

国都聚成混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	41
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	46

§ 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
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	49,938,320.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	李昭	龚小武
	联系电话	010-84183229	021-52629999-212056
	电子邮箱	lizhao@guodu.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话	400-818-8118	95561	
传真	010-84183311	021-62159217	
注册地址	北京市东城区东直门南大街 3 号 国华投资大厦 9、10 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦	
办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号 国华投资大厦 9、10 层	上海市银城路 167 号	
邮政编码	100007	200120	
法定代表人	翁振杰	吕家进	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.guodu.com

址	
基金中期报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-422,363.23
本期利润	1,058,431.99
加权平均基金份额本期利润	0.0211
本期加权平均净值利润率	4.34%
本期基金份额净值增长率	4.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-27,265,508.32
期末可供分配基金份额利润	-0.5460
期末基金资产净值	24,498,953.85
期末基金份额净值	0.4906
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-50.94%

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。3. 所述期末基金业绩指标不包含持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

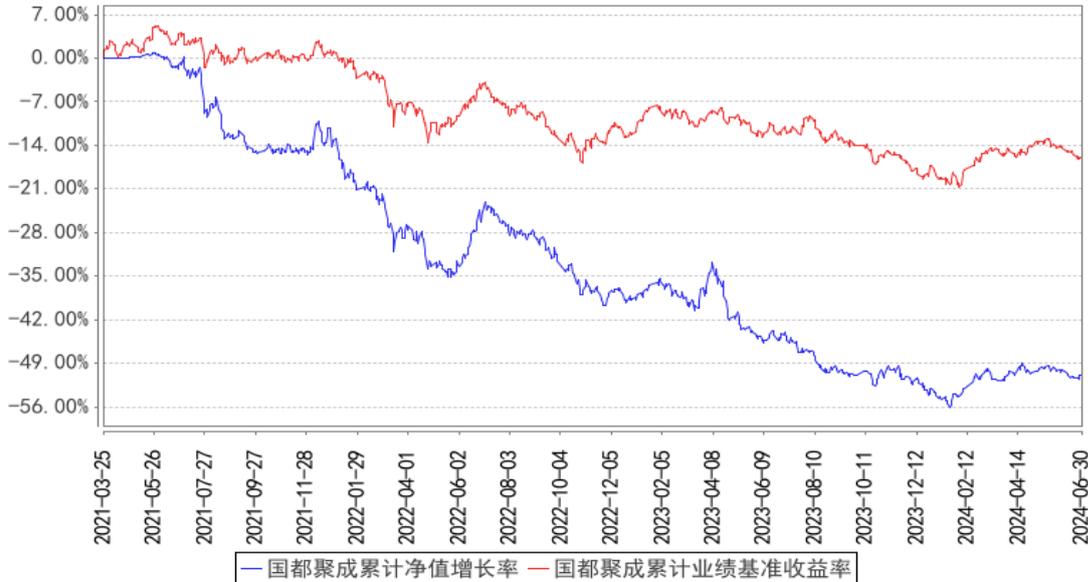
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.35%	0.60%	-1.73%	0.29%	0.38%	0.31%
过去三个月	0.31%	0.63%	-0.83%	0.44%	1.14%	0.19%
过去六个月	4.49%	0.76%	1.63%	0.53%	2.86%	0.23%
过去一年	-12.05%	0.81%	-4.63%	0.52%	-7.42%	0.29%
过去三年	-50.71%	0.98%	-19.07%	0.62%	-31.64	0.36%

					%	
自基金合同生效起至今	-50.94%	0.94%	-15.97%	0.62%	-34.97%	0.32%

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

国都聚成累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2014年8月19日,经中国证监会批准,公司获准开展公募基金管理业务资格,截至2024年6月30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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		（助理）期限		业年限	
		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	本基金的基金经理	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。
龚勇进	本基金的基金经理	2024年4月3日	-	4年	曾任北京鼎泰岩投资顾问有限公司（现更名为北京鸿熵私募基金管理有限公司）研究员、东兴基金管理有限公司研究员、国都证券股份有限公司证券投资业务总部投资经理、国都证券股份有限公司基金管理部基金经理助理。现任国都证券股份有限公司基金管理部基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资运作符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年市场面临的主要压力依然来自于现阶段宏观经济发展的态势，虽然一季度经济数据有阶段好转迹象，但由于内需不足导致消费进入到收缩区间，再投资增速回落；同时受益于全球补库需求提升，外贸出口数据有了显著提升，但依然难以补足投资端收缩造成的经济下行缺口，上半年整体经济内生动力仍略显不足。在这种大经济环境下，资本市场的预期度和风险承受度都显著下降，对利空信息的反应敏感度也明显提升，虽然部分板块阶段性强势，但持续性一般，板块和个股轮动速度较快，也大大增加了投资难度。

在这种经济情况下，本产品在今年上半年重点配置高分红、低估值标的，辅以出口链等相关标的加以组合配置。从目前的市场情绪来看，风险偏好下降和更注重低波稳定性是今年市场主要的风格特征，因此以红利赛道为主的策略相对更加符合当前市场特征。

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 0.4906 元，本报告期基金份额净值增长率 4.49%，业绩比较基准增长率 1.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年下半年的宏观经济形势依旧存在较大变数，强美元导致大宗价格居于高位，进而影响全球补库过程，有可能拉低我国下半年的出口增速；虽然美联储有望降息，但美国高额赤字和通胀摇摆不定，可见降息周期也颇为波折。同时国内经济预期偏弱的情况下，居民消费和负债意愿降低，房地产去库存压力依然较大，扩大内需依然是下半年经济工作的重心之一。

在这种经济预期下，资金风险偏好全面转向的可能性不高，市场对红利低波风格的偏好依然是未来一段时间的主旋律。因此，本产品在下半年依然以低波红利为主要配置方向，辅以出口链等相关标的加以组合配置的策略。同时我们也密切跟踪市场变化方向，根据市场变化适时调整配置策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基

金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,891,565.36	4,271,107.19
结算备付金		39,731.19	191,548.02
存出保证金		17,718.49	35,639.48
交易性金融资产	6.4.7.2	20,462,329.00	19,465,140.00
其中：股票投资		20,462,329.00	19,465,140.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		130,393.12	135,397.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		24,541,737.16	24,098,832.32
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	78,490.57
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,254.29	25,001.45
应付托管费		2,021.18	2,083.46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.9	16,507.84	53,471.18
负债合计		42,783.31	159,046.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	49,938,320.22	50,985,819.80
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-25,439,366.37	-27,046,034.14
净资产合计		24,498,953.85	23,939,785.66
负债和净资产总计		24,541,737.16	24,098,832.32

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.4906 元，基金份额总额 49,938,320.22 份。

6.2 利润表

会计主体：国都聚成混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,258,540.79	-2,552,566.42
1. 利息收入		7,881.77	13,040.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,881.77	13,040.69
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）		-230,137.05	-3,255,121.52
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-586,914.53	-3,360,521.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	356,777.48	105,399.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,480,795.22	689,057.70
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	0.85	456.71
减: 二、营业总支出		200,108.80	266,643.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	145,389.65	247,733.80
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,115.79	16,515.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	42,603.36	2,394.29
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		1,058,431.99	-2,819,210.08
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		1,058,431.99	-2,819,210.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,058,431.99	-2,819,210.08

6.3 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: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	50,985,819.80	-	-27,046,034.14	23,939,785.66
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	50,985,819.80	-	-27,046,034.14	23,939,785.66
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,047,499.58	-	1,606,667.77	559,168.19

(一)、综合收益总额	-	-	1,058,431.99	1,058,431.99
(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)	-1,047,499.58	-	548,235.78	-499,263.80
其中：1. 基金申购款	10,209.28	-	-5,217.02	4,992.26
2. 基金赎回款	-1,057,708.86	-	553,452.80	-504,256.06
(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	49,938,320.22	-	-25,439,366.37	24,498,953.85
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-4,463,878.79	-	-1,213,982.70	-5,677,861.49
(一)、综合收益总额	-	-	-2,819,210.08	-2,819,210.08
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-4,463,878.79	-	1,605,227.38	-2,858,651.41

其中：1. 基金申购款	723,502.63	-	-280,413.12	443,089.51
2. 基金赎回款	-5,187,381.42	-	1,885,640.50	-3,301,740.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（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	52,751,318.54	-	-23,327,733.29	29,423,585.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

翁振杰

封欣

陈蕾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

本基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都聚成混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，具体为股票（包括中小板、创业板及其他依法发行、

上市的股票)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券)、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款)、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年度上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的差错更正事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的

通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。证券投资基金管理人运用基金买卖股

票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,891,565.36
等于：本金	3,891,192.39
加：应计利息	372.97
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	3,891,565.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,062,606.68	-	20,462,329.00	1,399,722.32
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	19,062,606.68	-	20,462,329.00	1,399,722.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末投资债权。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备计提。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备计提。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期内未投资其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,049.48
其中：交易所市场	9,049.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	7,458.36
合计	16,507.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,985,819.80	50,985,819.80
本期申购	10,209.28	10,209.28
本期赎回（以“-”号填列）	-1,057,708.86	-1,057,708.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	49,938,320.22	49,938,320.22

注：本期申购份额含红利再投、转换入份额，本期赎回份额含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,414,224.11	368,189.97	-27,046,034.14
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-27,414,224.11	368,189.97	-27,046,034.14
本期利润	-422,363.23	1,480,795.22	1,058,431.99
本期基金份额交易产生的变动数	571,079.02	-22,843.24	548,235.78
其中：基金申购款	-5,606.94	389.92	-5,217.02
基金赎回款	576,685.96	-23,233.16	553,452.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,265,508.32	1,826,141.95	-25,439,366.37

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	6,919.54
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	760.20	
其他	202.03	
合计	7,881.77	

注：“其他”为结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-586,914.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-586,914.53

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	55,198,663.07
减：卖出股票成本总额	55,648,306.44
减：交易费用	137,271.16
买卖股票差价收入	-586,914.53

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	356,777.48
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	356,777.48

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,480,795.22

股票投资	1,480,795.22
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,480,795.22

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	0.85
合计	0.85

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	7,458.36
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	145.00
持有人大会费用	10,000.00
律师费用	25,000.00
合计	42,603.36

6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国都证券股份有限公司	110,363,363.29	100.00	428,979,977.86	100.00

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)

国都证券股份有 限公司	102,593.67	100.00	9,049.48	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券股份有 限公司	395,224.89	100.00	53,425.62	100.00

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。2、关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	145,389.65	247,733.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	363.47	568.49
应支付基金管理人的净管理费	145,026.18	247,165.31

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,115.79	16,515.57

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	3,891,192.39	6,919.54	7,731,581.46	10,583.46

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险

容忍度、风险限额等指标，在确保整体风险可承受的前提下，积极、恰当地管理风险，实现经风险调整后的收益最大化。

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

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

监事会负责监督董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

经营管理层及其合规与风险管理委员会负责建设公司全面风险管理体系，组织实施董事会通过的风险管理政策，在董事会授权范围内对风险管理重大事项进行决策，向董事会报告风险管理工作 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，并领导风险管理部门的工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

1、政策风险

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

2、经济周期风险

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

3、购买力风险

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

4、上市公司经营风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于证券，收益水平会受到利率变化的影响。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,891,192.39	-	-	372.97	3,891,565.36
结算备付金	39,713.39	-	-	17.80	39,731.19
存出保证金	17,710.49	-	-	8.00	17,718.49
交易性金融资产	-	-	-	20,462,329.00	20,462,329.00
应收清算款	-	-	-	130,393.12	130,393.12
资产总计	3,948,616.27	-	-	20,593,120.89	24,541,737.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,254.29	24,254.29
应付托管费	-	-	-	2,021.18	2,021.18
其他负债	-	-	-	16,507.84	16,507.84
负债总计	-	-	-	42,783.31	42,783.31
利率敏感度缺口	3,948,616.27	-	-	20,550,337.58	24,498,953.85
上年度末 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	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					
应付管理人报酬	-	-	-	25,001.45	25,001.45
应付托管费	-	-	-	2,083.46	2,083.46
应付清算款	-	-	-	78,490.57	78,490.57
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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	20,462,329.00	83.52	19,465,140.00	81.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	20,462,329.00	83.52	19,465,140.00	81.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去一年的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足一年的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-560,955.14	-752,642.35
	沪深 300 指数上涨 5%	560,955.14	752,642.35

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平，以过去 250 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 224217.31 元，占基金资产净值比例为 0.92%。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

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

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	20,462,329.00	19,465,140.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	20,462,329.00	19,465,140.00

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 12 月 31 日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,462,329.00	83.38
	其中：股票	20,462,329.00	83.38
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	3,931,296.55	16.02
8	其他各项资产	148,111.61	0.60
9	合计	24,541,737.16	100.00

注：由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,743,070.00	15.28
C	制造业	9,221,059.00	37.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,797,100.00	7.34
E	建筑业	1,115,600.00	4.55
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,040,100.00	4.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	305,500.00	1.25
J	金融业	2,870,300.00	11.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	369,600.00	1.51
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,462,329.00	83.52

注：以上行业分类以 2024 年 6 月 30 日的中国上市公司协会行业分类标准为依据。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	20,000	1,290,000.00	5.27

2	003816	中国广核	250,000	1,157,500.00	4.72
3	601398	工商银行	200,000	1,140,000.00	4.65
4	600019	宝钢股份	150,000	997,500.00	4.07
5	601288	农业银行	180,000	784,800.00	3.20
6	002594	比亚迪	3,000	750,750.00	3.06
7	600585	海螺水泥	30,000	707,700.00	2.89
8	601988	中国银行	150,000	693,000.00	2.83
9	601975	招商南油	190,000	682,100.00	2.78
10	601088	中国神华	15,000	665,550.00	2.72
11	600938	中国海油	20,000	660,000.00	2.69
12	601985	中国核电	60,000	639,600.00	2.61
13	600150	中国船舶	15,000	610,650.00	2.49
14	002563	森马服饰	100,000	581,000.00	2.37
15	600177	雅戈尔	70,000	498,400.00	2.03
16	300979	华利集团	8,000	486,800.00	1.99
17	600160	巨化股份	20,000	482,600.00	1.97
18	600039	四川路桥	60,000	473,400.00	1.93
19	600398	海澜之家	50,000	462,000.00	1.89
20	600188	兖矿能源	20,000	454,600.00	1.86
21	600028	中国石化	70,000	442,400.00	1.81
22	601857	中国石油	40,000	412,800.00	1.68
23	601225	陕西煤业	16,000	412,320.00	1.68
24	000538	云南白药	8,000	409,200.00	1.67
25	601600	中国铝业	50,000	381,500.00	1.56
26	000526	学大教育	6,000	369,600.00	1.51
27	600875	东方电气	20,000	369,000.00	1.51
28	601006	大秦铁路	50,000	358,000.00	1.46
29	601899	紫金矿业	20,000	351,400.00	1.43
30	601808	中海油服	20,000	344,000.00	1.40
31	603606	东方电缆	7,000	341,670.00	1.39
32	000528	柳工	30,000	335,700.00	1.37
33	605499	东鹏饮料	1,500	323,625.00	1.32
34	601611	中国核建	40,000	323,600.00	1.32
35	601668	中国建筑	60,000	318,600.00	1.30
36	600050	中国联通	65,000	305,500.00	1.25
37	600901	江苏金租	50,000	252,500.00	1.03
38	600809	山西汾酒	400	84,352.00	0.34
39	000568	泸州老窖	400	57,396.00	0.23
40	000858	五粮液	400	51,216.00	0.21

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	000625	长安汽车	1,852,863.00	7.74
2	600188	兖矿能源	1,590,561.00	6.64
3	000333	美的集团	1,373,500.00	5.74
4	000002	万科 A	1,246,700.00	5.21
5	600150	中国船舶	1,025,191.00	4.28
6	600362	江西铜业	972,500.00	4.06
7	000526	学大教育	967,990.00	4.04
8	300394	天孚通信	946,150.00	3.95
9	600938	中国海油	942,380.00	3.94
10	600160	巨化股份	928,200.00	3.88
11	600019	宝钢股份	927,200.00	3.87
12	000725	京东方 A	876,900.00	3.66
13	003816	中国广核	856,392.00	3.58
14	300729	乐歌股份	839,226.00	3.51
15	601985	中国核电	820,500.00	3.43
16	601006	大秦铁路	808,000.00	3.38
17	300750	宁德时代	787,600.00	3.29
18	600026	中远海能	765,365.22	3.20
19	605499	东鹏饮料	762,300.00	3.18
20	300274	阳光电源	759,646.00	3.17
21	002594	比亚迪	753,000.00	3.15
22	600901	江苏金租	749,100.00	3.13
23	601975	招商南油	744,400.00	3.11
24	300763	锦浪科技	700,794.00	2.93
25	600028	中国石化	692,100.00	2.89
26	002832	比音勒芬	673,374.00	2.81
27	600585	海螺水泥	668,278.00	2.79
28	601899	紫金矿业	668,091.00	2.79
29	002466	天齐锂业	664,052.00	2.77
30	301030	仕净科技	651,450.00	2.72
31	002563	森马服饰	648,600.00	2.71
32	000858	五粮液	647,398.00	2.70
33	600801	华新水泥	625,922.00	2.61
34	601988	中国银行	617,100.00	2.58
35	603663	三祥新材	590,800.00	2.47
36	600050	中国联通	585,100.00	2.44
37	600845	宝信软件	582,917.00	2.43
38	600941	中国移动	581,709.00	2.43
39	300751	迈为股份	575,100.00	2.40
40	600373	中文传媒	566,100.00	2.36
41	000528	柳工	561,560.00	2.35
42	000895	双汇发展	561,200.00	2.34

43	600398	海澜之家	551,621.00	2.30
44	300979	华利集团	546,950.00	2.28
45	600377	宁沪高速	545,700.00	2.28
46	603977	国泰集团	534,900.00	2.23
47	002601	龙佰集团	502,693.00	2.10
48	603197	保隆科技	499,734.00	2.09
49	600309	万华化学	496,269.00	2.07
50	600060	海信视像	489,170.00	2.04
51	600039	四川路桥	488,600.00	2.04
52	601689	拓普集团	484,999.00	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000625	长安汽车	1,804,900.00	7.54
2	688017	绿的谐波	1,575,535.54	6.58
3	600845	宝信软件	1,306,602.00	5.46
4	600188	兖矿能源	1,257,886.00	5.25
5	000002	万科 A	1,234,408.00	5.16
6	000526	学大教育	1,154,922.00	4.82
7	300729	乐歌股份	1,131,272.00	4.73
8	300394	天孚通信	1,041,108.00	4.35
9	600362	江西铜业	1,038,904.00	4.34
10	600150	中国船舶	1,038,450.00	4.34
11	603662	柯力传感	1,031,296.00	4.31
12	300274	阳光电源	810,000.00	3.38
13	000725	京东方 A	809,000.00	3.38
14	600026	中远海能	807,840.00	3.37
15	300750	宁德时代	755,076.00	3.15
16	601225	陕西煤业	741,780.00	3.10
17	600801	华新水泥	701,033.00	2.93
18	300763	锦浪科技	680,236.00	2.84
19	002466	天齐锂业	641,043.00	2.68
20	600941	中国移动	612,036.00	2.56
21	000858	五粮液	591,584.00	2.47
22	301030	仕净科技	583,583.00	2.44
23	603663	三祥新材	580,257.00	2.42
24	688213	思特威	575,000.00	2.40
25	002601	龙佰集团	572,951.00	2.39
26	600377	宁沪高速	566,353.00	2.37

27	300788	中信出版	564,236.00	2.36
28	002832	比音勒芬	562,001.00	2.35
29	601088	中国神华	559,797.00	2.34
30	600938	中国海油	558,970.00	2.33
31	000895	双汇发展	550,400.00	2.30
32	603200	上海洗霸	547,403.00	2.29
33	600309	万华化学	541,262.00	2.26
34	002019	亿帆医药	534,352.00	2.23
35	600373	中文传媒	520,728.00	2.18
36	002773	康弘药业	509,206.00	2.13
37	600519	贵州茅台	505,200.00	2.11
38	600060	海信视像	492,425.40	2.06
39	300751	迈为股份	491,188.00	2.05
40	601689	拓普集团	491,100.00	2.05
41	301311	昆船智能	490,000.00	2.05
42	300580	贝斯特	487,636.00	2.04
43	688041	海光信息	483,718.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	55,164,700.22
卖出股票收入（成交）总额	55,198,663.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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、员工）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、员工）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。中国银行股份有限公司（包含公司高管、分支行、分支行高管、员工）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。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,718.49

2	应收清算款	130,393.12
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	148,111.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
399	125,158.70	19,998,900.00	40.05	29,939,420.22	59.95

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	658,357.77	1.3183

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	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 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	50,985,819.80
本报告期基金总申购份额	10,209.28
减：本报告期基金总赎回份额	1,057,708.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	49,938,320.22

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2024 年 2 月 2 日至 2024 年 2 月 29 日期间以通讯方式二次召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于 2024 年 2 月 29 日 17:00 截止，会议审议了《关于国都聚成混合型证券投资基金持续运作的议案》。本次基金份额持有人大会中，基金份额持有人所代表的 20,411,706.45 份有效基金份额参加了此次持有人大会，且其所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 38.72%（权益登记日与第一次持有人大会权益登记日保持一致为 2023 年 8 月 4 日，权益登记日本基金总份额 52,713,056.20 份），达到二次召开基金份额持有人大会的法定条件，符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定。参会的基金份额持有人所代表的 20,411,706.45 份基金份额表示同意，占参与投票的基金份额总数的 100%；0 份基金份额表示反对，占参与投票的基金份额总数的 0%；0 份基金份额表示弃权，占参与投票的基金份额总数的 0%。上述表决结果中同意票所代表的基金份额达到参加本次大会的基金份额持有人所持基金份额表决权的二分之一以上（含二分之一），符合《基金法》、《运作办法》和《基金合同》的有关规定，会议议案有效通过。本次基金份额持有人大会于 2024 年 3 月 4 日表决通过了《关于国都聚成混合型证券投资基金持续运作的议案》，本次大会决议自该日起生效。基金管理人已于 2024 年 3 月 5 日在指定信息披露媒介及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动：

1、公司层面

无。

2、基金业务层面

无。

3、期后事项

本公司董事会于 2024 年 7 月 29 日收到副总经理刘仲哲先生递交的辞职报告，自 2024 年 7 月 29 日起辞职生效。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国都证券股份有限公司	2	110,363,363.29	100.00	102,593.67	100.00	-

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

的佣金合计，不单指股票交易佣金。2、本基金本报告期内无新增和剔除席位，与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国都聚成混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定媒体	2024 年 1 月 19 日
2	国都证券股份有限公司关于以通讯方式二次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	2024 年 1 月 30 日
3	国都证券股份有限公司关于以通讯方式二次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	2024 年 1 月 31 日
4	国都证券股份有限公司关于以通讯方式二次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	2024 年 2 月 1 日
5	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（二次召开）表决结果暨决议生效的公告	证监会指定媒体	2024 年 3 月 5 日
6	国都聚成混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定媒体	2024 年 3 月 29 日
7	国都证券股份有限公司关于持有 5% 以上股权的股东持股情况变动公告	证监会指定媒体	2024 年 4 月 2 日
8	国都证券股份有限公司第一大股东变更公告	证监会指定媒体	2024 年 4 月 2 日
9	国都证券股份有限公司拟发生特定事项协议转让的提示性公告	证监会指定媒体	2024 年 4 月 2 日

10	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	2024 年 4 月 9 日
11	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	2024 年 4 月 10 日
12	国都聚成混合型证券投资基金招募说明书(更新)2024 年 1 号	证监会指定媒体	2024 年 4 月 10 日
13	国都聚成混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定媒体	2024 年 4 月 19 日
14	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	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2024-06-25 至 2024-06-30	9,999,450.00	-	-	9,999,450.00	20.0236
	2	2024-06-25 至 2024-06-30	9,999,450.00	-	-	9,999,450.00	20.0236

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.guodu.com。

12.3 查阅方式

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

国都证券股份有限公司

2024 年 8 月 29 日