

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
2023 年年度报告
2023 年 12 月 31 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二四年三月三十日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	7
2.1 基金基本情况.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.2 基金净值表现.....	9
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.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验.....	11
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.3.1 公平交易制度和控制方法.....	13
4.3.2 公平交易制度的执行情况.....	13
4.3.3 异常交易行为的专项说明.....	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.....	13
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析.....	13
4.4.2 报告期内基金的业绩表现.....	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.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
§6 审计报告	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 其他信息.....	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
7.4.1 基金基本情况.....	23
7.4.2 会计报表的编制基础.....	24
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	24
7.4.4 重要会计政策和会计估计.....	24
7.4.4.1 会计年度.....	24

7.4.4.2 记账本位币	24
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类	25
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	25
7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则	26
7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销	27
7.4.4.7 实收基金	27
7.4.4.8 损益平准金	27
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量	27
7.4.4.10 费用的确认和计量	27
7.4.4.11 基金的收益分配政策	28
7.4.4.12 分部报告	28
7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计	28
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明	29
7.4.5.1 会计政策变更的说明	29
7.4.5.2 会计估计变更的说明	29
7.4.5.3 差错更正的说明	29
7.4.6 税项	29
7.4.7.2 交易性金融资产	30
7.4.7.3 衍生金融资产/负债	31
7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券	32
7.4.7.9 其他负债	32
7.4.7.10 实收基金	33
7.4.7.12 未分配利润	33
7.4.7.13 存款利息收入	33
7.4.7.14 股票投资收益	34
7.4.7.15 基金投资收益	34
7.4.7.16 债券投资收益	34
7.4.7.17 资产支持证券投资收益	34
7.4.7.18 贵金属投资收益	35
7.4.7.19 衍生工具收益	35
7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益	35
7.4.7.20 股利收益	35
7.4.7.22 其他收入	36
7.4.7.25 其他费用	37
7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明	37
7.4.8.1 或有事项	37
7.4.8.2 资产负债表日后事项	37
7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易	38
7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易	38
7.4.10.1.1 股票交易	38
7.4.10.1.2 权证交易	38
7.4.10.1.3 债券交易	38
7.4.10.1.4 债券回购交易	38
7.4.10.1.5 基金交易	38
7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金	38

7.4.10.2 关联方报酬.....	38
7.4.10.2.1 基金管理费.....	38
7.4.10.2.2 基金托管费.....	39
7.4.10.2.3 销售服务费.....	39
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.....	39
7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况.....	39
7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况.....	39
7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况.....	39
7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入.....	39
7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况.....	40
7.4.11 利润分配情况.....	40
7.4.12 期末(2023 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券.....	40
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.....	40
7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票.....	41
7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券.....	41
7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购.....	41
7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购.....	41
7.4.13 金融工具风险及管理.....	41
7.4.13.1 风险管理政策和组织架构.....	41
7.4.13.2 信用风险.....	41
7.4.13.3 流动性风险.....	42
7.4.13.4 市场风险.....	42
7.4.13.4.1 利率风险.....	42
7.4.13.4.1.1 利率风险敞口.....	43
7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析.....	45
7.4.13.4.2 外汇风险.....	45
7.4.13.4.3 其他价格风险.....	45
7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口.....	45
7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析.....	46
7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项.....	47
§8 投资组合报告.....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
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.....	48
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.....	48
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

8.11.1 本期国债期货投资政策	49
8.11.2 本期国债期货投资评价	49
8.12 本报告期投资基金情况	49
8.13 投资组合报告附注	51
8.13.3 期末其他各项资产构成	51
8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细	52
8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	52
8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分	52
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	53
§10 开放式基金份额变动	53
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.16 其他重大事件	57
12 影响投资者决策的其他重要信息	59
§13 备查文件目录	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
基金简称	新华精选成长主题 3 个月持有期混合(FOF)
基金主代码	009146
交易代码	009146
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 26 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,340,664.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将精选具有成长风格的金牛基金以及其他优质基金构建投资组合，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、债权投资策略。</p> <p>本基金运用定量与定性相结合的研究方法进行基金精选，对国内公开募集的开放式证券投资基金的业绩、风险、持仓、规模、持有人结构和费率等要素进行定量分析，对拟投资的基金投资策略、决策流程、风险措施、基金经理、投资团队、研究支持和公司管理等要素进行定量及定性分析，自下而上精选出投资能力稳健、持续业绩良好、投资风格稳定的基金。</p> <p>基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点，辅以全市场精选出的优质基金构建投资组合，在保持适度流动性、控制风险的前提下增厚组合收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于货币市场基金、货币型基金

	中基金、债券型基金和债券型基金中基金。
--	---------------------

注：《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。

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		新华基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	任航
	联系电话	010-68779688	010-66060069
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008198866	95599
传真		010-68779528	010-68121816
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		400010	100031
法定代表人		于春玲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 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
本期已实现收益	-918,633.78	-2,464,819.26	5,518,933.36
本期利润	148,112.84	-5,407,566.33	-56,048.56
加权平均基金份额本期利润	0.0040	-0.2608	-0.0014
本期加权平均净值利润率	0.39%	-24.47%	-0.11%
本期基金份额净值增长率	-0.51%	-21.75%	1.08%
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	-152,106.95	-74,424.78	5,341,142.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0065	-0.0014	0.2761
期末基金资产净值	23,188,557.72	51,270,524.08	24,687,355.18
期末基金份额净值	0.9935	0.9986	1.2761
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	-0.65%	-0.14%	27.61%

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；由于本基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，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）。

3.2 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-1.36%	0.22%	-2.17%	0.52%	0.81%	-0.30%
过去六个月	-2.13%	0.17%	-4.88%	0.51%	2.75%	-0.34%
过去一年	-0.51%	0.40%	-2.36%	0.49%	1.85%	-0.09%
过去三年	-21.31%	0.88%	-2.87%	0.65%	-18.44%	0.23%
自基金合同生效起至今	-0.65%	0.89%	8.59%	0.68%	-9.24%	0.21%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%；

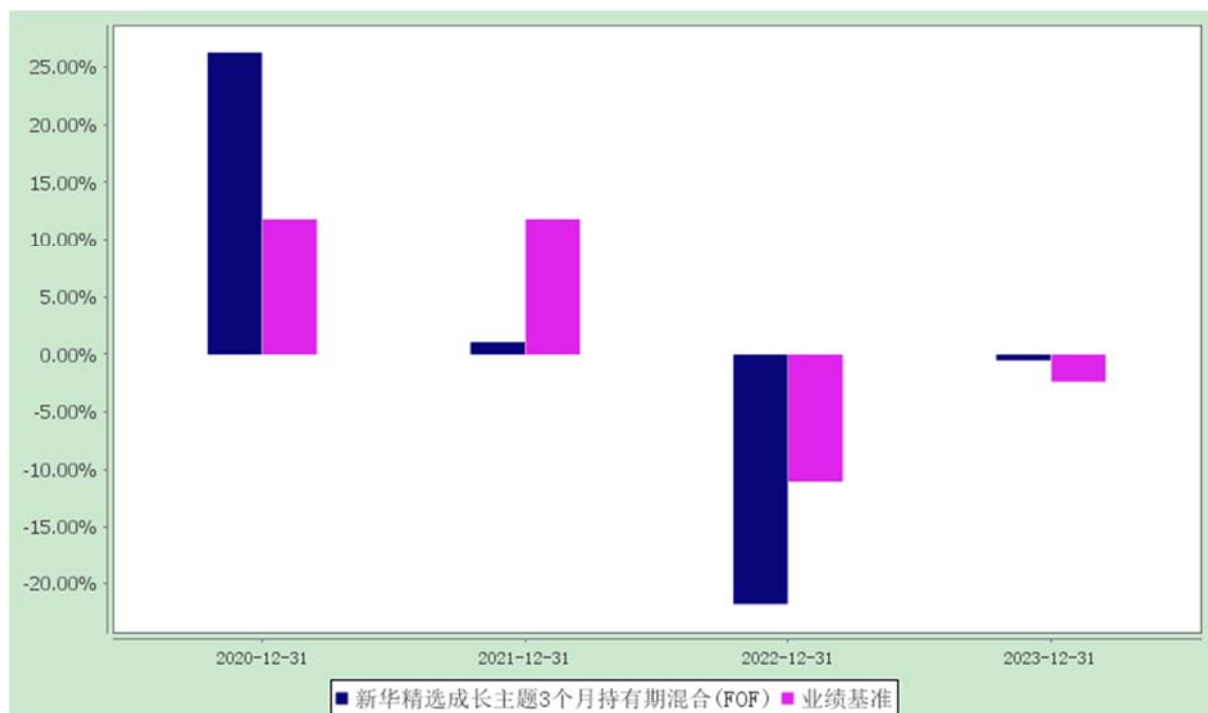
2、本基金对业绩基准采用每日再平衡的计算方法。

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



注：报告期内本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。

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



注：本基金于 2020 年 04 月 26 日基金合同生效，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

本基金过去三年本基金未进行过利润分配。

§ 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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2023 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、

新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
李伟	本基金基金经理。	2022-09-14	-	7	软件工程专业硕士，历任国家开发银行企业年金管理岗，主要从事企业年金基金投资管理工作。
冯瑞齐	本基金基金经理。	2022-09-02	2023-07-17	-	硕士，历任国联证券行业研究员、新华基金主题策略部研究员。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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，新华基金管理股份有限公司作为新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金

(FOF) 的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》以及其它有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订), 公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》, 以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动, 同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构, 在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时, 使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会, 并重视交易执行环节的公平交易措施, 以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则, 保证交易在各投资组合间的公正实施, 保证各投资组合间的利益公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内, 基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》的规定。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明: 债券同向交易频率偏低; 股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断, 即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大, 结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

本报告期内, 公平交易管理执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生, 本报告期内, 未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 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

海外经济方面, 抗通胀、货币政策紧缩是 2023 年海外经济主线, 美国经济韧性超出预期, 全球经济整体复苏不均衡, 经济增长动力回落。1 月至 6 月, 美国 CPI 同比从 6.4% 下降至 3.0%, 7 月至 12 月通胀水平在 3.1% 至 3.7% 之间来回往复。美联储始终坚持 2% 的通胀目标, 联邦基金目标利率升至 5.0%-5.25%, 9 月之后美联储才暂停加息。在高利率环境下, 美国经济表现出韧性, 与 2022 年底

市场机构预测结果相悖，全年经济增长 2.5%。欧元区面对高通胀，也选择货币政策紧缩，但全年经济增长只有 0.5%。受地缘政治、高通胀、货币紧缩等因素影响，全球经济下行压力加大，经济增长进一步放缓。

国内经济方面，2023 年是疫情防控转段后经济常态化运行第一年，经济整体回升向好，全年 GDP 增长 5.2%。分结构上看，消费增长超预期，全年社零同比增长 7.2%，成为经济增长的主要驱动力；在房地产市场持续低迷环境下，财政保持加力，全年固定资产投资增长 3.0%，其中基础设施投资同比增长 5.9%，房地产开发投资下降 9.6%；全球经济增长放缓情况下，全年货物进出口同比增长 0.2%，发达市场占中国出口份额下降，新兴市场重要性提升。货币政策整体较为宽松，但受房地产市场低迷、企业居民预期偏弱等因素影响，资金活化程度不足。一些困扰经济中长期发展的问题显现，为以后经济增长带来了挑战。贸易保护主义升温，海外需求不稳定，我国在全球供应链中的地位受到影响；国内经济新旧动能转换过渡期，还没有产生完全替代房地产的支柱产业；人口下降趋势明显，叠加人口老龄化，潜在经济增长率可能会进一步下降。

2023 年股票市场表现不佳，行业间分化大。经济复苏不及预期、外资流出压力、经济转型中出现结构性问题等因素压低了权益资产的估值。万得全 A 跌 5.19%，行业间收益分化较大，TMT 行业表现较好，消费、地产链、新能源相关行业表现欠佳，万得偏股基金指数首次连续两年收益为负。国内货币政策较为宽松，经济新旧动能转换背景下，债券收益率震荡下行，债券市场表现较好。

回顾本基金全年运作，一季度积极布局配置国企改革、医药、数字经济、海外抗通胀相关基金；二季度阶段性参与数字经济、国企改革等机会，但随着逐步下修经济复苏预期，增加了债券基金比重；三、四季度以债券基金打底，阶段性参与市场热点以获取收益。我们将密切关注宏观政策及市场走向，及时调整组合配置思路，优化权益和债券基金比例，积极参与市场机会，努力为持有人创造稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9935 元，本报告期份额净值增长率为-0.51%，同期比较基准的增长率为-2.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，全球经济增长依然面临下行压力，各国经济分化可能加大。货币政策方面，美联储加息周期结束，但具体时点要边走边看。美联储要根据数据采取行动，利率水平仍将长时间维持高位，经济“软着陆”可能性较大；欧元区如果也维持高利率较长时间，经济前景可能会比较暗淡。同时，24 年很多国家面临选举，地缘政治风险加大。

国内经济方面，中央经济工作会议提出国内经济将稳中求进，以进促稳，先立后破。预计财政政策更加积极，房地产行业逐步企稳，高新技术制造业将会得到更多政策支持而快速发展。货币政策会更加灵活适度、精准有效，货币流动性保持合理充裕，促进内需增长，推动物价回升。同时房地产、地方债务等风险隐患也会妥善处理，稳定居民和企业预期举措会逐步实施，以提升居民消费和企业投资意愿。总的来讲，国内经济以扩大内需，调整经济结构为主线，财政政策恢复和扩大国

内有效需求，货币政策做好流动性配合，逐步激发经济内生增长动能。

权益市场方面，经过过去两年多的调整，A 股估值水平处于中长期历史较低位置，具有很大的修复空间。海外加息接近尾声，资金流出压力变缓；国内经济稳步上行，上市企业业绩边际改善；政策强调以投资者为本，有关市场制度进一步完善；引入中长期资金，市场情绪也将逐步回暖，这些利好因素都为权益市场上行提供支撑。债券市场方面，经济内生动能稳步修复，在经济未出现大幅增长情况下，货币政策转向收紧的概率较小，仍保持流动性较为宽裕，利率中枢下移，将对债市表现形成利好。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和

基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金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。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告期本基金自2023年2月17日起至2023年4月04日，连续33个工作日基金资产净值低于五千万元；自2023年4月21日起至2023年7月18日，连续58个工作日基金资产净值低于五千万元；自2023年8月22日起至2023年10月23日，连续39个工作日基金资产净值低于五千万元；自2023年10月25日起至2023年12月29日，连续48个工作日基金资产净值低于五千万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—新华基金管理股份有限公司2023年1月1日至2023年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，新华基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息

披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

致同审字（2024）第 110A006099 号

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）全体基金份额持有人：

我们审计了后附的新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“新华精选成长 3 个月混合（FOF）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、净资产变动表及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了新华精选成长 3 个月混合（FOF）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。

6.2 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，我们独立于新华精选成长 3 个月混合（FOF）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。

6.3 其他信息

新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估新华精选成长 3 个月混合（FOF）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，除非基金管理人管理层计划清算新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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）评价基金管理人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）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金的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新华精选成长 3 个月混合（FOF）基金不能持续经营。

（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。

我们与基金管理人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。

致同会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张伟 邓冰清

北京市朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层

2024 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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	3,730,496.40	3,473,149.94
结算备付金		16,766.93	118,805.68
存出保证金		6,580.04	3,202.10
交易性金融资产	7.4.7.2	19,285,441.45	46,141,098.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		19,285,441.45	46,141,098.20
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	-	-
应收清算款		326,897.91	1,400,115.40
应收股利		10,000.00	237,003.97
应收申购款		-	99.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		23,376,182.73	51,373,475.19
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,919.69	987.09
应付管理人报酬		19,707.51	43,887.64
应付托管费		2,997.81	8,076.38
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	160,000.00	50,000.00
负债合计		187,625.01	102,951.11
净资产：		-	-
实收基金	7.4.7.10	23,340,664.67	51,344,948.86
其他综合收益	7.4.7.1 1	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-152,106.95	-74,424.78
净资产合计		23,188,557.72	51,270,524.08
负债和净资产总计		23,376,182.73	51,373,475.19

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9935 元，基金份额总额 23,340,664.67 份。

7.2 利润表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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	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

一、营业总收入		765,609.74	-5,113,700.10
1.利息收入		43,897.45	18,150.32
其中：存款利息收入	7.4.7.13	43,897.45	18,150.32
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）		-477,908.69	-2,189,279.67
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益	7.4.7.15	-732,511.53	-3,143,054.65
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	254,602.84	953,774.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,066,746.62	-2,942,747.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	132,874.36	176.32
减：二、营业总支出		617,496.90	293,866.23
1. 管理人报酬		382,031.40	202,086.02
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		68,753.21	39,158.25
3. 销售服务费		-	-
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	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		1,416.68	-
8. 其他费用	7.4.7.25	165,295.61	52,621.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		148,112.84	-5,407,566.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		148,112.84	-5,407,566.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		148,112.84	-5,407,566.33
----------	--	------------	---------------

7.3 净资产变动表

会计主体：新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51,344,948.86	-74,424.78	51,270,524.08
二、本期期初净资产	51,344,948.86	-74,424.78	51,270,524.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,004,284.19	-77,682.17	-28,081,966.36
（一）、综合收益总额	-	148,112.84	148,112.84
（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）	-28,004,284.19	-225,795.01	-28,230,079.20
其中：1.基金申购款	48,526,446.66	657,059.50	49,183,506.16
2.基金赎回款	-76,530,730.85	-882,854.51	-77,413,585.36
（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	23,340,664.67	-152,106.95	23,188,557.72
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,346,212.26	5,341,142.92	24,687,355.18
二、本期期初净资产	19,346,212.26	5,341,142.92	24,687,355.18

资产			8
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	31,998,736.60	-5,415,567.70	26,583,168.90
（一）、综合收益总额	-	-5,407,566.33	-5,407,566.33
（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）	31,998,736.60	-8,001.37	31,990,735.23
其中：1.基金申购款	37,757,370.72	734,591.51	38,491,962.23
2.基金赎回款	-5,758,634.12	-742,592.88	-6,501,227.00
（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	51,344,948.86	-74,424.78	51,270,524.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：于春玲，主管会计工作负责人：杨金亮，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)(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]279 号文件《关于准予新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》核准，由新华基金管理股份有限公司于 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 21 日向社会公开募集，首次募集资金总额 222,428,427.57 元，其中募集资金产生利息 83,535.76 元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2020]36010005 号验资报告予以验证。2020 年 4 月 26 日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型定期开放式证券投资基金，存续期不限，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书》及《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的证券投资基金、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含

同业存单)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相关规定。本基金不投资于 QDII 基金、香港互认基金,也不投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金。本基金不直接在二级市场买入股票,也不参与一级市场新股申购和新股增发。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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于经中国证监会核准或注册的基金份额占基金资产的比例不低于 80%,股票型基金的投资占基金资产的比例为 10%-50%,投资于“精选成长组合”成份基金的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会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。

本基金为混合型基金中基金,其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金。

本基金业绩比较基准:中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

(2) 金融负债

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

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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权

重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）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；或者（3）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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

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份额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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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确认，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

基金投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《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《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,730,496.40	3,473,149.94
等于：本金	3,729,755.73	3,471,775.52
加：应计利息	740.67	1,374.42
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	3,730,496.40	3,473,149.94

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		-	-	-	-
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		19,060,244.81	-	19,285,441.45	225,196.64
其他		-	-	-	-
合计		19,060,244.81	-	19,285,441.45	225,196.64
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		-	-	-	-
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		46,982,648.18	-	46,141,098.20	-841,549.98
其他		-	-	-	-
合计		46,982,648.18	-	46,141,098.20	-841,549.98

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金均无衍生金融资产/负债余额。

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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

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**

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	80,000.00	50,000.00
应付证券日报	80,000.00	-
合计	160,000.00	50,000.00

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	51,344,948.86	51,344,948.86
本期申购	48,526,446.66	48,526,446.66
本期赎回（以“-”号填列）	-76,530,730.85	-76,530,730.85
本期末	23,340,664.67	23,340,664.67

7.4.7.11 其他综合收益

本报告期末本基金无其他综合收益。

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	21,881,073.88	-21,955,498.66	-74,424.78
本期期初	21,881,073.88	-21,955,498.66	-74,424.78
本期利润	-918,633.78	1,066,746.62	148,112.84
本期基金份额交易产生的变动数	-12,021,827.59	11,796,032.58	-225,795.01
其中：基金申购款	20,221,908.58	-19,564,849.08	657,059.50
基金赎回款	-32,243,736.17	31,360,881.66	-882,854.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,940,612.51	-9,092,719.46	-152,106.95

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	41,815.63	17,953.41

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	2,081.82	196.91
其他	-	-
合计	43,897.45	18,150.32

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.15 基金投资收益

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
卖出/赎回基金成交总额	330,357,939.09	90,392,308.25
减：卖出/赎回基金成本总额	330,531,800.83	93,402,578.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	11,805.67	-
减：交易费用	546,844.12	132,784.48
基金投资收益	-732,511.53	-3,143,054.65

7.4.7.16 债券投资收益

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资收益。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 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。

7.4.7.18 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 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。

7.4.7.19.2 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。

7.4.7.20 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	-	-
基金投资产生的股利收益	254,602.84	953,774.98
合计	254,602.84	953,774.98

7.4.7.21 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	1,066,746.62	-2,942,747.07
——股票投资	-	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	1,066,746.62	-2,942,747.07
——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	1,066,746.62	-2,942,747.07

7.4.7.22 其他收入

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
基金赎回费收入	132,874.36	176.32
合计	132,874.36	176.32

7.4.7.23 持有基金产生的费用

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
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	70,107.32	17,837.22
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	279,363.17	236,519.68
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	56,701.22	42,990.17

7.4.7.24 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。

7.4.7.25 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	80,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	5,295.61	2,621.96
证券日报	80,000.00	-
合计	165,295.61	52,621.96

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 2023 年 12 月 31 日，本基金并无需要作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

2023 年 2 月 8 日，本基金管理人发布了《新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告》，中国证券监督管理委员会依法核准了北京金融街投资（集团）有限公司成为新华基金管理股份有限公司实际控制人。本次变更后本基金管理人控股股东仍为恒泰证券。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东
北京金融街投资（集团）有限公司	基金管理人实际控制人

注：2023 年 2 月 8 日，本基金管理人发布了《新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告》，中国证券监督管理委员会依法核准了北京金融街投资（集团）有限公司成为新华基金管

理股份有限公司实际控制人。本次变更后本基金管理人控股股东仍为恒泰证券。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行无权证交易。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	382,031.40	202,086.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	73,923.99	69,462.07
应支付基金管理人的净管理费	308,107.41	132,623.95

注：1、本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的基金部分的余额（若为负数，则取0）的1.00%年费率计提。逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值扣

除前一日所持有本基金管理人管理的基金部分的余额（若为负数，则取 0） $\times 1\%$ /当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	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托管费	68,753.21	39,158.25

注：本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金部分的余额（若为负数，则取 0）的 0.20% 的年费率计提。逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管人报酬=前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金部分的余额（若为负数，则取 0） $\times 0.20\%$ /当年天数。

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

本报告期及上年度可比期间本基金无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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国农业银行股份有限公司	3,730,496.40	41,815.63	3,473,149.94	17,953.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，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未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

截止本报告期末，本基金未持有本管理人管理的基金。

7.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	1,366.39
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	-	21,769.42
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	6,486.16	4,908.96

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

截至本报告期末，本基金未持有受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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。

本基金管理人建立了科学有效、职责明晰的风险管理组织架构，建立和完善了与其业务特点、规模和复杂程度相适应的风险管理体系。董事会、监事会、经理层依法履行职责，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

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	3,730,496.40	-	-	-	3,730,496.40
结算备付金	16,766.93	-	-	-	16,766.93
存出保证金	6,580.04	-	-	-	6,580.04
交易性金融资产	-	-	-	19,285,441.45	19,285,441.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	326,897.91	326,897.91
应收股利	-	-	-	10,000.00	10,000.00
应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	3,753,843.37	0.00	0.00	19,622,339.36	23,376,182.73
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	4,919.69	4,919.69
应付管理人报酬	-	-	-	19,707.51	19,707.51
应付托管费	-	-	-	2,997.81	2,997.81
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	187,625.01	187,625.01

新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)

利率敏感度缺口	3,753,843.37	0.00	0.00	19,434,714.35	23,188,557.72
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					
银行存款	3,473,149.94	-	-	-	3,473,149.94
结算备付金	118,805.68	-	-	-	118,805.68
存出保证金	3,202.10	-	-	-	3,202.10
交易性金融资产	-	-	-	46,141,098.20	46,141,098.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收证券清算款	-	-	-	1,400,115.40	1,400,115.40
应收股利	-	-	-	237,003.97	237,003.97
应收申购款	-	-	-	99.90	99.90
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	3,595,157.72	0.00	0.00	47,778,317.47	51,373,475.19
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	987.09	987.09
应付管理人报酬	-	-	-	43,887.64	43,887.64
应付托管费	-	-	-	8,076.38	8,076.38
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	102,951.11	102,951.11

利率敏感度缺口	3,595,157.72	0.00	0.00	47,675,366.36	51,270,524.08
---------	--------------	------	------	---------------	---------------

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。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或银行间同业市场交易的股票和债券，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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	19,285,441.45	83.17	46,141,098.20	90.00
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	19,285,441.45	83.17	46,141,098.20	90.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%或者下降 1%		
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 指数上升 1%	增加约 20,531.04	增加约 251,202.65
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 20,531.04	减少约 251,202.65

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	19,285,441.45	46,141,098.20
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	19,285,441.45	46,141,098.20

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本报告期末及上年末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	19,285,441.45	82.50
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	3,747,263.33	16.03
8	其他各项资产	343,477.95	1.47
9	合计	23,376,182.73	100.00

8.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

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投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未买卖股票。

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

本基金本报告期内未买卖股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为成长主题混合型基金中基金，主要投资于风格稳定、管理人综合实力较强、持续业绩良好的成长风格基金，力图分享中国经济的增长红利。同时再辅以科学、全面的风险控制，可以有效保障本基金实现长期稳定增值的投资目标。成长风格基金主要投资于信誉良好、具有良好增长潜力的上市公司股票或其他证券，重视资金的长期成长，追求资产的稳定、持续的长期增值。

具体筛选方法是：1) 将基金收益率序列与相应风格指数收益序列数据进行多因子回归，根据全部样本基金成长因子与价值因子得分分别进行百分位分级靠档，通过比较单个基金在参评基金样本中的风格特征显著度判定基金风格；2) 运用“分级靠档”方法，划分多个评价层次，对筛选出的成长风格金牛基金进行进一步风格细分；3) 从各评价层次中精选出其中长期业绩表现平稳、市场流动性良好、综合评分排名靠前的基金品种组成金牛成长核心基金池。

(2) 构建重点投资基金池

通过基金管理人自主建立的“定量+定性”综合基金研究评价体系，对全市场公开募集的开放式证券投资基金进行细致分类、科学定量和详细定性研究，并综合当前市场环境及预期收益目标、业绩比较基准、组合流动型等因素，形成重点投资基金池。

1) 构建初选基金池

初选基金池的筛选以定量分析方法为主。研究内容包括历史业绩分析和风险分析。其中基金历史业绩分析包括绝对和相对收益分析；风险分析包括确认基金总体投资风险水平适当可控，分析风险的来源以及基金风险调整后的收益。根据管理人设定的综合打分评价结果形成初选基金池。

2) 构建重点基金池

在初选基金池的基础上，结合对基金公司和基金经理的定量及定性分析，形成重点基金池。对基金公司和基金经理的评价从以下几个方面进行：

基金经理：年龄、性别、从业背景、投资年限、投资风格、业绩归因、收益及风险控制能力等；

基金管理人：公司历史、管理规模和公司管理层、股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和过

往法律纠纷等；

基金公司投资流程：基金决策机制、业绩增长模式（依靠人员还是依靠流程）、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

基金管理团队：团队结构、成员职责和从业经历、团队的绩效评价体系和备选基金的基金经理管理其他基金的状况；

风险控制：公司风险控制体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案。

（3）构建基金投资组合

基金管理人将同时入选金牛成长核心基金池和重点投资基金池的优质基金组成“精选成长组合”。本基金以“精选成长组合”为投资重点，投资于该组合的比例不低于非现金基金资产 80%。在综合考虑组合流动性、相关性及投资成本等因素的基础上，辅以重点投资基金池中精选出的其他优质基金进行投资。

（4）基金投资组合的动态调整

本基金管理人每月对基金组合进行检查，识别单只基金的表现并进行评估；每季度将会评估市场环境，对基金池进行筛选重排，在权衡调仓成本和预期收益的基础上决定是否进行调仓操作。

当市场发生极端行情、单只基金出现净值异常波动或其他重大事件时将即时启动风险评估，并适时调整基金组合。

通过上述动态调整机制，控制基金组合的风格漂移和业绩波动等风险，力求使得基金组合整体所承担的风险水平相对合理，实现组合资产的安全性、稳定性和盈利性。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比 例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	160618	鹏华丰泽 债券 (LOF)	契约型开 放式	2,169,068. 41	3,290,476. 78	14.19%	否
2	000128	大成景安 短融债券 A	契约型开 放式	2,564,521. 23	3,241,041. 93	13.98%	否
3	040041	华安纯债 债券 C	契约型开 放式	2,768,808. 60	2,978,961. 17	12.85%	否
4	100018	富国天利	契约型开	2,018,194.	2,738,084.	11.81%	否

		增长债券	放式	36	29		
5	004043	华夏鼎茂 债券 C	契约型开 放式	1,316,297. 62	1,682,623. 25	7.26%	否
6	270045	广发双债 添利债券 C	契约型开 放式	1,290,751. 69	1,539,221. 39	6.64%	否
7	004348	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C	契约型开 放式	804,154.7 6	1,184,278. 72	5.11%	否
8	017528	嘉实北证 50 成份指 数 C	契约型开 放式	749,782.2 0	836,307.0 7	3.61%	否
9	515220	国泰中证 煤炭 ETF	契约型开 放式	300,000.0 0	693,900.0 0	2.99%	否
10	675113	西部利得 汇享债券 C	契约型开 放式	544,529.3 8	665,251.5 4	2.87%	否
11	000979	景顺长城 沪港深精 选股票	契约型开 放式	122,120.9 8	233,495.3 1	1.01%	否
12	516010	国泰中证 动漫游戏 ETF	契约型开 放式	200,000.0 0	201,800.0 0	0.87%	否

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.13.2 本基金未投资股票。

8.13.3 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	6,580.04
2	应收清算款	326,897.91
3	应收股利	10,000.00
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	343,477.95

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.13.6 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
652	35,798.57	11,038,843.72	47.29%	12,301,820.95	52.71%

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	2,911.77	0.01%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020 年 4 月 26 日)基金份额总额	222,428,427.57
本报告期期初基金份额总额	51,344,948.86
本报告期基金总申购份额	48,526,446.66
减：本报告期基金总赎回份额	76,530,730.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	23,340,664.67

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 2 月 28 日，第二届董事会第三十七次会议决议于春玲女士代任本基金管理人董事长，翟晨曦女士离任董事长，刘征宇先生由于个人原因不再担任副总经理，崔凤廷先生担任副总经理职务。

2023 年 4 月 24 日，本基金管理人收到重庆市市场监督管理局工商变更批复，法定代表人变更为于春玲女士。

2023 年 6 月 28 日，第三届董事会第一次会议决议于春玲女士担任本基金管理人董事长职务、代任总经理职务，崔凤廷先生担任副总经理兼董事会秘书职务，张宗友先生不再担任联席董事长职务。经 2023 年第二次股东大会审议通过，选举于春玲女士、张宗友先生、李磊先生、匡双礼先生、

张坤女士、徐经长先生担任本基金管理人第三届董事会董事，其中匡双礼先生、张坤女士、徐经长先生为独立董事。经公司审议，杨淑飞、张浩不再担任第二届监事会监事职务，选举卢东亮、孙义为第三届监事会监事成员，其中，卢东亮为监事会主席。

2023 年 9 月 1 日，第三届董事会第四次（临时）会议决议杨金亮先生担任本基金管理人总经理职务，于春玲女士不再代任总经理职务。2023 年 9 月 15 日，经 2023 年第五次股东大会审议通过，增补杨金亮先生为第三届董事会董事。

2023 年 12 月 1 日，经 2023 年第六次（临时）股东大会审议通过，徐经长先生不再担任公司独立董事，增补陈佳俊女士担任公司独立董事。

本报告期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，基金管理人（次承租人）及原深圳办公区所租房屋出租方（承租人）与房屋业主之间的物权保护纠纷案件（2020），二审法院做出生效判决，判决基金管理人需向业主支付房屋占用费，承租人不当收取房租。基金管理人履行完生效判决后继续起诉承租人向其追偿损失，法院组织双方和解并出具了民事调解书，承租人已自动履行完毕。

基金管理人管理的专户产品众富 1 号交易对手湖北蕲春农商行与基金管理人之间的客户欺诈责任纠纷案件（2022），原告于开庭前自行撤诉，法院同意其撤诉申请后予以结案。

本报告期未有涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期未有基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金持有的基金未发生重大影响事件。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金进行审计的会计师事务所为致同会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。审计年限为 1 年。自 2020 年，致同会计师事务所为本基金连续提供 4 年审计服务。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	分公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-10-18

采取稽查或处罚等措施的机构	上海证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	不完整报送分支机构负责人参股及兼职信息
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改措施
其他	-

11.7.2 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
民生证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《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，本基金共租用56个交易席位，其中报告期内新增14个交易席位，退租1个交易席位。新增席位为：华福证券上海席位、华福证券深圳席位、中金公司深圳席位、山西证券上海席位、山西证券深圳席位、申港证券上海席位、太平洋证券上海席位、太平洋证券深圳席位、华安证券上海席位、华安证券深圳席位、国联证券上海席位、国联证券深圳席位、中邮证券上海席位、中邮证券深圳席位；退租席位为：大同证券深圳席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

11.15.2 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		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
民生证券	-	-	-	-	-	-	234,966,385.21	90.67%
新时代证券	-	-	-	-	-	-	22,446,340.50	8.66%
大同证券	-	-	-	-	-	-	1,738,384.10	0.67%

11.16 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-12
2	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-01-20
3	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2022 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-01-20
4	新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-02-08
5	新华基金管理股份有限公司关于调整直销柜台及网上直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-02-15

		报、公司网站、电子信披网站	
6	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
7	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-02
8	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新)	公司网站、电子信披网站	2023-03-21
9	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要 (更新)	公司网站、电子信披网站	2023-03-21
10	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-03-24
11	新华基金管理股份有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-03-30
12	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2022 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2023-03-30
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-04-21
14	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-04-21
15	新华基金管理股份有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-04-25
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-05-18
17	新华基金管理股份有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
18	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
19	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
20	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-06-30
21	新华基金管理股份有限公司新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理变更公告	证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-07-18
22	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新)	公司网站、电子信披网站	2023-07-19
23	新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要 (更新)	公司网站、电子信披网站	2023-07-19

24	新华基金管理股份有限公司旗下基金2季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-07-21
25	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023年第2季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-07-21
26	新华基金管理股份有限公司关于设立广东分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-07-29
27	新华基金管理股份有限公司关于暂停新华基金APP运营及维护服务的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-08-16
28	新华基金管理股份有限公司关于旗下全部基金中期报告的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-08-30
29	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023年中期报告	公司网站、电子信披网站	2023-08-30
30	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2023-09-02
31	新华基金管理股份有限公司旗下基金3季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2023-10-25
32	新华精选成长主题3个月持有期混合型基金中基金(FOF)2023年第3季度报告	公司网站、电子信披网站	2023-10-25
33	新华基金管理股份有限公司关于公司独立董事变更的公告	中国证券报、证券时报、公司网站、电子信披网站	2023-12-02

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230719 - 20231231	0.00	20,755,070.48	14,733,791.75	6,021,278.73	25.80%
	2	20230101 - 20230517	21,561,702.51	0.00	21,561,702.51	0.00	0.00%
	3	20230403 -	0.00	9,800,	9,800,05	0.00	0.00%

		20230718		058.81	8.81		
	4	20230719 - 20231231	0.00	17,786 ,720.2 0	12,769,1 55.21	5,017,564.9 9	21.50%
个人	1	20230518 - 20230718	5,755, 809.40	0.00	0.00	5,755,809.4 0	24.66%
	2	20231025 - 20231231	5,755, 809.40	0.00	0.00	5,755,809.4 0	24.66%
产品特有风险							
<p>(1) 本基金为基金中基金，T日的基金份额净值在T+2日内公告，估值时间及披露时间与其他类别基金不同；</p> <p>(2) 本基金所投资的基金可能发生重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及其他需要召开基金份额持有人大会的事项等，改变原投资组合的风格和策略，进而会对本基金的投资运作带来影响。</p> <p>(3) 本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期限，即自基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）至该日3个月后的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；该日3个月后的月度对日之后，投资者可以提出赎回申请。若该月实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。最短持有期到期前，基金份额持有人不能提出赎回申请，因此面临流动性风险。</p> <p>(4) 本基金投资其他证券投资基金出现净值计算错误、净值披露延迟或间断等情形时，从而给本基金带来估值风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023年2月8日，本基金管理人发布了《新华基金管理股份有限公司关于公司变更实际控制人的公告》，中国证券监督管理委员会依法核准了北京金融街投资（集团）有限公司成为新华基金管理股份有限公司实际控制人。本次变更后本基金管理人控股股东仍为恒泰证券。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件
- (二)关于申请募集新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）之法律意见书
- (三)新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
- (四)新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议
- (五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (六)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》（更新）
- (七)《新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要》（更新）
- (八)基金管理人业务资格批件、营业执照及公司章程

(九)基金托管人业务资格批件和营业执照

(十)中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二四年三月三十日