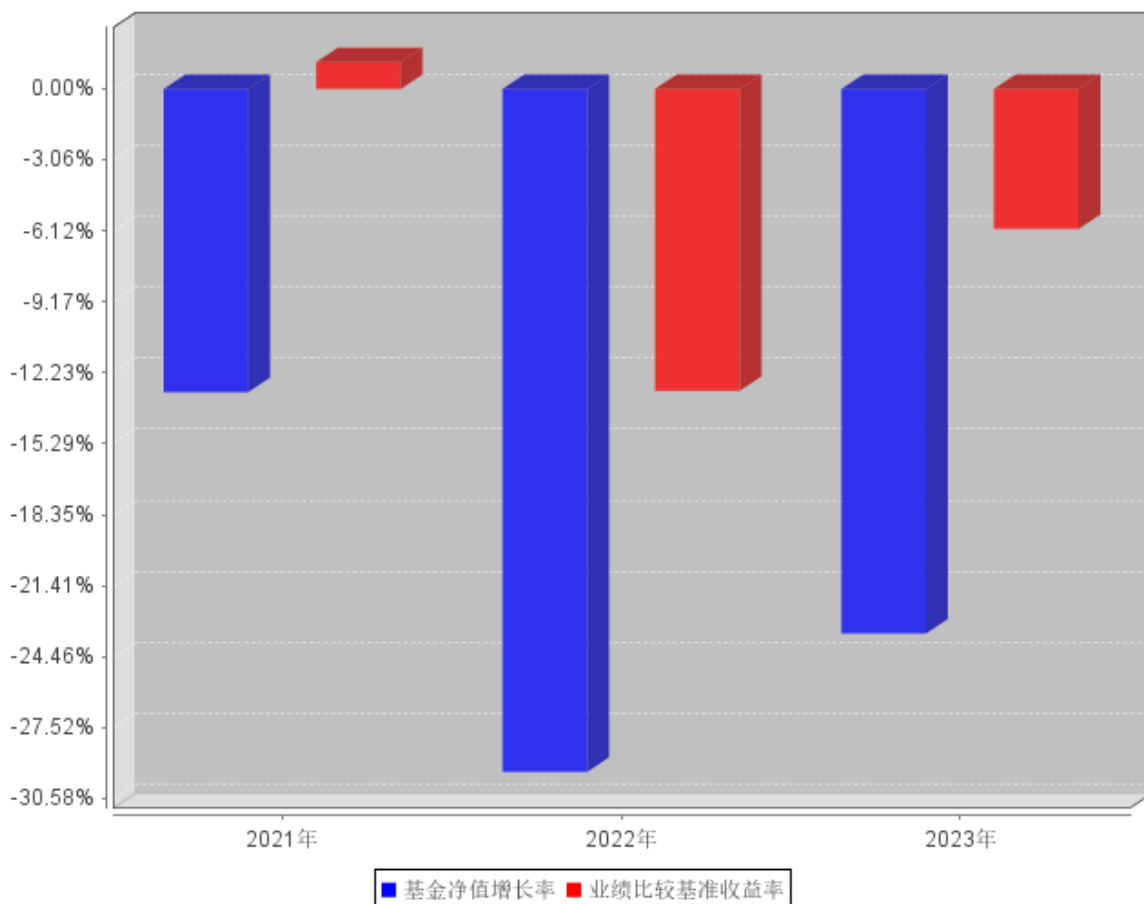
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 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

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对比图



### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自 2021 年 3 月 25 日起生效，基金合同生效以来未发生利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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 12 月 31 日，本公司管理 2 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	-	22 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	-	9 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

### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司制定了完备的薪酬制度，能够有效履行对基金经理的各项薪酬管理工作，亦符合监管要求。

## 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国都证券股份有限公司公募证券投资基金业务公平交易管理办法》。通过制定科学合理的投资决策体系、交易执行规范及对公平交易的监控与报告、相关信息披露等手段，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 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

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

2023 年是 A 股市场表现相对震荡的一年，市场情绪发生了较大转折。纵观全年，A 股大部分宽基指数表现较弱。其中上证指数下跌 3.70%，深证成指下跌 13.54%，创业板指下跌 19.41%，沪深 300 指数下跌 11.38%。市场风格方面，除红利指数及部分小盘风格指数外，其他宽基指数大多创下近年来的新低。究其原因，尽管中国经济呈现稳步复苏和较强韧性局面，但仍面临着一些较为复杂的因素和挑战。

一是疫情期间积压的需求在一季度释放后增速转弱，疫情后消费未出现市场预期的大比例增长，新消费动力尚未形成。

二是由于年内部分大型房企债务危机显性化，房企债务风险持续暴露，加大了投资者对市场的担忧。

三是海外受疫情和地缘政治的影响，部分国内企业和外资企业将生产线和供应链从我国迁往其他生产成本更为低廉的国家和地区，同时多数发达国家继续推动本国产业链的多元化和自主化以提高应对危机的能力，在格局尚未稳定前不可避免地对我国制造业带来冲击。

四是在新周期下，中国经济中性增长水平低于国际投资人的预期。叠加前述一些因素，海外机构在三季度看空中国市场，冲击了国内外投资者对中国权益资产的信心，无论 A 股、H 股还是海外中概股在 2023 年下半年普遍表现不佳。

此外，美联储加息周期助推了人民币贬值及资本流出趋势，A 股市场减量博弈贯穿始终，全年投资运作的难度较大。

在 2023 年年初，本产品对科技产业的发展态势抱有较大预期，主要配置了一部分科技相关标的，取得了阶段性的收益成果。然而从年中开始市场进入下降通道，高波动的科技板块标的在此阶段对净值产生了较大负作用，在下半年本产品开始逐步用高分红和稳定收益为特征的标的加以替换，并加大高股息标的占比。但在宽基指数普遍下跌的情况下，本产品依然出现了较大回撤的情况。

### 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 0.4695 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.47%，业绩比较基准收益率为-6.03%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

### 1、经济环境面临的挑战

全球经济环境的不确定性可能会影响中国的经济发展。一是全球供应链重构与修复仍未完全

定型，叠加乌俄、巴以冲突在内的一系列地缘政治风险，全球经济增长态势不明朗；二是各发达国家人口老龄化突出影响潜在增长率；三是欧美央行持续加息对经济的抑制作用将在 2024 年逐步显现化，对货币政策是否重回宽松持谨慎态度，甚至可能反复，拖累经济增长步伐，造成金融市场异常波动；四是全球处于新旧增长动能加速切换过程中，尽管充满机遇，但同时面临产业链的剧烈动荡。诸多因素都可能对中国的出口和投资产生负面影响。

随着中国经济的发展和人口结构的变化，产业结构调整存在必要性和紧迫性。在房地产等传统产业暂时对经济增长贡献减速的情况下，如何实现产业结构的顺利调整和升级，以及培育新的经济增长点，实现新旧增长动能的转换，将是 2024 年中国经济面临的重要挑战之一。

## 2、宏观经济面临的机遇

一是外贸出口形势存在一定程度的改善预期。以美国为首的西方经济体库存周期已经触底，2024 年有望进入补库周期，带动我国出口边际改善；同时改善国内部分生产企业的下游需求，缓解供需压力。

二是消费复苏和出口增长将带动我国经济重回正轨。公开数据显示，2023 年居民消费倾向呈逐季抬升，居民消费意愿也在逐步修复。展望 2024 年，随着就业优先政策进一步强化和收入分配制度改革加快，就业形势持续好转、居民收入稳步提升，预计 2024 年居民消费复苏将成为宏观经济修复的主要支撑因素。

三是经济结构正在悄然优化，经济增长的新动能在持续集聚。预计 2024 年数字经济和低碳经济将继续释放正面效应，人工智能技术在各个行业得到广泛应用。随着全球对气候变化的关注不断增加，预计 2024 年绿色产业将继续在中国经济中扮演重要的角色。

四是房地产下行边际收窄。2023 年陆续推出的房地产支持政策将在 2024 年逐步显效，房企的现金流逐步修复，融资能力有所改善。尽管压力犹在，但对经济的拖累边际收窄，对宏观经济的掣肘作用减小。

五则来源于资本市场本身。当前 A 股权益资产性价比已达到近年来的高点，为 A 股市场历史上的低估区间，尤其是高分红的红利价值标的已经回归到一个相对性价比很高的位置。展望 2024 年，A 股市场投资机会预计将优于过去的一年。

展望 2024 年，在消费复苏、出口改善、经济新动能不断涌现、房地产边际修复的情况下，我国经济发展仍具韧性，预计 2024 年我国宏观经济有望得到进一步修复。随着 A 股权益资产性价比的进一步提升，2024 年 A 股市场将有望在悲观情绪进一步释放之后，进入上升通道，并且伴随着宏观经济数据的改善，投资机会显著放大。

#### 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，公司坚持保障基金份额持有人利益的原则，加强制度建设，不断完善内部控制体系；强化合规与风险管理，加强监察稽核工作；加强合规文化建设，培育合规文化体系。具体包括以下方面：

(1) 加强制度建设，不断完善内部控制体系。公司根据法律法规等规范性文件，制定了较为完备的内部管理制度。本报告期内，公司根据业务需要或监管要求制定或修订了部分内部管理制度，涉及公司合规与风险管理、人力资源、投资者适当性、反洗钱、信息技术等方面。

(2) 强化合规与风险管理，加强监察稽核工作。公司对异常交易、关联交易、基金投资范围、投资比例等进行事前系统限制或监控；合规部门对公司基金业务的法律文件等进行事前审核；公司建立了投资行为管理系统，规范董事、监事及从业人员本人、配偶及利害关系人的投资行为，防范内幕交易、市场操纵、利益冲突和利益输送等不当行为。公司重视监察稽核工作，不断提高和完善监察稽核工作，对投资、销售、后台运营等重要业务环节进行核查，保障基金运作所涉及的各个环节能够按照法律法规、基金合同和公司制度执行。

(3) 加强合规文化建设，培育合规文化体系。公司积极推动合规文化建设，培育合规文化体系，防控重大合规风险。

本报告期内，基金运作合法合规，未发生重大风险事件。

#### 4.7 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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**

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	XYZH/2024BJAB2B0025

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国都聚成混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了国都聚成混合型证券投资基金（以下简称聚成基金）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。</p> <p>我们认为，后附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，公允反映了聚成基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于聚成基金，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。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估聚成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，除非管理层计划清算聚成基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督聚成基金的财务报告过程。</p>
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</p>

	<p>表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价管理人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。</p> <p>（4）对管理人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，就可能导致对聚成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聚成基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、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。</p> <p>我们与治理层就聚成基金的审计范围、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	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	颜凡清   齐晓瑞
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 A 座 9 层
审计报告日期	2024 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	4,271,107.19	7,238,638.10
结算备付金		191,548.02	209,933.65
存出保证金		35,639.48	26,852.84
交易性金融资产	7.4.7.2	19,465,140.00	28,520,066.00
其中：股票投资		19,465,140.00	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	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		135,397.63	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		24,098,832.32	35,995,490.59
<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		78,490.57	708,515.34
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		25,001.45	45,380.70
应付托管费		2,083.46	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	7.4.7.9	53,471.18	137,122.41
负债合计		159,046.66	894,043.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	50,985,819.80	57,215,197.33
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-27,046,034.14	-22,113,750.59
净资产合计		23,939,785.66	35,101,446.74
负债和净资产总计		24,098,832.32	35,995,490.59

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4695 元，基金份额总额 50,985,819.80 份。

## 7.2 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 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>		-6,963,661.90	-15,807,719.65
1. 利息收入		28,350.70	55,797.34
其中：存款利息收入	7.4.7.13	28,350.70	35,736.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	20,060.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,010,988.58	-13,816,937.82
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,188,088.50	-14,211,487.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	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	177,099.92	394,549.57
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）	7.4.7.20	18,358.11	-2,050,644.02
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	617.87	4,064.85
<b>减：二、营业总支出</b>		466,093.09	850,552.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	416,105.05	675,197.50
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,693.04	45,013.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	72.23
8. 其他费用	7.4.7.23	20,295.00	130,270.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,429,754.99	-16,658,272.56
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,429,754.99	-16,658,272.56
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-7,429,754.99	-16,658,272.56

### 7.3 净资产变动表

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	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	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）	-6,229,377.53	-	-4,932,283.55	-11,161,661.08
（一）、综合收益总额	-	-	-7,429,754.99	-7,429,754.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,229,377.53	-	2,497,471.44	-3,731,906.09
其中：1.基金申购款	1,396,681.42	-	-624,937.54	771,743.88
2.基金赎回款	-7,626,058.95	-	3,122,408.98	-4,503,649.97
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,985,819.80	-	-27,046,034.14	23,939,785.66
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	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	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）	-12,144,805.48	-	-13,046,294.40	-25,191,099.88
（一）、综合收	-	-	-16,658,272.56	-16,658,272.56

益总额				
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-12,144,805.48	-	3,611,978.16	-8,532,827.32
其中: 1.基金申购款	279,142.87	-	-80,455.29	198,687.58
2.基金赎回款	-12,423,948.35	-	3,692,433.45	-8,731,514.90
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	57,215,197.33	-	-22,113,750.59	35,101,446.74

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:

\_\_\_\_\_  
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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础，按照财政部颁布的《企业会计准则》、应用指南、解释及其他相关规定并参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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>》等相关法规规定进行确认和计量，基于下述主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度的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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

##### 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。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常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，在初始确认时将



金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变

动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，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；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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据中国证券投资基金业协会发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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[2023]39号文《财政部、国家税务总局关于减半征收证券交易印花税的公告》、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) 本基金卖出股票原按照 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。《财政部-税务总局关于减半征收证券交易印花税的公告》（2023 年第 39 号）自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

## 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	4,271,107.19	7,238,638.10
等于：本金	4,270,611.69	7,237,809.31
加：应计利息	495.50	828.79
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：	4,271,107.19	7,238,638.10

## 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	19,546,212.90	-	19,465,140.00	-81,072.90
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	19,546,212.90	-	19,465,140.00	-81,072.90
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	28,619,497.01	-	28,520,066.00	-99,431.01
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	28,619,497.01	-	28,520,066.00	-99,431.01

## 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有股指期货。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有黄金衍生品。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权资产。

##### 7.4.7.5.2 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情况。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权。

##### 7.4.7.6.2 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情况。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资情况。

#### 7.4.7.8 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。

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	38,471.18	42,122.41

其中：交易所市场	38,471.18	42,122.41
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	15,000.00	95,000.00
合计	53,471.18	137,122.41

#### 7.4.7.10 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12月31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	1,396,681.42	1,396,681.42
本期赎回（以“-”号填列）	-7,626,058.95	-7,626,058.95
- 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	50,985,819.80	50,985,819.80

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 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
上年度末	-22,636,412.12	522,661.53	-22,113,750.59
加：会计政策变更 （若有）	-	-	-
前期差错更正 （若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-22,636,412.12	522,661.53	-22,113,750.59
本期利润	-7,448,113.10	18,358.11	-7,429,754.99
本期基金份额交易 产生的变动数	2,670,301.11	-172,829.67	2,497,471.44
其中：基金申购款	-650,356.31	25,418.77	-624,937.54
基金赎回款	3,320,657.42	-198,248.44	3,122,408.98
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-27,414,224.11	368,189.97	-27,046,034.14
-----	----------------	------------	----------------

#### 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	23,917.36	32,116.39
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	3,796.36	3,066.69
其他	636.98	553.90
合计	28,350.70	35,736.98

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出股票成交总额	356,593,690.34	186,139,478.03
减：卖出股票成本总额	362,762,229.57	199,799,303.72
减：交易费用	1,019,549.27	551,661.70
买卖股票差价收入	-7,188,088.50	-14,211,487.39

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

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
股票投资产生的股利收益	177,099.92	394,549.57
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	177,099.92	394,549.57

#### 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	18,358.11	-2,050,644.02
——股票投资	18,358.11	-2,050,644.02
——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	18,358.11	-2,050,644.02

#### 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	617.87	3,959.17
基金转换收入	-	105.68
合计	617.87	4,064.85

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
审计费用	15,000.00	15,000.00
信息披露费	-30,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	295.00	270.00
持有人大会费用	10,000.00	10,000.00
律师费用	25,000.00	25,000.00
合计	20,295.00	130,270.00

### 7.4.7.24 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。

## 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

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间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。

### 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
国都证券股 份有限公司	710,282,635.80	100.00%	365,515,379.77	100.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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
国都证券股 份有限公司	657,256.21	100.00%	38,471.18	100.00%
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
国都证券股 份有限公司	336,396.66	100.00%	42,122.41	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。

## 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	416,105.05	675,197.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	995.54	933.51
应支付基金管理人的净管理费	415,109.51	674,263.99

注：1、管理费的计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

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

I 为基金管理费率

2023 年 8 月 11 日，本基金管理人国都证券股份有限公司发布公告《国都证券股份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》，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金管理费年费率由 1.5% 下调至 1.2%。

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。

### 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	29,693.04	45,013.18

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

#### 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

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

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.3 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

兴业银行	4,270,611.69	23,917.36	7,237,809.31	32,116.39
------	--------------	-----------	--------------	-----------

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。

#### 7.4.10.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 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无需作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

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。

##### 7.4.12.2 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。

##### 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

本基金本报告期末未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 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。

#### 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 and 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配合其开展工作。风险管理部牵头负责公司声誉风险管理工作，与董事会办公室、综合管理部、人力资源部、合规法律部等部门按部门职责分工开展相关工作。

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。

#### **7.4.13.2 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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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》。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 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	4,270,611.69	-	-	-	-	495.50	4,271,107.19
结算备付金	191,453.31	-	-	-	-	94.71	191,548.02
存出保证金	35,621.77	-	-	-	-	17.71	35,639.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,465,140.00	19,465,140.00
应收清算款	-	-	-	-	-	135,397.63	135,397.63
资产总计	4,497,686.77	-	-	-	-	19,601,145.55	24,098,832.32
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	78,490.57	78,490.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,001.45	25,001.45
应付托管费	-	-	-	-	-	2,083.46	2,083.46
其他负债	-	-	-	-	-	53,471.18	53,471.18
负债总计	-	-	-	-	-	159,046.66	159,046.66
利率敏感度缺口	4,497,686.77	-	-	-	-	19,442,098.89	23,939,785.66
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							
应付证券清算款						708,515.34	708,515.34
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						137,122.41	137,122.41
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 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	19,465,140.00	81.31	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	19,465,140.00	81.31	28,520,066.00	81.25

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-752,642.35	-1,528,093.12
	沪深 300 指数上涨 5%	752,642.35	1,528,093.12

#### 7.4.13.4.4 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 347940.97 元，占基金资产净值比例为 1.45%。

#### 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。

##### 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	19,465,140.00	28,520,066.00
第二层次	-	-

第三层次	-	-
合计	19,465,140.00	28,520,066.00

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无第三层次公允价值计量的金融工具。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末无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。

#### 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

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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 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。

## § 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	19,465,140.00	80.77
	其中：股票	19,465,140.00	80.77
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	4,462,655.21	18.52
8	其他各项资产	171,037.11	0.71
9	合计	24,098,832.32	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。

### 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,368,670.00	5.72
C	制造业	12,888,990.00	53.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	1,040,400.00	4.35
J	金融业	1,806,500.00	7.55
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	638,700.00	2.67

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	599,880.00	2.51
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,122,000.00	4.69
S	综合	-	-
	合计	19,465,140.00	81.31

注：以上行业分类以 2023 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 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。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	688017	绿的谐波	8,000	1,228,000.00	5.13
2	601398	工商银行	200,000	956,000.00	3.99
3	601088	中国神华	25,000	783,750.00	3.27
4	600845	宝信软件	15,000	732,000.00	3.06
5	601288	农业银行	180,000	655,200.00	2.74
6	603200	上海洗霸	30,000	638,700.00	2.67
7	000526	学大教育	12,000	599,880.00	2.51
8	002019	亿帆医药	40,000	591,200.00	2.47
9	600150	中国船舶	20,000	588,800.00	2.46
10	601225	陕西煤业	28,000	584,920.00	2.44
11	300788	中信出版	20,000	582,000.00	2.43
12	603662	柯力传感	16,000	575,840.00	2.41
13	688213	思特威	10,000	555,600.00	2.32
14	002773	康弘药业	30,000	553,200.00	2.31
15	600519	贵州茅台	300	517,800.00	2.16
16	300580	贝斯特	17,000	514,760.00	2.15
17	603283	赛腾股份	7,000	507,920.00	2.12
18	300442	润泽科技	20,000	507,400.00	2.12
19	688097	博众精工	15,000	504,000.00	2.11
20	688041	海光信息	7,000	496,860.00	2.08
21	300354	东华测试	10,000	496,700.00	2.07
22	688255	凯尔达	20,000	489,000.00	2.04
23	301311	昆船智能	20,000	486,000.00	2.03
24	688192	迪哲医药	10,000	478,500.00	2.00
25	300832	新产业	6,000	469,200.00	1.96

26	002444	巨星科技	20,000	450,400.00	1.88
27	603297	永新光学	4,000	397,400.00	1.66
28	300606	金太阳	10,000	341,600.00	1.43
29	300654	世纪天鸿	30,000	338,400.00	1.41
30	002803	吉宏股份	15,000	308,400.00	1.29
31	300729	乐歌股份	17,000	304,470.00	1.27
32	688278	特宝生物	5,000	261,750.00	1.09
33	002903	宇环数控	10,000	255,500.00	1.07
34	002896	中大力德	7,000	254,450.00	1.06
35	300576	容大感光	6,000	235,560.00	0.98
36	688286	敏芯股份	3,000	215,100.00	0.90
37	300413	芒果超媒	8,000	201,600.00	0.84
38	601939	建设银行	30,000	195,300.00	0.82
39	688071	华依科技	4,000	194,840.00	0.81
40	003021	兆威机电	2,000	187,980.00	0.79
41	301067	显盈科技	5,000	168,050.00	0.70
42	300122	智飞生物	1,000	61,110.00	0.26

## 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	601398	工商银行	6,173,400.00	17.59
2	601288	农业银行	4,575,800.00	13.04
3	002568	百润股份	4,324,057.20	12.32
4	002230	科大讯飞	4,209,796.03	11.99
5	601939	建设银行	4,031,600.00	11.49
6	000063	中兴通讯	3,826,121.00	10.90
7	688111	金山办公	3,065,856.00	8.73
8	300308	中际旭创	2,979,172.00	8.49
9	300122	智飞生物	2,913,934.00	8.30
10	000625	长安汽车	2,855,265.00	8.13
11	688525	佰维存储	2,663,732.60	7.59
12	002865	钧达股份	2,455,249.00	6.99
13	603986	兆易创新	2,441,474.00	6.96
14	300570	太辰光	2,419,716.00	6.89

15	300548	博创科技	2,205,516.00	6.28
16	300580	贝斯特	2,197,293.00	6.26
17	600150	中国船舶	2,160,844.00	6.16
18	601088	中国神华	2,123,200.00	6.05
19	601689	拓普集团	2,077,471.00	5.92
20	601186	中国铁建	2,006,000.00	5.71
21	600050	中国联通	1,994,000.00	5.68
22	301018	申菱环境	1,953,301.60	5.56
23	300763	锦浪科技	1,875,680.00	5.34
24	301039	中集车辆	1,874,533.00	5.34
25	601988	中国银行	1,874,000.00	5.34
26	300613	富瀚微	1,855,550.00	5.29
27	002101	广东鸿图	1,823,312.00	5.19
28	000807	云铝股份	1,808,200.00	5.15
29	603985	恒润股份	1,802,289.59	5.13
30	601127	赛力斯	1,755,807.00	5.00
31	002603	以岭药业	1,734,560.00	4.94
32	688766	普冉股份	1,681,203.64	4.79
33	688981	中芯国际	1,674,326.47	4.77
34	688700	东威科技	1,667,068.00	4.75
35	002371	北方华创	1,665,933.00	4.75
36	300638	广和通	1,665,047.00	4.74
37	688041	海光信息	1,663,113.78	4.74
38	603019	中科曙光	1,643,370.00	4.68
39	600845	宝信软件	1,638,014.00	4.67
40	688268	华特气体	1,627,480.28	4.64
41	002409	雅克科技	1,624,404.00	4.63
42	002410	广联达	1,615,820.00	4.60
43	300476	胜宏科技	1,608,920.00	4.58
44	601633	长城汽车	1,606,071.00	4.58
45	601728	中国电信	1,595,900.00	4.55
46	603348	文灿股份	1,576,242.00	4.49
47	688138	清溢光电	1,560,252.40	4.44
48	688122	西部超导	1,556,650.96	4.43
49	688385	复旦微电	1,543,205.29	4.40
50	600732	爱旭股份	1,532,941.00	4.37

51	300037	新宙邦	1,532,031.00	4.36
52	002997	瑞鹄模具	1,531,626.00	4.36
53	300442	润泽科技	1,519,764.90	4.33
54	002821	凯莱英	1,468,962.00	4.18
55	002747	埃斯顿	1,462,704.00	4.17
56	688017	绿的谐波	1,458,190.93	4.15
57	002955	鸿合科技	1,449,081.00	4.13
58	600522	中天科技	1,440,065.00	4.10
59	002654	万润科技	1,435,363.00	4.09
60	002594	比亚迪	1,420,202.00	4.05
61	600009	上海机场	1,408,950.00	4.01
62	300684	中石科技	1,399,308.00	3.99
63	002463	沪电股份	1,388,700.00	3.96
64	300456	赛微电子	1,384,516.79	3.94
65	600362	江西铜业	1,374,235.00	3.92
66	688559	海目星	1,361,262.96	3.88
67	300727	润禾材料	1,339,376.00	3.82
68	300413	芒果超媒	1,338,566.00	3.81
69	601066	中信建投	1,326,227.00	3.78
70	600377	宁沪高速	1,306,901.00	3.72
71	600809	山西汾酒	1,295,410.00	3.69
72	002126	银轮股份	1,294,499.00	3.69
73	600584	长电科技	1,288,009.00	3.67
74	600030	中信证券	1,281,010.00	3.65
75	688568	中科星图	1,273,531.78	3.63
76	000526	学大教育	1,263,995.00	3.60
77	600703	三安光电	1,262,017.00	3.60
78	601985	中国核电	1,259,100.00	3.59
79	300502	新易盛	1,255,808.00	3.58
80	600363	联创光电	1,254,922.00	3.58
81	600460	士兰微	1,246,715.00	3.55
82	002599	盛通股份	1,207,824.00	3.44
83	002415	海康威视	1,205,152.00	3.43
84	600941	中国移动	1,199,155.00	3.42
85	300136	信维通信	1,182,709.00	3.37
86	300782	卓胜微	1,179,398.40	3.36

87	600089	特变电工	1,179,228.00	3.36
88	300623	捷捷微电	1,174,720.00	3.35
89	601006	大秦铁路	1,171,700.00	3.34
90	300480	光力科技	1,161,309.00	3.31
91	300788	中信出版	1,156,700.00	3.30
92	002261	拓维信息	1,153,971.00	3.29
93	688106	金宏气体	1,141,361.56	3.25
94	603629	利通电子	1,139,873.00	3.25
95	603383	顶点软件	1,137,351.00	3.24
96	688707	振华新材	1,134,161.38	3.23
97	300474	景嘉微	1,115,857.00	3.18
98	688278	特宝生物	1,115,138.00	3.18
99	600276	恒瑞医药	1,110,827.00	3.16
100	002373	千方科技	1,089,700.00	3.10
101	300595	欧普康视	1,085,082.00	3.09
102	300576	容大感光	1,083,205.00	3.09
103	688036	传音控股	1,082,120.00	3.08
104	002992	宝明科技	1,081,243.80	3.08
105	000810	创维数字	1,079,850.00	3.08
106	300671	富满微	1,079,690.00	3.08
107	688012	中微公司	1,041,836.99	2.97
108	603800	道森股份	1,034,169.00	2.95
109	000988	华工科技	1,031,410.00	2.94
110	300748	金力永磁	1,030,150.00	2.93
111	601020	华钰矿业	1,021,115.00	2.91
112	600188	兖矿能源	1,017,622.00	2.90
113	603650	彤程新材	1,012,200.00	2.88
114	688200	华峰测控	1,010,160.00	2.88
115	300666	江丰电子	1,007,985.00	2.87
116	603169	兰石重装	1,006,891.00	2.87
117	601899	紫金矿业	998,400.00	2.84
118	603083	剑桥科技	995,282.00	2.84
119	688071	华依科技	995,160.00	2.84
120	000970	中科三环	992,255.00	2.83
121	002837	英维克	975,606.00	2.78
122	300729	乐歌股份	960,508.00	2.74



123	300811	铂科新材	943,049.00	2.69
124	688608	恒玄科技	936,266.00	2.67
125	002334	英威腾	931,200.00	2.65
126	000568	泸州老窖	929,800.00	2.65
127	002472	双环传动	927,910.00	2.64
128	000538	云南白药	924,611.00	2.63
129	603915	国茂股份	920,215.00	2.62
130	000786	北新建材	915,026.00	2.61
131	600552	凯盛科技	912,782.00	2.60
132	002906	华阳集团	910,688.00	2.59
133	601600	中国铝业	904,885.00	2.58
134	002601	龙佰集团	899,544.00	2.56
135	002709	天赐材料	899,390.00	2.56
136	603003	龙宇股份	894,425.00	2.55
137	688578	艾力斯	891,917.01	2.54
138	600519	贵州茅台	890,680.00	2.54
139	000858	五粮液	885,556.00	2.52
140	002487	大金重工	874,900.00	2.49
141	300606	金太阳	870,488.00	2.48
142	603283	赛腾股份	870,445.00	2.48
143	605358	立昂微	861,815.00	2.46
144	688260	昀冢科技	861,708.90	2.45
145	603093	南华期货	842,409.00	2.40
146	002352	顺丰控股	832,410.00	2.37
147	002284	亚太股份	823,859.00	2.35
148	688188	柏楚电子	817,910.00	2.33
149	601688	华泰证券	813,879.00	2.32
150	300602	飞荣达	813,781.00	2.32
151	002154	报喜鸟	811,123.00	2.31
152	300475	香农芯创	808,808.00	2.30
153	002555	三七互娱	807,384.00	2.30
154	688019	安集科技	790,958.00	2.25
155	603667	五洲新春	790,910.00	2.25
156	002803	吉宏股份	790,138.00	2.25
157	002338	奥普光电	787,163.00	2.24
158	300765	新诺威	786,550.00	2.24

159	300916	朗特智能	779,820.00	2.22
160	603200	上海洗霸	779,191.00	2.22
161	300863	卡倍亿	778,897.00	2.22
162	601607	上海医药	771,780.00	2.20
163	688128	中国电研	755,587.00	2.15
164	688313	仕佳光子	755,370.00	2.15
165	002896	中大力德	755,325.00	2.15
166	688777	中控技术	751,102.44	2.14
167	002222	福晶科技	744,409.00	2.12
168	688636	智明达	739,580.00	2.11
169	603322	超讯通信	737,388.00	2.10
170	002156	通富微电	735,406.00	2.10
171	601117	中国化学	732,500.00	2.09
172	002885	京泉华	719,863.00	2.05
173	000516	国际医学	718,800.00	2.05
174	002129	TCL 中环	718,206.00	2.05
175	600839	四川长虹	716,593.00	2.04
176	301052	果麦文化	711,090.00	2.03
177	002351	漫步者	711,010.00	2.03
178	002917	金奥博	708,400.00	2.02
179	603596	伯特利	703,950.00	2.01

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601398	工商银行	5,293,200.00	15.08
2	002568	百润股份	5,028,668.00	14.33
3	002230	科大讯飞	4,243,902.00	12.09
4	000063	中兴通讯	3,988,121.00	11.36
5	601288	农业银行	3,987,600.00	11.36
6	601939	建设银行	3,903,000.00	11.12
7	300308	中际旭创	3,695,705.00	10.53
8	688111	金山办公	3,379,493.15	9.63
9	000625	长安汽车	2,970,347.00	8.46

10	688525	佰维存储	2,947,003.20	8.40
11	002594	比亚迪	2,906,549.00	8.28
12	300122	智飞生物	2,899,131.00	8.26
13	002410	广联达	2,571,364.00	7.33
14	600009	上海机场	2,489,534.10	7.09
15	300548	博创科技	2,435,558.00	6.94
16	603986	兆易创新	2,362,939.00	6.73
17	002865	钧达股份	2,268,369.00	6.46
18	300570	太辰光	2,267,989.00	6.46
19	002415	海康威视	2,253,150.00	6.42
20	601689	拓普集团	2,050,582.00	5.84
21	601988	中国银行	2,048,000.00	5.83
22	000858	五粮液	1,985,692.00	5.66
23	000970	中科三环	1,956,611.00	5.57
24	603027	千禾味业	1,942,877.00	5.54
25	601186	中国铁建	1,941,400.00	5.53
26	300613	富瀚微	1,931,306.00	5.50
27	600050	中国联通	1,925,811.00	5.49
28	301018	申菱环境	1,925,188.00	5.48
29	603985	恒润股份	1,858,130.65	5.29
30	301039	中集车辆	1,778,081.00	5.07
31	600519	贵州茅台	1,762,600.00	5.02
32	601899	紫金矿业	1,733,034.00	4.94
33	300763	锦浪科技	1,724,879.00	4.91
34	002603	以岭药业	1,704,526.00	4.86
35	000807	云铝股份	1,704,354.00	4.86
36	300638	广和通	1,701,553.00	4.85
37	300580	贝斯特	1,694,739.56	4.83
38	601127	赛力斯	1,687,068.32	4.81
39	002101	广东鸿图	1,681,011.00	4.79
40	600760	中航沈飞	1,675,788.00	4.77
41	688700	东威科技	1,659,399.80	4.73
42	002997	瑞鹄模具	1,657,207.00	4.72
43	002409	雅克科技	1,654,821.00	4.71
44	600150	中国船舶	1,627,204.00	4.64
45	603019	中科曙光	1,614,276.00	4.60
46	601021	春秋航空	1,560,826.00	4.45
47	002371	北方华创	1,555,161.00	4.43

48	688981	中芯国际	1,553,879.00	4.43
49	688385	复旦微电	1,533,348.79	4.37
50	601728	中国电信	1,527,000.00	4.35
51	688268	华特气体	1,517,119.06	4.32
52	600732	爱旭股份	1,512,740.00	4.31
53	688122	西部超导	1,493,853.70	4.26
54	002747	埃斯顿	1,483,192.00	4.23
55	688766	普冉股份	1,481,239.62	4.22
56	603348	文灿股份	1,472,408.01	4.19
57	601633	长城汽车	1,466,533.00	4.18
58	603737	三棵树	1,453,023.00	4.14
59	688138	清溢光电	1,437,001.60	4.09
60	002821	凯莱英	1,434,155.00	4.09
61	002149	西部材料	1,422,877.00	4.05
62	002955	鸿合科技	1,420,388.00	4.05
63	300727	润禾材料	1,415,339.00	4.03
64	300476	胜宏科技	1,406,154.00	4.01
65	000568	泸州老窖	1,405,102.00	4.00
66	600522	中天科技	1,402,495.13	4.00
67	688559	海目星	1,399,994.17	3.99
68	300037	新宙邦	1,395,856.60	3.98
69	300456	赛微电子	1,387,204.00	3.95
70	002654	万润科技	1,365,300.00	3.89
71	600363	联创光电	1,331,160.00	3.79
72	601088	中国神华	1,329,567.00	3.79
73	600362	江西铜业	1,314,000.00	3.74
74	300684	中石科技	1,312,949.00	3.74
75	601066	中信建投	1,308,900.00	3.73
76	002126	银轮股份	1,306,646.00	3.72
77	002463	沪电股份	1,298,414.00	3.70
78	600377	宁沪高速	1,296,473.00	3.69
79	002599	盛通股份	1,295,466.00	3.69
80	600809	山西汾酒	1,293,085.00	3.68
81	002261	拓维信息	1,277,657.00	3.64
82	603629	利通电子	1,275,194.00	3.63
83	603517	绝味食品	1,259,784.00	3.59
84	600584	长电科技	1,253,920.00	3.57
85	300474	景嘉微	1,248,742.00	3.56

86	600703	三安光电	1,242,745.00	3.54
87	603939	益丰药房	1,225,520.00	3.49
88	688568	中科星图	1,220,170.14	3.48
89	601985	中国核电	1,194,500.00	3.40
90	000988	华工科技	1,189,758.00	3.39
91	688041	海光信息	1,184,872.62	3.38
92	600030	中信证券	1,174,402.00	3.35
93	688106	金宏气体	1,166,084.34	3.32
94	600941	中国移动	1,162,444.03	3.31
95	002727	一心堂	1,157,457.00	3.30
96	000810	创维数字	1,153,504.22	3.29
97	601006	大秦铁路	1,143,900.00	3.26
98	300480	光力科技	1,141,422.00	3.25
99	600845	宝信软件	1,135,659.00	3.24
100	000831	中国稀土	1,134,500.00	3.23
101	603383	顶点软件	1,132,175.20	3.23
102	300502	新易盛	1,130,700.00	3.22
103	600460	士兰微	1,129,184.00	3.22
104	603083	剑桥科技	1,125,770.00	3.21
105	688707	振华新材	1,121,533.25	3.20
106	600089	特变电工	1,106,200.00	3.15
107	300782	卓胜微	1,084,951.00	3.09
108	300413	芒果超媒	1,076,510.00	3.07
109	600276	恒瑞医药	1,067,680.00	3.04
110	300623	捷捷微电	1,063,451.00	3.03
111	688036	传音控股	1,058,076.73	3.01
112	300101	振芯科技	1,047,333.00	2.98
113	002992	宝明科技	1,043,879.00	2.97
114	603800	道森股份	1,039,960.00	2.96
115	300442	润泽科技	1,038,414.00	2.96
116	600258	首旅酒店	1,029,980.00	2.93
117	603650	彤程新材	1,021,628.00	2.91
118	601888	中国中免	1,021,175.00	2.91
119	002928	华夏航空	1,015,063.00	2.89
120	600188	兖矿能源	1,012,600.00	2.88
121	300671	富满微	1,011,886.00	2.88
122	002373	千方科技	1,011,136.00	2.88
123	300136	信维通信	1,003,272.00	2.86

124	300666	江丰电子	999,094.00	2.85
125	601020	华钰矿业	993,010.00	2.83
126	688012	中微公司	989,719.87	2.82
127	688260	昀冢科技	975,627.37	2.78
128	300498	温氏股份	971,267.00	2.77
129	300811	铂科新材	966,498.20	2.75
130	300595	欧普康视	965,270.00	2.75
131	300748	金力永磁	943,844.40	2.69
132	603169	兰石重装	918,127.00	2.62
133	002487	大金重工	917,640.00	2.61
134	603003	龙宇股份	894,458.00	2.55
135	002472	双环传动	887,396.00	2.53
136	600552	凯盛科技	880,400.00	2.51
137	002334	英威腾	880,182.00	2.51
138	600487	亨通光电	878,510.00	2.50
139	688200	华峰测控	874,098.49	2.49
140	000786	北新建材	870,475.00	2.48
141	601600	中国铝业	867,600.00	2.47
142	002906	华阳集团	863,149.00	2.46
143	688578	艾力斯	862,854.92	2.46
144	000538	云南白药	857,644.60	2.44
145	688608	恒玄科技	854,225.96	2.43
146	300765	新诺威	853,777.43	2.43
147	688278	特宝生物	845,860.16	2.41
148	300776	帝尔激光	844,200.00	2.41
149	603915	国茂股份	840,191.00	2.39
150	002837	英维克	827,126.00	2.36
151	688188	柏楚电子	827,117.30	2.36
152	300475	香农芯创	824,667.00	2.35
153	300274	阳光电源	822,286.00	2.34
154	603093	南华期货	820,155.00	2.34
155	002284	亚太股份	798,200.00	2.27
156	002709	天赐材料	797,947.00	2.27
157	603322	超讯通信	790,417.00	2.25
158	002601	龙佰集团	788,589.00	2.25
159	301236	软通动力	786,384.00	2.24
160	002352	顺丰控股	785,408.00	2.24
161	603345	安井食品	783,965.00	2.23

162	601688	华泰证券	777,180.00	2.21
163	603890	春秋电子	766,600.00	2.18
164	601607	上海医药	765,703.00	2.18
165	300576	容大感光	762,820.00	2.17
166	688019	安集科技	756,101.20	2.15
167	605358	立昂微	749,285.00	2.13
168	301052	果麦文化	738,039.47	2.10
169	002154	报喜鸟	737,146.41	2.10
170	300602	飞荣达	731,471.00	2.08
171	600839	四川长虹	731,150.00	2.08
172	300863	卡倍亿	730,520.00	2.08
173	301015	百洋医药	720,566.56	2.05
174	002129	TCL 中环	713,300.00	2.03
175	002338	奥普光电	708,521.00	2.02
176	600976	健民集团	704,817.00	2.01
177	688128	中国电研	704,090.00	2.01
178	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。

#### 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	353,688,945.46
卖出股票收入（成交）总额	356,593,690.34

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。

#### 8.5 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

## 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

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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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中，中国工商银行股份有限公司（包含公司高管、分支行、分支行高管）在本报告编制日前一年内出现受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）、中国人民银行或其派出机构、国家外汇管理局或其派出机构等监管部门公开批评、处罚的情况。中国农业银行股份有限公司（包含公司高管、分支行、分支行高管）在本报告编制日前一年内出现受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）、中国人民银行或其派出机构等监管部门公开批评、处罚的情况。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除此之外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。

### 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情况的说明

本基金没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	35,639.48
2	应收清算款	135,397.63
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	171,037.11

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
414	123,154.15	19,998,900.00	39.22%	30,986,919.80	60.78%

### 9.2 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	658,357.77	1.2913%

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。

### 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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。

### 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

公司基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**§ 10 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	1,396,681.42
减:本报告期基金总赎回份额	7,626,058.95
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	50,985,819.80

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2023 年 8 月 7 日起至 2023 年 9 月 1 日期间以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，2023 年 9 月 5 日，在基金托管人兴业银行股份有限公司授权代表的监督下，基金管理人对本次大会表决进行了计票，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证，上海市通力律师事务所对计票过程及结果进行了见证。

根据计票结果，参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的二分之一以上（含二分之一），因此未达到《基金法》及《基金合同》规定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效召开条件。详情可见基金管理人网站（www.guodu.com）刊登的《国都证券股份有限公司关于国都聚成混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

### 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

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 日收到朱玉萍女士递交的辞去其所担任的董事会秘书、副总经理等一切职务的辞职报告。根据《国都证券股份有限公司章程》及相关规定，自 2023 年 1 月 18 日起，朱玉萍女士不再担任公司副总经理职务。公司董事会将尽快选聘新的董事会秘书，在董事会选聘出新的董事会秘书前，仍由朱玉萍女士履行公司董事会秘书（信息披露事务负责人）职责。

根据公司第二届董事会第十七次会议决议，自 2023 年 2 月 7 日起聘任孙冠楠先生为公司董事会秘书、副总经理，朱玉萍女士不再担任公司董事会秘书职务。公司已对外公告了董事会决议，并在公司内部发布了《关于孙冠楠、朱玉萍职务任免的通知》。

公司董事会于 2023 年 3 月 9 日收到孙冠楠先生递交的辞去其所担任的董事会秘书、副总经理的辞职报告。根据《国都证券股份有限公司章程》及相关规定，自 2023 年 3 月 9 日起，孙冠楠先生不再担任公司董事会秘书、副总经理职务，在公司董事会选出新任董事会秘书前，将由公司董事长翁振杰先生代行董事会秘书职责。同时，孙冠楠先生不再兼任国都景瑞投资有限公司董事、董事长职务。

公司第二届董事会第十八次会议决议，自 2023 年 4 月 25 日起聘任赵红宇女士为公司首席信息官、副总经理，公司总经理、财务负责人杨江权先生不再代行首席信息官职责。

公司第二届董事会第十九次会议决议，自 2023 年 6 月 6 日起聘任李永梅女士为公司董事会秘书，公司董事长翁振杰先生不再代行董事会秘书职责。

董事会于 2023 年 7 月 24 日收到储钢汉先生的辞职报告。根据《国都证券股份有限公司章程》及相关规定，自 2023 年 7 月 24 日起，储钢汉先生不再担任我公司副总经理职务，并不再担任保荐业务负责人。

## 2、基金业务层面

无。

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。

### 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行本年度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)，自 2021 年 12 月 27 日起更换并服务至今。

### 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

报告期内，本基金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。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	数量	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	710,282,635.80	100.00%	657,256.21	100.00%	-

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，与托管在同一托管人的公司其他基金共用交易单元。

### 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

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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国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_ 招募说明书（更新）2023 年第 1 号	证监会指定媒体	2023 年 3 月 15 日
4	国都聚成混合型证券投资基金基 金产品资料概要（更新）	证监会指定媒体	2023 年 3 月 15 日
5	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

6	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
7	国都聚成混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	证监会指定媒体	2023 年 7 月 20 日
8	国都证券股份有限公司关于以通 讯方式召开国都聚成混合型证券 投资基金基金份额持有人大会的 公告	证监会指定媒体	2023 年 8 月 1 日
9	国都证券股份有限公司关于以通 讯方式召开国都聚成混合型证券 投资基金基金份额持有人大会的 第一次提示性公告	证监会指定媒体	2023 年 8 月 2 日
10	国都证券股份有限公司关于以通 讯方式召开国都聚成混合型证券 投资基金基金份额持有人大会的 第二次提示性公告	证监会指定媒体	2023 年 8 月 3 日
11	国都证券股份有限公司关于调低 旗下部分基金费率并修订基金合 同的公告	证监会指定媒体	2023 年 8 月 11 日
12	国都聚成混合型证券投资基金_ 基金合同（更新）	证监会指定媒体	2023 年 8 月 11 日
13	国都聚成混合型证券投资基金_ 托管协议（更新）	证监会指定媒体	2023 年 8 月 11 日
14	国都聚成混合型证券投资基金_ 招募说明书（更新）2023 年第 2 号	证监会指定媒体	2023 年 8 月 16 日
15	国都聚成混合型证券投资基金基 金产品资料概要（更新）	证监会指定媒体	2023 年 8 月 16 日
16	国都聚成混合型证券投资基金	证监会指定媒体	2023 年 8 月 30 日

	2023 年中期报告		
17	国都证券股份有限公司关于国都聚成混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证监会指定媒体	2023 年 9 月 6 日
18	国都聚成混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	证监会指定媒体	2023 年 10 月 25 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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金自 2023 年 8 月 14 日起，调低基金的管理费率并对基金合同有关条款进行修订。详情可见基金管理人网站（[www.guodu.com](http://www.guodu.com)）刊登的《国都证券股份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》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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)。

### 13.3 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

2024 年 3 月 29 日